

**Қазақстан Республикасының бағалы қағаздар нарығының
2011 жылғы 1 шілдедегі ағымдағы жағдайы**

Осы кездегі Қазақстан Республикасының бағалы қағаздар нарығының институционалды инфрақұрылымы мынадай үлгіде ұсынылады.

	1.07.10	1.10.10	1.01.11	1.04.11	1.07.11
Оның ішінде барлық брокерлер-дилерлер:	81	78	76	76	76
банктер	24	24	24	24	24
олардың I -санаттағысы	22	22	22	22	22
банктік емес ұйымдар	52	49	47	47	47
олардың I -санаттағысы	42	41	39	39	39
АӨҚО қатысушылары	5	5	5	5	5
Тіркеушілер	11	10	10	10	10
Кастодиандар	11	10	10	10	10
ЖЗҚ зейнетақы активтерін инвестициялық басқарушылар	16	15	15	16	16
Инвестициялық портфельді басқарушылар, оның ішінде:	49	43	39	38	38
инвестициялық компаниялар	2	2	2	2	2
ӨӨРУ	2	2	2	2	2
Трансфер-агенттер	3	3	3	3	3
Бағалы қағаздармен сауда-саттықты ұйымдастырушы	1	1	1	1	1

2011 жылғы екінші тоқсанда бағалы қағаздар нарығындағы қызметті жүзеге асыру құқығына 1 лицензия ("JAZZ CAPITAL" брокерлік үйі» АҚ) берілді. Сонымен қатар номиналды ұстаушы ретінде клиенттер шоттарын жүргізу құқығымен брокерлік және дилерлік қызметті жүзеге асыруға берілген 1 лицензияның («Верный Капитал» АҚ) қолданылуы тоқтатылды.

(млн. теңге)

	1.04.11.	1.07.11.	2011 жылғы II тоқсандағы өзгеруі, %-бен
Жиынтық активтер*, оның ішінде:	158 124	162 310	2,6
брокерлер-дилерлер	7 051	6 223	-11,7
брокерлер-дилерлер (АӨҚО қатысушылары)	956	979	2,4
тіркеушілер	1 206	1 300	7,8
ИПБ	104 619	110 163	5,3
инвестициялық компаниялар	36 044	36 230	0,5
ЗАИБЖАҰ	8 248	7 415	-10,1
Міндеттемелер, оның ішінде:	22 883	28 016	22,4
брокерлер-дилерлер	1 412	623	-55,9
брокерлер-дилерлер (АӨҚО қатысушылары)	15	13	-13,3
тіркеушілер	49	122	в 2,5 раза
ИПБ	12 529	18 028	43,9
инвестициялық компаниялар	8 681	9 150	5,4
ЗАИБЖАҰ	197	80	-59,4
Капитал, оның ішінде:	135 241	134 294	-0,7
брокерлер-дилерлер	5 639	5 600	-0,7

* ЕДБ қоспағанда қаржылық көрсеткіштер бойынша ақпарат

брокерлер-дилерлер (АӨҚО қатысушылары)	941	966	2,7
тіркеушілер	1 157	1 178	1,8
ИПБ	92 090	92 135	0,0
инвестициялық компаниялар	27 363	27 080	-1,0
ЗАИБЖАҰ	8 051	7 335	-8,9
Жарғылық капитал, оның ішінде:	114 717	115 774	0,9
брокерлер-дилерлер	3 996	4 166	4,3
брокерлер-дилерлер (АӨҚО қатысушылары)	1 157	1 157	-
Тіркеушілер	1 161	1 161	-
ИПБ	78 233	78 877	0,8
инвестициялық компаниялар	21 050	21 293	1,2
ЗАИБЖАҰ	9 120	9 120	-

Эмитенттер және қаржы құралдары Акциялар шығарылымы

Акциялар шығарылымы және шығарылымдарды жою туралы деректер

	2010 жылғы 2-тоқсанда	2010 жылғы 3-тоқсанда	2010 жылғы 4-тоқсанда	2011 жылғы 1-тоқсанда	2011 жылғы 2-тоқсанда
Шығарылымдар тіркелді	7	12	16	9	6
Шығарылым және орналастыру қорытындысы туралы есептер	151	182	172	178	174
Шығарылымдар жойылды	18	17	15	9	14

Есепті күнде қолданыстағы акциялар шығарылымының жалпы саны 2 168 құрады. 2011 жылғы екінші тоқсанда 153 акциялар шығарылымы (оның ішінде шығарылымдар проспектілеріне енгізілген өзгерістер) тіркелді, акциялардың шығарылымы және орналастыру қорытындысы туралы 174 есеп бекітілді, сондай-ақ 14 акциялар шығарылымы жойылды.

Тіркелген мемлекеттік емес облигациялар шығарылымы туралы деректер

	2010 жылғы 2-тоқсанда	2010 жылғы 3-тоқсанда	2010 жылғы 4-тоқсанда	2011 жылғы 1-тоқсанда	2011 жылғы 2-тоқсанда
Шығарылымдар саны	5	9	6	3	10
Шығарылымдар көлемі, млн. теңгемен	317 850	402 515	352 500	14 000	80 000

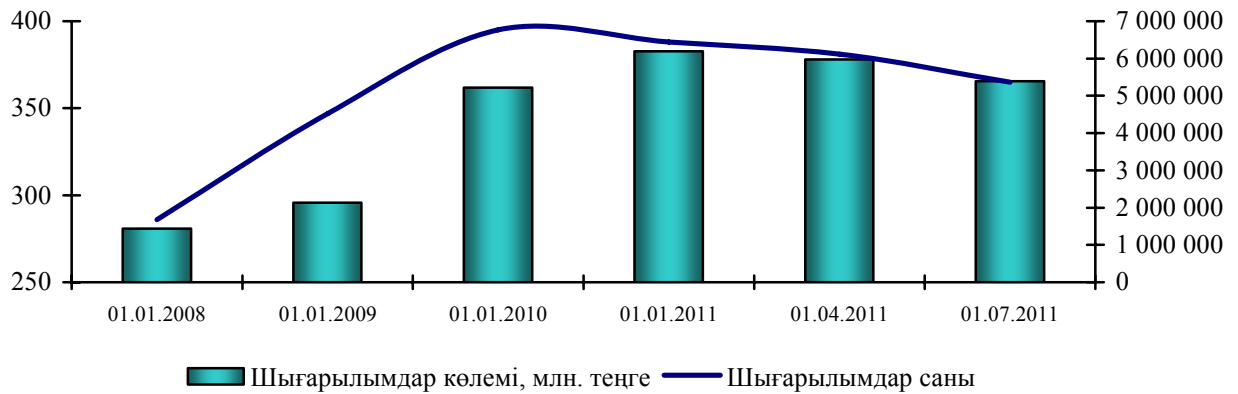
Комитет 2011 жылғы екінші тоқсан ішінде жалпы көлемі 80 000 млн. теңгемен мемлекеттік емес облигациялардың 10 шығарылымын тіркеді.

Мемлекеттік емес облигациялардың қолданыстағы шығарылымы туралы деректер

	2010 жылғы 1 шілдеде	2010 жылғы 1 қазанда	2011 жылғы 1 қаңтарда	2011 жылғы 1 сәуірде	2011 жылғы 1 шілдеде
Шығарылымдар саны	386	387	388	381	365
Шығарылымдар көлемі, млн. теңгемен	5 488 811	5 860 836	6 196 336	5 973 516	5 393 016

2011 жылғы 1 шілдедегі жағдай бойынша жиынтық номиналды құны 5 393 016 млн. теңгені құрайтын қолданыстағы облигациялар шығарылымының саны 365 болды, олардың ішінде рейтингтік бағасы бар 123 шығарылымы, 82 шығарылымы – бірінші шағын санаттың рейтингтік бағасы жоқ, 29 шығарылымы – екінші шағын санаттың рейтингтік бағасы жоқ және 6 шығарылымы – буферлік санатты KASE ресми тізіміне енгізілген.

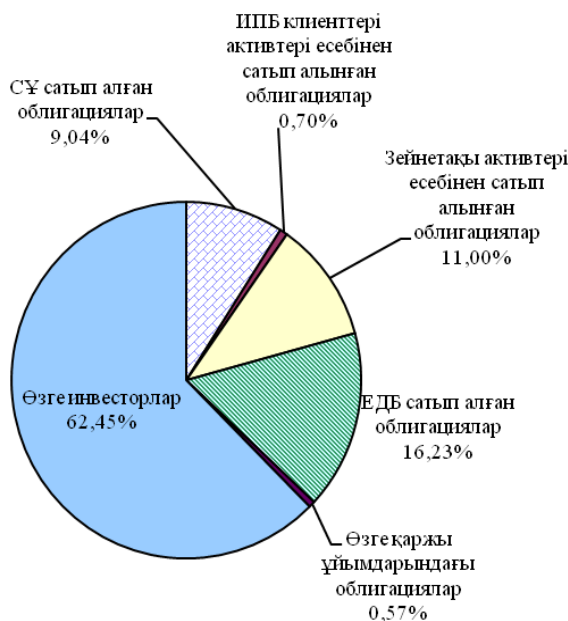
Қолданыстағы облигациялар шығарылымдарының саны мен көлемінің өзгеру динамикасы



2011 жылғы 1 шілдедегі жағдай бойынша корпоративті облигациялардың қолданыстағы шығарылымдарының жиынтық көлемі былайша көрініс алады:

- зейнетақы активтері есебінен сатып алынған облигациялар – 11,00%;
- екінші деңгейдегі банктер сатып алған облигациялар – 16,23%;
- инвестициялық портфельді басқарушы клиенттердің активтері есебінен сатып алынған облигациялар – 0,71%;
- сақтандыру (қайта сақтандыру) ұйымдары сатып алған облигациялар – 9,04%;
- өзге қаржы ұйымдары сатып алған облигациялар – 0,57%;
- өзге инвесторлар – 62,45%.

1.07.2011 ҚР корпоративті облигацияларының қолданыстағы шығарылымдарының жиынтық көлеміндегі инвесторлармен сатып алынған облигациялар үлесі



ҚР корпоративтік облигацияларының қолданыстағы шығарылымдарының жиынтық көлеміндегі 62,5%-ы кәсіби емес инвесторлардың үлесіне тиеді. Институционалды инвесторлар– облигацияларды ұстаушылардың (ИПБ клиенттерінің активтері және ЗА) Қазақстан Республикасының аумағында шығарылған облигациялардың жалпы көлеміндегі үлес салмағы 11,7% болды.

Тіркелген пайлар шығарылымдары туралы деректер

	2010 жылғы 2-тоқсанда	2010 жылғы 3-тоқсанда	2010 жылғы 4-тоқсанда	2011 жылғы 1-тоқсанда	2011 жылғы 2-тоқсанда
Шығарылымдар тіркелді	0	3	2	1	4
Шығарылым және орналастыру қорытындысы туралы есептер бекітілді	32	25	35	26	23
Қолданыстағы шығарылымдар	171	168	162	156	155

2011 жылғы 1 шілдеде қолданыстағы пайлар шығарылымының саны 155 болды. Бұл ретте 2011 жылғы сәуір-маусым айларында шығарылым мен орналастыру қорытындылары туралы 23 есеп бекітілді және 5 шығарылым өтелді.

Қазақстан Республикасының аумағында айналыста болатын мемлекеттік бағалы қағаздар *

	(млн. теңге)				
	2010 жылғы 1 шілдеде	2010 жылғы 1 қазанда	2011 жылғы 1 қаңтарда	2011 жылғы 1 сәуірде	2011 жылғы 1 шілдеде
Айналыста барлығы, оның ішінде	2 488 709	2 649 062	2 569 002	3 201 936	3 146 646
Ұлттық Банктің ноттары	990 258	1 014 378	899 542	1 449 137	1 330 612

* Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің деректері бойынша ұсынылған ақпарат

Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	1 498 451	1 634 684	1 669 460	1 752 799	1 816 035
Жергілікті атқарушы органдарының бағалы қағаздары

Бағалы қағаздардың биржалық нарығының негізгі көрсеткіштері**

Қазақстандағы қор нарығының жай-күйінің негізгі индикаторы болып, бұрынғыша – KASE қор биржасы ұсынған ұйымдасқан нарығы болып табылады.

Ағымдағы жылғы 1 шілдеде бағалы қағаздары KASE сауда-саттығына жіберілген қазақстандық эмитенттер туралы ақпарат мынадай түрде көрінеді.

KASE сауда-саттығына жіберілген бағалы қағаздар

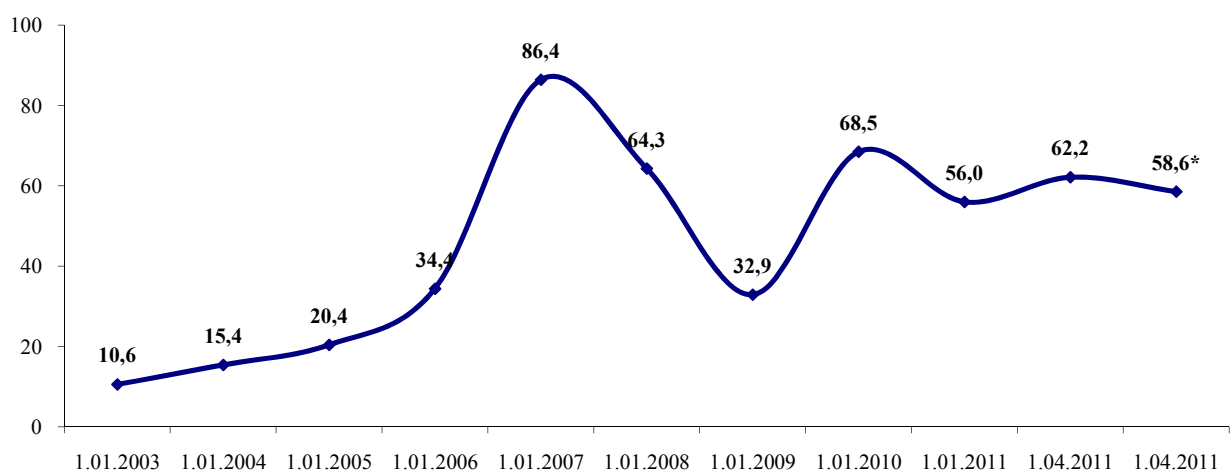
	шығарылым саны	эмитенттер саны
"Акциялар" секторы:	91	65
"Борыштық бағалы қағаздар" секторы:	240	72
"Инвестициялық қорлардың бағалы қағаздары" секторы:	2	2
"Депозитарлық қолхаттар" секторы:	0	0
"Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары" секторы:	1	1
"Мемлекеттік бағалы қағаздар" секторы:	175	3
"Туынды бағалы қағаздар" секторы:	0	0
"Баламалы алаң"	0	0
Жиынтығы:	509	109

KASE айналымына жіберілген бағалы қағаздардың негізгі үлес салмағы борыштық бағалы қағаздарға – 47,1% (240 шығарылым) келеді. Акциялар және мемлекеттік бағалы қағаздары секторы бойынша тиісінше 17,9% (91 шығарылым) және 34,4% (175 шығарылым) болып келеді. Инвестициялық қорлардың бағалы қағаздарының үлесі 0,4%-ды (2 шығарылым) құрайды. Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздарының үлесіне 0,2% (1 шығарылым) келеді.

Мемлекеттік емес бағалы қағаздар бойынша KASE жалпы капиталдандыру 13 926 882 млн. теңгені немесе ЖІӨ-ден 58,6% құрады. 2011 жылғы 1 сәуірдегі жағдай бойынша осындай көрсеткіш 14 781 236 млн. теңгені немесе ЖІӨ-ден 62,2% құрады. Осылайша, қор нарығын капиталдандырудың абсолюттік көріністегі азаюы да, сондай ЖІӨ-ге қатысты қор нарығын капиталдандыру көрсеткішінің азаюы да байқалады.

** Биржа нарығы жөніндегі ақпарат KASE деректері бойынша ұсынылған

ЖІӨ-ге KASE-тің капиталдандырылуы *



ҚР Экономикалық даму және сауда министрлігінің реси сайтынан алынған деректер (23 780.9 млрд.теңге)

KASE-тегі мемлекеттік емес бағалы қағаздармен жасалған мәмілелер көлемі

	(млн. теңге)		(млн. теңге)	
	2010 жылғы 3-тоқсанда	2010 жылғы 4-тоқсанда	2011 жылғы 1-тоқсанда	2011 жылғы 2-тоқсанда
бастапқы орналастыру:	78 184	0	0	19 485
– "Акциялар" секторы бойынша	14 315	0	0	0
– "Борыштық бағалы қағаздар" секторы бойынша	63 869	0	0	19 485
– "Инвестициялық қорлардың бағалы қағаздары" секторы бойынша	0	0	0	0
– "Депозитарлық қолхаттар" секторы бойынша	0	0	0	0
– "Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары" секторы бойынша	0	0	0	0
– "Туынды бағалы қағаздар" секторы бойынша	0	0	0	0
қосалқы айналыс:	48 171	300 700	164 502	107 222
– "Акциялар" секторы бойынша	12 088	220 940	91 046	26 999
– "Борыштық бағалы қағаздар" секторы бойынша	36 083	79 760	73 456	80 223
– "Инвестициялық қорлардың бағалы қағаздары" секторы бойынша	0	0	0	0
– "Депозитарлық қолхаттар" секторы бойынша	0	0	0	0
– "Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары" секторы бойынша	0	0	0	0
– "Туынды бағалы қағаздар" секторы бойынша	0	0	0	0
"Листингтік емес бағалы қағаздар" секторы	49	419	206	171
"репо" мәмілелері:	51 591	51 741	33 042	24 406
– "Акциялар" секторы бойынша	36 416	34 704	22 600	21 096

– "Борыштық бағалы қағаздар" секторы бойынша	15 175	17 037	10 442	3 310
– "Инвестициялық қорлардың бағалы қағаздары" секторы бойынша	0	0	0	0
– "Депозитарлық қолхаттар" секторы бойынша	0	0	0	0
– "Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары" секторы бойынша	0	0	0	0
– "Туынды бағалы қағаздар" секторы бойынша	0	0	0	0
– "Листингтік емес бағалы қағаздар" секторы	0	0	0	0
Жиынтығы	177 995	352 860	197 750	151 284

Кестеде келтірілген деректерден көрініп отырғандай, 2011 жылдың екінші тоқсанында мемлекеттік емес бағалы қағаздармен жасалған мәмілелер көлемі 23,5%-ға азайды.

KASE-тегі мемлекеттік бағалы қағаздармен жасалған мәмілелер көлемі

	(млн. теңге)				
	2010 жылғы 2-тоқсанда	2010 жылғы 3-тоқсанда	2010 жылғы 4-тоқсанда	2011 жылғы 1-тоқсанда	2011 жылғы 2-тоқсанда
Мәмілелер көлемі, оның ішінде:					
бастапқы орналастырулар	7 151 154	6 419 236	6 748 680	4 939 502	6 806 329
"репо" мәмілелері	177 759	224 639	113 994	151 011	135 903
	6 804 339	6 034 153	6 458 687	4 666 525	6 543 358

Ағымдағы жылдың 2-тоқсанында ұйымдасқан нарықтағы мемлекеттік бағалы қағаздар бойынша жасалған биржалық мәмілелер көлемі 37,8%-ға өсті. Бастапқы орналастырулар көлемі 10,0%-ға азайды. Мемлекеттік бағалы қағаздармен жасалған мәмілелердің жалпы көлеміндегі "репо" мәмілесінің үлесі 40,2%-ға ұлғайды.

KASE капиталдандырылуының өзгеру динамикасы

	(млн.теңге)				
Ресми тізім секторы	2010 жылғы 1 шілдеде	2010 жылғы 1 қазанда	2011 жылғы 1 қаңтарда	2011 жылғы 1 сәуірде	2011 жылғы 1 шілдеде
"Акциялар" секторы:	7 323 426	8 010 139	8 959 446	8 986 259	8 115 762
"Борыштық бағалы қағаздар" секторы	3 756 270	2 946 154	3 087 177	5 793 198	5 809 341
"Инвестициялық қорлардың бағалы қағаздары" секторы	1 779	1 779	1 779	1 779	1 779
"Депозитарлық қолхаттар" секторы	0	0	0	0	0
"Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары" секторы	0	0	0	0	0
"Мемлекеттік бағалы қағаздар" секторы	2 499 076	2 671 140	2 588 486	3 223 494	3 167 208
"Туынды бағалы қағаздар"	0	0	0	0	

секторы					
Жиынтығы	13 580 551	13 629 212	14 636 888	18 004 730	17 094 090

Кестеде келтірілген деректерден көрініп отырғандай, KASE ресми тізіміне кіргізілген мемлекеттік бағалы қағаздар бойынша нарықты жалпы капиталдандыру 2011 жылғы 1 шілдедегі жағдай бойынша 2011 жылғы 1 сәуірдегі көрсеткішпен салыстарғанда 5,1%-ға азайды.

Бағалы қағаздар нарығындағы инвесторлар Инвестициялық басқарудағы зейнетақы активтері

2011 жылғы 1 шілдедегі жағдай бойынша ЗАИБЖАҰ-ның инвестициялық басқаруындағы зейнетақы активтерінің жиынтық көлемі 2011 жылдың 2-тоқсанында 107,2 млрд. теңгеге немесе 4,6%-ға өсіп, 2 454,1 млрд. теңге болды.

Зейнетақы активтерінің орташа айлық өсімі 2010 жылғы 1 шілдедеден бастап 2011 жылғы 1 шілдеге дейінгі кезеңде 36,3 млрд. теңге болды.

Зейнетақы активтерінің жиынтық көлемін бөлу

ЗАИБЖАҰ/ ЖЗҚ	зейнетақы активтері	
	млн. теңге	%-бен
«Қазақстан Халық Банкі ЖЗҚ» АҚ, «Қазақстан Халық Банкі» АҚ ЕҰ	822 383	33,51
«UYGA» ЖЗҚ» АҚ»	433 114	17,65
"Жетісу" ЗАИБЖАҰ" АҚ	415 443	16,93
«ҰларҮміт» ЖЗҚ» АҚ»	415 443	16,93
"GRANTUM Asset Management" ЗАИБЖАҰ" АҚ («Казкоммерцбанк» АҚ ЕҰ)	199 762	8,14
«ГРАНТУМ» ЖЗҚ» АҚ («Казкоммерцбанк» АҚ ЕҰ)	199 762	8,14
«Капитал» ЖЗҚ» АҚ - «Банк ЦентрКредит» АҚ еншілес ұйымы	127 436	5,19
«Мұнайгаз – Дем» ЖЗҚ» АҚ	89 366	3,64
«Еуразиялық ЖЗҚ» АҚ	75 271	3,07
«Атамекен» ЖЗҚ» АҚ «Нұрбанк» АҚ ЕҰ	74 959	3,06
«Отан» АЖЗҚ» АҚ	68 322	2,78
«РЕСПУБЛИКА» ЖЗҚ» АҚ	67 167	2,74
«Аманат Қазақстан» ЖЗҚ» АҚ	57 209	2,33
«Қазақмыс» ЖЗҚ» АҚ	23 665	0,96
Барлық ЖЗҚ бойынша жиынтығы	2 454 097	100

2011 жылдың 2-тоқсанында инвестицияланған зейнетақы активтерінің көлемі 113,6 млрд. теңгеге немесе 5,0%-ға өсіп, 2011 жылғы 1 шілдеде 2 404,8 млрд. теңге болды.

Жинақтаушы зейнетақы қорларының инвестициялық портфеліндегі ҚР эмитенттерінің мемлекеттік бағалы қағаздарының үлесі инвестицияланған зейнетақы активтерінің жалпы көлемінен 45,8%-ды (1 101,0 млрд. теңге) құрайды және 2011 жылғы 1 сәуірдегі жағдай бойынша осындай көрсеткішке қатысты 80,3 млрд. теңгеге өсті. ҚР мемлекеттік емес бағалы қағаздардың үлесі 2011 жылғы 1 шілдедегі жағдай бойынша инвестицияланған зейнетақы активтерінің жалпы көлемінен 30,3%-ды (729,2 млрд. теңге) құрады.

ЖЗҚ-ның жиынтық инвестициялық портфелі

Қаржы құралдары	1.04.2011.		1.07.2011.	
	млн. теңге	%	млн. теңге	%
ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары, оның ішінде	1 020 751	44,55	1 101 010	45,79
Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	916 676	40,01	916 567	38,12
Ұлттық Банктің ноттары	98 585	4,30	178 805	7,44
орталық атқарушы органдардың бағалы қағаздары	5 489	0,24	5 638	0,23
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес бағалы қағаздары	227 385	9,92	233 102	9,69
акциялар	87 787	3,83	88 293	3,67
облигациялар	139 598	6,09	144 809	6,02
Шетелдік инвестициялық қорлардың пайлары	0	0	0	0
Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары	54 311	2,37	57 011	2,37
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік бағалы қағаздары	36 220	1,58	32 682	1,36
Тазартылған алтын	53 517	2,34	79 400	3,30
ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде	718 567	31,36	729 170	30,32
акциялар	173 219	7,56	163 255	6,79
облигациялар оның ішінде:	545 347	23,80	565 915	23,53
шетелдік валютада номинирленген	18 395	0,80	20 016	0,83
теңгемен номинирленген	526 952	23,00	545 899	22,70
Екінші деңгейдегі банктердегі салымдар	180 550	7,88	172 942	7,19
Туынды бағалы қағаздар	-113	0,00	-557	-0,02
Жиынтығы	2 291 189	100	2 404 760	100

Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктеріндегі салымдар көлемі 2011 жылғы 2-тоқсанда 4,2%-ға азайып, 172,9 млрд. теңге болды.

Эмитенттері бағалы қағаздар шығарылымдары бойынша дефолтқа жол берген бағалы қағаздардың үлесі 2011 жылғы 1 шілдеде зейнетақы активтерінің жалпы көлемінен 0,8%-ды құрады, бұл абсолютті мән бойынша 20,1 млрд. теңге болды.

2011 жылғы 1 шілдедегі жағдай бойынша меншікті активтер есебінен сатып алынған ЖЗҚ-ның жиынтық инвестициялық портфелі

Қаржы құралдары	млн. теңге	жиынтыққа, %-бен
ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары, оның ішінде:	43 648	60,34
ҚР еурооблигациялары	0	0
Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	37 178	51,40
Ұлттық Банктің ноттары	6 471	8,94
жергілікті атқарушы органдардың бағалы қағаздары	0	0
Екінші деңгейдегі банктердегі салымдар	13 582	18,78
Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары	158	0,22
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік бағалы қағаздары	560	0,77
Шетелдік инвестициялық қорлардың пайлары	0	0
ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	12 837	17,75
акциялар	1 642	2,27

облигациялар	11 194	15,48
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	928	1,28
акциялар	633	0,87
облигациялар	295	0,41
"Кері РЕПО" операциялары	620	0,86
Жиынтығы:	72 333	100

2011 жылғы 1 шілдеде жинақтаушы зейнетақы қорларының жиынтық меншікті портфеліндегі ең көп көлемді ҚР мемлекеттік емес бағалы қағаздары алады – 43 648 млн. теңге (60,34%). Бұл ретте меншікті активтер портфелінің 18,8%-ы екінші деңгейдегі банктердің салымдарына орналастырылған. ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздарының үлесі 17,8% құрады.

Инвестициялық қорлардың саны

	1.07.2010	1.10.2010	1.01.2011	1.04.2011	1.07.2011
Инвестициялық пай қорларының саны, оның ішінде	171	168	162	156	155
ашық	15	15	13	12	12
жабық	131	129	123	118	118
аралық	25	24	26	26	25
Акционерлік инвестициялық қорлардың саны	35	34	33	32	32

Инвестициялық пай қорлары пайшыларының саны

	1.07.2010	1.10.2010	1.01.2011	1.04.2011	1.07.2011
Инвестициялық пай қорлары пайшыларының саны, оның ішінде	2 406	1 960	1 984	2 028	2 069
Заңды тұлғалар	86	82	74	67	64
Жеке тұлғалар	2 320	1 878	1 910	1 961	2 005

2011 жылғы 1 шілдедегі инвестициялық қорлар активтері

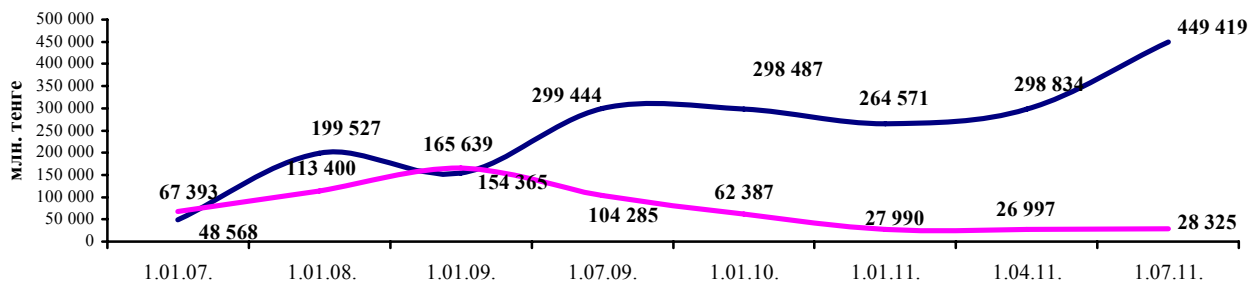
2011 жылғы 1 шілдедегі жағдай бойынша инвестициялық пай қорының және акционерлік инвестициялық қорлардың жиынтық активтері тиісінше 449 368 млн. теңге және 28 325 млн. теңге болды. 2011 жылғы 2-тоқсанда инвестициялық пай қорларының активтері 50,4%-ға ұлғайды, акционерлік инвестициялық қорлардың активтері 1,0%-ға өсті.

(млн. теңге)

	2010 жылғы 1 шілдеде	2010 жылғы 1 қазанда	2011 жылғы 1 қаңтарда	2011 жылғы 1 сәуірде	2011 жылғы 1 шілдеде
Инвестициялық пай қорлары	254 920	231 562	264 571	298 834	449 419
жабық	252 316	228 934	261 980	296 161	446 847
ашық	816	823	806	793	706
аралық	1 788	1 805	1 785	1 880	1 866

Акционерлік инвестициялық қорлар	27 896	28 543	27 990	26 997	28 325
----------------------------------	--------	--------	--------	--------	--------

Инвестициялық қорлар активтерінің өзгеру динамикасы Динамика изменения активов инвестиционных фондов



2011 жылғы 1 шілдедегі инвестициялық қорлардың жиынтық инвестициялық портфелі

(млн. тенге)

Қаржы құралдары	Инвестициялық пай қорлары		Акционерлік инвестициялық қорлар	
	млн. тенге	% к итогу	млн. тенге	% к итогу
ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары, оның ішінде:	324	0,07	104	0,37
ҚР еурооблигациялары	0	0	0	0
Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	314	0,07	104	0,37
Ұлттық Банктің ноттары	10	0	0	0
жергілікті атқарушы органдардың бағалы қағаздары	0	0	0	0
Екінші деңгейдегі банктердегі салымдар	13 833	3,08	140	0,49
Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары	0	0	0	0
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік бағалы қағаздары	0	0	0	0
Тазартылған алтын	0	0	0	0
ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	9 567	2,13	3 664	12,94
акциялар	6 948	1,55	331	1,17
облигациялар	2 619	0,58	3 333	11,77
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	1 829	0,41	112	0,4
акциялар	1 782	0,40	112	0,4
облигациялар	47	0,01	0	0
Инвестициялық қорлардың пайлары	133	0,03	152	0,54
Депозитарлық қолхаттар	463	0,10	105	0,37
"Кері РЕПО" операциясы	294	0,06	98	0,35
Жер учаскелері	5 163	1,15	1 664	5,88
Үйлер мен ғимараттар	297	0,07	11 841	41,81
Жылжымайтын мүліктің салынып жатқан және қайта құрастырылып жатқан объектілері	2 208	0,49	6 111	21,57

	12			
Жобалық-сметалық құжаттама	0	0	4	0,01
Жерді пайдалану және жер қойнауын пайдалану құқықтары	0	0	0	0
Акционерлік қоғам болып табылмайтын заңды тұлғалардың капиталындағы инвестициялық қордың инвестициялары	386 261	85,95	751	2,65
Туынды қаржы құралдары	8	0	0	0
Өзге активтер/ дебиторлық берешек	29 039	6,46	3 579	12,64
Жиынтығы:	449 419	100	28 325	100
Итого:				

Инвестициялық пай және акционерлік қорлардың жиынтық инвестициялық портфеліндегі негізгі үлесті өзге мүлік (инвестициялық қордың акционерлік қоғам болып табылмайтын заңды тұлғалардың капиталына инвестициялары, жер учаскелері, үйлер мен ғимараттар, жылжымайтын мүліктің салынып жатқан және қайта құрастырылып жатқан объектілері, жобалық-сметалық құжаттама, жерді пайдалану және жер қойнауын пайдалану құқықтары) иеленеді, тиісінше 87,7% (393,9 млрд.теңге) және 71,9% (20,4 млрд.теңге).

ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары инвестициялық пай қорларының инвестициялық портфелінде 2,1%, акционерлік инвестициялық қорлар портфелінде – 12,9%-ды иеленіп отыр. Шетел эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздарының ИПҚ-ның жиынтық портфеліндегі үлесі қомақты емес – 0,41% болса, АИҚ-ның портфелінде - 0,4% болды.

2011 жылғы 1 шілдедегі екінші деңгейдегі банктердің инвестициялық портфелінің құрылымы

Қаржы құралдары	млн. теңге	жиынтығында %-бен
ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары, оның ішінде:	1 367 579	75,7
ҚР Ұлттық Банктің ноттары	844 003	46,7
ҚР Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	518 264	28,7
жергілікті атқарушы органдардың бағалы қағаздары	5 312	0,3
Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары	49 341	2,7
Шет мемлекеттердің бағалы қағаздары	8 857	0,5
ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	317 201	17,6
акциялар	42 795	2,4
облигациялар	274 406	15,2
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	63 034	3,5
акциялар	2 269	0,1
облигациялар	60 765	3,4
Жиынтығы:	1 806 012	100

ЕДБ портфелінің қомақты үлесін ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары құрайды – 75,7% немесе 1 367 579 млн. теңге. ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздарының үлесіне 17,6%-ы келеді. Шетел эмитенттерінің

мемлекеттік емес бағалы қағаздары жиынтық портфельдің 3,5%-ын, шет мемлекеттердің бағалы қағаздары – 0,5%-ын құрайды.

2011 жылғы 1 шілдедегі сақтандыру ұйымдарының инвестициялық портфелінің құрылымы

Қаржы құралдары	млн. теңге	жиынтығында %-бен
ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары, оның ішінде:	49 022,5	18,97
- ҚР еурооблигациялары	0	0,00
- Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	38 218,5	14,79
- Ұлттық Банктің ноттары	8 422,4	3,26
- жергілікті атқарушы органдарының бағалы қағаздары	2 381,6	0,93
Екінші деңгейдегі банктердегі салымдар	79 787,0	30,87
Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары	9 023,8	3,49
Инвестициялық қорлардың пайлары	101,7	0,04
Туынды қаржы құралдары	1,5	0,00
Шет мемлекеттердің бағалы қағаздары	6 951,0	2,69
ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	95 478,1	36,94
- акциялар	6 201,3	2,40
- облигациялар	89 276,8	34,54
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	12 152,5	4,70
- акциялар	3 096,9	1,20
- облигациялар	9 055,6	3,50
"Кері РЕПО" операциялары	5 949,8	2,30
Жиынтығы:	258 468,0	100,00

Есепті күнге сақтандыру ұйымдарының жиынтық инвестициялық портфелінің көлемі 258 468 млн. теңге болды. Бұл ретте екінші деңгейдегі банктердегі салымдарға - 30,87%, ҚР эмитенттерінің корпоративті бағалы қағаздарына – 36,94%, Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздарының үлесіне 18,97%-дан келеді.

2011 жылғы 1 шілдедегі бағалы қағаздар нарығы кәсіби қатысушыларының инвестициялық портфелінің құрылымы

Қаржы құралдары	млн. теңге	жиынтығында %-бен
ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары, оның ішінде:	5 587	13,40
ҚР еурооблигациялары	0	0,00
Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	5 392	12,93
Ұлттық Банктің ноттары	157	0,38
жергілікті атқарушы органдарының бағалы қағаздары	38	0,09
Екінші деңгейдегі банктердегі салымдар	2 175	5,21
Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары	104	0,25
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік бағалы қағаздары	168	0,40
ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	25 679	61,57
акциялар	11 037	26,46
облигациялар	14 642	35,11

Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	5 759	13,81
акциялар	1 512	3,62
облигациялар	4 247	10,18
Инвестициялық қорлардың пайлары	1 951	4,68
Туынды қаржы құралдары	21	0,05
"Кері РЕПО" операциялары	262	0,63
Жиынтығы:	41 706	100

2011 жылғы 1 шілдедегі жағдай бойынша бағалы қағаздар нарығына кәсіби қатысушылардың жиынтық инвестициялық портфелі 41 706 млн. теңге болды. Портфель құрылымындағы ең көп үлесті ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары иеленеді – 61,6%. ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары – 13,4% құрады, шетел эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары 13,8%-ды құрайды.