

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

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

	1.10.10 ж	1.01.11 ж	1.04.11 ж	1.07.11 ж	1.10.11 ж
Оның ішінде барлық брокерлер-дилерлер:	78	76	76	76	73
банктер	24	24	24	24	24
олардың I -санаттағысы	22	22	22	22	22
банктік емес ұйымдар	49	47	47	47	44
олардың I -санаттағысы	41	39	39	39	36
АӨҚО қатысушылары	5	5	5	5	5
Тіркеушілер	10	10	10	10	10
Кастодиандар	10	10	10	10	10
ЖЗҚ зейнетақы активтерін инвестициялық басқарушылар	15	15	16	16	14
Инвестициялық портфельді басқарушылар, оның ішінде:	43	39	38	38	34
инвестициялық компаниялар	2	2	2	2	0
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 үшінші тоқсанда бағалы қағаздар нарығындағы қызметті жүзеге асыру үшін берілген 5 лицензияның қолданылуы тоқтатылды, оның ішінде номиналды ұстаушы ретінде клиенттер шоттарын жүргізу құқығымен брокерлік және дилерлік қызметті жүзеге асыруға берілген 1 лицензияның («НOMEBROKER» АҚ) және инвестициялық портфельді басқаруға 2 лицензияның («REAL-INVEST.kz» қаржы компаниясы» АҚ, «НOMEBROKER» АҚ), сондай-ақ зейнетақы активтерін инвестициялық басқаруға 2 лицензияның ("Нұр-Траст" ЗАИБЖАҰ АҚ, "Нұрбанк" АҚ ЕҰ, «БТА Қазақстан ЖЗҚ» АҚ «БТА Банк» АҚ ЕҰ) қолданылуы тоқтатылды.

Сондай-ақ есепті кезеңде брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті қоса атқаратын 2 ұйым («Алматы Қаржы Орталығы», «Альфа Траст» басқарушы компаниясы инвестициялық портфельді басқару бойынша қызметті жүзеге асыру үшін берілген лицензиядан айрылды.

(млн. теңге)

	1.07.11ж.	1.10.11ж.	2011 жылғы III тоқсандағы өзгеруі, %-бен
Жиынтық активтер*, оның ішінде:	162 310	133 976	-17,5
брокерлер-дилерлер (АӨҚО қатысушылары)	7 202	7 220	0,2
тіркеушілер	1 300	1 241	-4,5
ИПБ	110 163	114 895	4,3
инвестициялық компаниялар	36 230	5 554	-84,7
ЗАИБЖАҰ	7 415	5 066	-31,7
Міндеттемелер, оның ішінде:	28 016	27 289	-2,6
брокерлер-дилерлер (АӨҚО қатысушылары)	636	738	16
тіркеушілер	122	48	-60,7
ИПБ	18 028	23 627	31,1
инвестициялық компаниялар	9 150	2 671	-70,8
ЗАИБЖАҰ	80	205	в 2,6 раз
Капитал, оның ішінде:	134 294	106 687	-20,6

* ЕДБ қоспағанда қаржылық көрсеткіштер бойынша ақпарат

брокерлер-дилерлер (АӨҚО қатысушылары)	6 566	6 482	-1,3
тіркеушілер	1 178	1 193	1,3
ИПБ	92 135	91 268	-0,9
инвестициялық компаниялар	27 080	2 883	-89,4
ЗАИБЖАҰ	7 335	4 861	-33,7
Жарғылық капитал, оның ішінде:	115 774	97 064	-16,2
брокерлер-дилерлер (АӨҚО қатысушылары)	5 323	5 565	4,5
тіркеушілер	1 161	1 161	-
ИПБ	78 877	78 620	-0,3
инвестициялық компаниялар	21 293	3 098	-85,5
ЗАИБЖАҰ	9 120	8 620	-5,5

Эмитенттер және қаржы құралдары

Акциялар шығарылымы

Акциялар шығарылымы және шығарылымдарды жою туралы деректер

	2010 жылғы 3-тоқсанда	2010 жылғы 4-тоқсанда	2011 жылғы 1-тоқсанда	2011 жылғы 2-тоқсанда	2011 жылғы 3-тоқсанда
Шығарылымдар тіркелді	12	16	9	6	8
Шығарылым және орналастыру қорытындысы туралы есептер	182	172	178	174	169
Шығарылымдар жойылды	17	15	9	14	11

Есепті күнде қолданыстағы акциялар шығарылымының жалпы саны 2 157 құрады. 2011 жылғы үшінші тоқсанда 180 акциялар шығарылымы (оның ішінде шығарылымдар проспектілеріне енгізілген өзгерістер) тіркелді, акциялардың шығарылымы және орналастыру қорытындысы туралы 169 есеп бекітілді, сондай-ақ 11 акциялар шығарылымы жойылды.

Тіркелген мемлекеттік емес облигациялар шығарылымы туралы деректер

	2010 жылғы 3-тоқсанда	2010 жылғы 4-тоқсанда	2011 жылғы 1-тоқсанда	2011 жылғы 2-тоқсанда	2011 жылғы 3-тоқсанда
Шығарылымдар саны	9	6	3	10	7
Шығарылымдар көлемі, млн. теңгемен	402 515	352 500	14 000	80 000	84 560

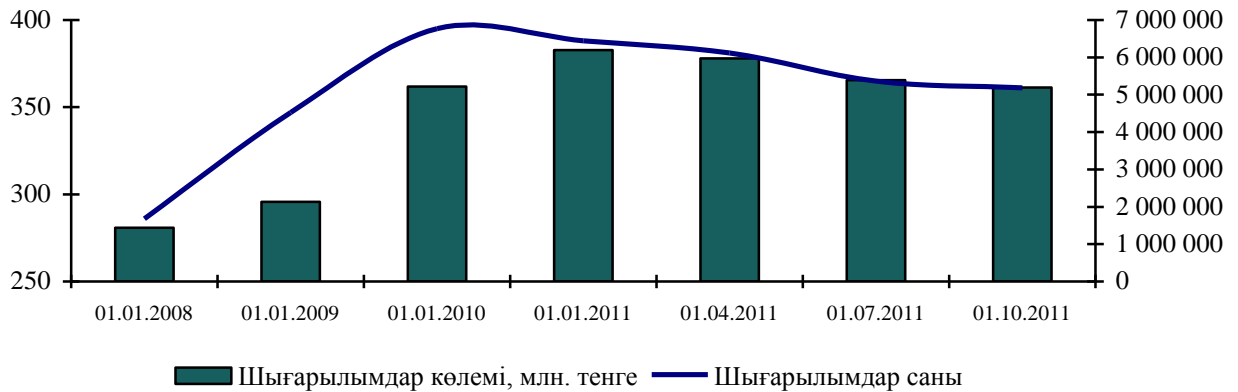
Комитет 2011 жылғы үшінші тоқсан ішінде жалпы көлемі 84 560 млн. теңгемен мемлекеттік емес облигациялардың 7 шығарылымын тіркеді.

Мемлекеттік емес облигациялардың қолданыстағы шығарылымы туралы деректер

	2010 жылғы 3-тоқсанда	2010 жылғы 4-тоқсанда	2011 жылғы 1-тоқсанда	2011 жылғы 2-тоқсанда	2011 жылғы 3-тоқсанда
Шығарылымдар саны	387	388	381	365	361
Шығарылымдар көлемі, млн. теңгемен	5 860 836	6 196 336	5 973 516	5 393 016	5 195 826

2011 жылғы 1 қазандағы жағдай бойынша жиынтық номиналды құны 5 195 826 млн. теңгені құрайтын қолданыстағы облигациялар шығарылымының саны 3651 болды, олардың ішінде рейтингтік бағасы бар 133 шығарылымы, 77 шығарылымы – бірінші шағын санаттың рейтингтік бағасы жоқ, 29 шығарылымы – екінші шағын санаттың рейтингтік бағасы жоқ және 5 шығарылымы – буферлік санатты KASE ресми тізіміне енгізілген.

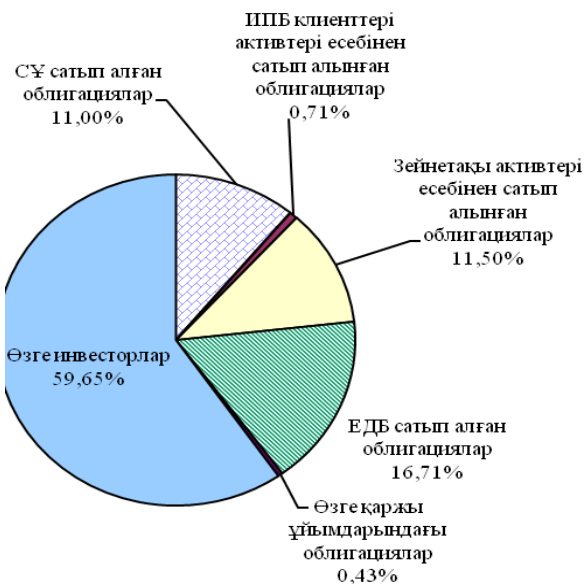
Қолданыстағы облигациялар шығарылымдарының саны мен көлемінің өзгеру динамикасы



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

- зейнетақы активтері есебінен сатып алынған облигациялар – 11,50%;
- екінші деңгейдегі банктер сатып алған облигациялар – 16,71%;
- инвестициялық портфельді басқарушы клиенттердің активтері есебінен сатып алынған облигациялар – 0,71%;
- сақтандыру (қайта сақтандыру) ұйымдары сатып алған облигациялар – 11,00%;
- өзге қаржы ұйымдары сатып алған облигациялар – 0,43%;
- өзге инвесторлар – 59,65%.

1.10.2011 ҚР корпоративті облигацияларының қолданыстағы шығарылымдарының жиынтық көлеміндегі инвесторлармен сатып алынған облигациялар үлесі



ҚР корпоративтік облигацияларының қолданыстағы шығарылымдарының жиынтық көлеміндегі 59,65%-ы кәсіби емес инвесторлардың үлесіне тиеді. Институционалды инвесторлар–облигацияларды ұстаушылардың (ИПБ клиенттерінің активтері және ЗА) Қазақстан Республикасының аумағында шығарылған облигациялардың жалпы көлеміндегі үлес салмағы 12,21% болды.

Тіркелген пайлар шығарылымдары туралы деректер

	2010 жылғы 3-тоқсанда	2010 жылғы 4-тоқсанда	2011 жылғы 1-тоқсанда	2011 жылғы 2-тоқсанда	2011 жылғы 3-тоқсанда
Шығарылымдар тіркелді	3	2	1	4	0
Шығарылым және орналастыру қорытындысы туралы есептер бекітілді	25	35	26	23	25
Қолданыстағы шығарылымдар	168	162	156	155	152

2011 жылғы 1 қазанда қолданыстағы пайлар шығарылымының саны 152 болды. Бұл ретте 2011 жылғы шілде-қыркүйек айларында шығарылым мен орналастыру қорытындылары туралы 25 есеп бекітілді және 3 шығарылым өтелді.

Қазақстан Республикасының аумағында айналыста болатын мемлекеттік бағалы қағаздар*

	(млн. теңге)				
	2010 жылғы 1 қазанда	2011 жылғы 1 қаңтарда	2011 жылғы 1 сәуірде	2011 жылғы 1 шілдеде	2011 жылғы 1 қазанда
Айналыста барлығы, оның ішінде	2 649 062	2 569 002	3 201 936	3 146 646	2 659 131
Ұлттық Банктің ноттары	1 014 378	899 542	1 449 137	1 330 612	742 568
Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	1 634 684	1 669 460	1 752 799	1 816 035	1 916 563
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 қазанда 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:	89	64
"Борыштық бағалы қағаздар" секторы:	244	70
"Инвестициялық қорлардың бағалы қағаздары" секторы:	2	2
"Депозитарлық қолхаттар" секторы:	0	0
"Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары" секторы:	1	1
"Мемлекеттік бағалы қағаздар" секторы:	179	3
"Туынды бағалы қағаздар" секторы:	0	0
"Баламалы алаң"	0	0
Жиынтығы:	515	109

KASE айналымына жіберілген бағалы қағаздардың негізгі үлес салмағы борыштық бағалы қағаздарға – 47,4% (244 шығарылым) келеді. Акциялар және мемлекеттік бағалы қағаздары секторы бойынша тиісінше 17,3% (89 шығарылым) және 34,7% (179

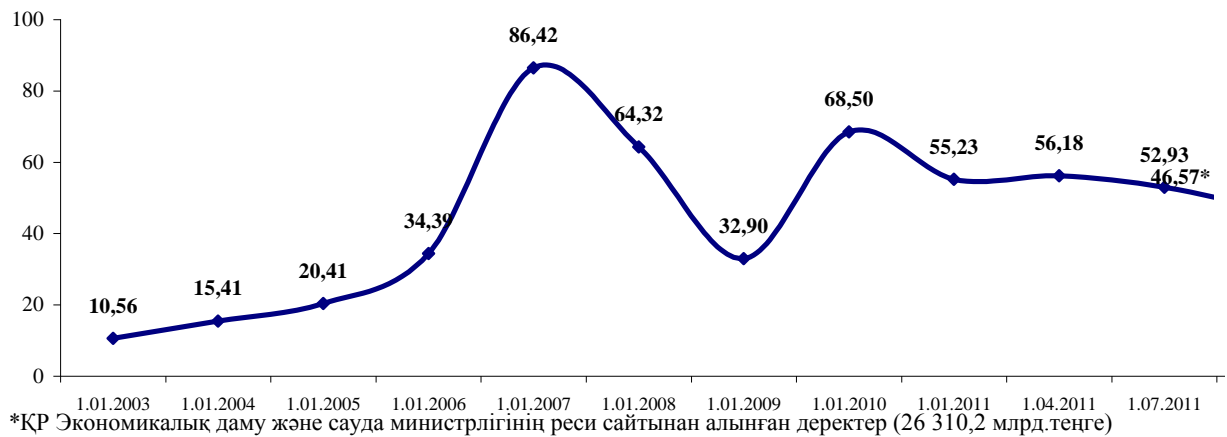
* Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің деректері бойынша ұсынылған ақпарат

** Биржа нарығы жөніндегі ақпарат KASE деректері бойынша ұсынылған

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 12 253 968 млн. теңгені немесе ЖІӨ-ден 46,6% құрады. 2011 жылғы 1 шілдедегі жағдай бойынша осындай көрсеткіш 13 926 882 млн. теңгені немесе ЖІӨ-ден 52,9% құрады. Осылайша, қор нарығын капиталдандырудың абсолюттік көріністегі азаюы да, сондай ЖІӨ-ге қатысты қор нарығын капиталдандыру көрсеткішінің азаюы да байқалады.

ЖІӨ-ге KASE-тің капиталдандырылуы *



KASE-тегі мемлекеттік емес бағалы қағаздармен жасалған мәмілелер көлемі

	(млн. тенге)			
	2010 жылғы 4-тоқсанда	2011 жылғы 1-тоқсанда	2011 жылғы 2-тоқсанда	2011 жылғы 3-тоқсанда
бастапқы орналастыру:	0	0	19 485	735
– "Акциялар" секторы бойынша	0	0	0	0
– "Борыштық бағалы қағаздар" секторы бойынша	0	0	19 485	735
– "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:	300 700	164 502	107 222	77 555
– "Акциялар" секторы бойынша	220 940	91 046	26 999	18 432
– "Борыштық бағалы қағаздар" секторы бойынша	79 760	73 456	80 223	59 070
– "Инвестициялық қорлардың бағалы қағаздары" секторы бойынша	0	0	0	53
– "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	419	206	171	115
"репо" мәмілелері:	51 741	33 042	24 406	29 570
– "Акциялар" секторы бойынша	34 704	22 600	21 096	26 294
– "Борыштық бағалы қағаздар" секторы	17 037	10 442	3 310	3 276

бойынша				
– "Инвестициялық қорлардың бағалы қағаздары" секторы бойынша	0	0	0	0
– "Депозитарлық колхаттар" 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	352 860	197 750	151 284	107 975

Кестеде келтірілген деректерден көрініп отырғандай, 2011 жылдың үшінші тоқсанында мемлекеттік емес бағалы қағаздармен жасалған мәмілелер көлемі 28,6%-ға азайды.

KASE-тегі мемлекеттік бағалы қағаздармен жасалған мәмілелер көлемі

(млн. теңге)

	2010 жылғы 3-тоқсанда	2010 жылғы 4-тоқсанда	2011 жылғы 1-тоқсанда	2011 жылғы 2-тоқсанда	2011 жылғы 3-тоқсанда
Мәмілелер көлемі, оның ішінде:	6 419 236	6 748 680	4 939 502	6 806 329	7 904 954
бастапқы орналастырулар	224 639	113 994	151 011	135 903	170 912
"репо" мәмілелері	6 034 153	6 458 687	4 666 525	6 543 358	7 591 643

Ағымдағы жылдың 3-тоқсанында ұйымдасқан нарықтағы мемлекеттік бағалы қағаздар бойынша жасалған биржалық мәмілелер көлемі 16,1%-ға өсті. Бастапқы орналастырулар көлемі 25,8%-ға азайды. Мемлекеттік бағалы қағаздармен жасалған мәмілелердің жалпы көлеміндегі "репо" мәмілесінің үлесі 16,0%-ға ұлғайды.

KASE капиталдандырылуының өзгеру динамикасы

(млн. теңге)

Ресми тізім секторы	2010 жылғы 1 қазанда	2011 жылғы 1 қаңтарда	2011 жылғы 1 сәуірде	2011 жылғы 1 шілдеде	2011 жылғы 1 қазанда
"Акциялар" секторы:	8 010 139	8 959 446	8 986 259	8 115 762	6 214 033
"Борыштық бағалы қағаздар" секторы	2 946 154	3 087 177	5 793 198	5 809 341	6 038 463
"Инвестициялық қорлардың бағалы қағаздары" секторы	1 779	1 779	1 779	1 779	1 472
"Депозитарлық колхаттар" секторы	0	0	0	0	
"Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары" секторы	0	0	0	0	
"Мемлекеттік бағалы қағаздар" секторы	2 671 140	2 588 486	3 223 494	3 167 208	2 668 388
"Туынды бағалы қағаздар" секторы	0	0	0	0	0
Жиынтығы	13 629 212	14 636 888	18 004 730	17 094 090	14 922 356

Кестеде келтірілген деректерден көрініп отырғандай, KASE ресми тізіміне кіргізілген мемлекеттік бағалы қағаздар бойынша нарықты жалпы капиталдандыру 2011 жылғы 1 қазандағы жағдай бойынша 2011 жылғы 1 шілдедегі көрсеткішпен салыстарғанда 12,7%-ға азайды.

Бағалы қағаздар нарығындағы инвесторлар Инвестициялық басқарудағы зейнетақы активтері

2011 жылғы 1 қазандағы жағдай бойынша ЗАИБЖАҰ-ның инвестициялық басқаруындағы зейнетақы активтерінің жиынтық көлемі 2011 жылдың 3-тоқсанында 2 525,4 млрд. теңгеге немесе 2,9%-ға өсіп, 71,3 млрд. теңге болды.

Зейнетақы активтерінің орташа айлық өсімі 2010 жылғы 1 қазаннан бастап 2011 жылғы 1 қазанға дейінгі кезеңде 33,0 млрд. теңге болды.

Зейнетақы активтерінің жиынтық көлемін бөлу

ЗАИБЖАҰ/ ЗЖҚ	зейнетақы активтері	
	млн. теңге	млн. теңге
«Қазақстан Халық Банкі ЖЗҚ» АҚ, «Қазақстан Халық Банкі» АҚ ЕҰ	839 895	33,26
«ГНПФ» ЖЗҚ» АҚ»	451 617	17,88
"Жетісу" ЗАИБЖАҰ" АҚ	408 405	16,17
«ҰларҮміт» ЖЗҚ» АҚ»	408 405	16,17
"GRANTUM Asset Management" ЗАИБЖАҰ" АҚ («Казкоммерцбанк» АҚ ЕҰ)	222 457	8,81
«ГРАНТУМ» ЖЗҚ» АҚ («Казкоммерцбанк» АҚ ЕҰ)	222 457	8,81
«Капитал» ЖЗҚ» АҚ - «Банк ЦентрКредит» АҚ еншілес ұйымы	135 381	5,36
"Астана" ЖЗҚ" АҚ	124 795	4,94
"МұнайГаз-Дем" ЖЗҚ" АҚ	96 165	3,81
"Нұрбанк" АҚ ЕҰ "Атамекен" ЖЗҚ" АҚ	79 083	3,13
«Отан» АЖЗҚ» АҚ	73 278	2,90
«РЕСПУБЛИКА» ЖЗҚ» АҚ	70 470	2,79
"Қазақмыс" ЖЗҚ" АҚ	23 809	0,94
Барлық ЖЗҚ бойынша жиынтығы	2 525 356	100

2011 жылдың 3-тоқсанында инвестицияланған зейнетақы активтерінің көлемі 43,6 млрд. теңгеге немесе 1,8%-ға өсіп, 2011 жылғы 1 қазанда 2 361,1 млрд. теңге болды.

Жинақтаушы зейнетақы қорларының инвестициялық портфеліндегі ҚР эмитенттерінің мемлекеттік бағалы қағаздарының үлесі инвестицияланған зейнетақы активтерінің жалпы көлемінен 43,6%-ды (1 030,2 млрд. теңге) құрайды және 2011 жылғы 1 шілдедегі жағдай бойынша осындай көрсеткішке қатысты 70,8 млрд. теңгеге азайды. ҚР мемлекеттік емес бағалы қағаздардың үлесі 2011 жылғы 1 қазандағы жағдай бойынша инвестицияланған зейнетақы активтерінің жалпы көлемінен 31,1%-ды (733,7 млрд. теңге) құрады.

ЖЗҚ-ның жиынтық инвестициялық портфелі

Қаржы құралдары	1.07.2011ж.		1.10.2011ж.	
	млн. теңге	%	млн. теңге	%
ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары, оның ішінде	1 101 010	45,79	1 030 221	43,63
Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	916 567	38,12	960 533	40,68
Ұлттық Банктің ноттары	178 805	7,44	64 143	2,72
орталық атқарушы органдардың бағалы қағаздары	5 638	0,23	5 545	0,23
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес бағалы қағаздары	233 102	9,69	162 284	6,87
акциялар	88 293	3,67	28 624	1,21
облигациялар	144 809	6,02	133 660	5,66
Шетелдік инвестициялық қорлардың пайлары	0	0		
Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары	57 011	2,37	91 941	3,9
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік бағалы	32 682	1,36	43 952	1,86

қағаздары				
Тазартылған алтын	79 400	3,30	115 615	4,90
ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде	729 170	30,32	733 683	31,07
акциялар	163 255	6,79	151 538	6,42
облигациялар оның ішінде:	565 915	23,53	582 145	24,65
шетелдік валютада номинирленген	20 016	0,83	21 270	0,90
теңгемен номинирленген	545 899	22,70	560 875	23,75
Екінші деңгейдегі банктердегі салымдар	172 942	7,19	184 461	7,81
Туынды бағалы қағаздар	-557	-0,02	-1 035	-0,04
Жиынтығы	2 404 760	100	2 361 122	100

Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктеріндегі салымдар көлемі 2011 жылғы 3-тоқсанда 6,7%-ға азайып, 184,5 млрд. теңге болды.

Эмитенттері бағалы қағаздар шығарылымдары бойынша дефолтқа жол берген бағалы қағаздардың үлесі 2011 жылғы 1 қазанда зейнетақы активтерінің жалпы көлемінен 0,7%-ды құрады, бұл абсолютті мән бойынша 18,6 млрд. теңге болды.

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

Қаржы құралдары	млн. теңге	жиынтыққа, %-бен
ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары, оның ішінде:	37 234	51,53
ҚР еурооблигациялары	0	0
Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	35 567	49,22
Ұлттық Банктің ноттары	1 667	2,31
жергілікті атқарушы органдардың бағалы қағаздары	0	0
Екінші деңгейдегі банктердегі салымдар	17 996	24,91
Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары	132	0,18
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік бағалы қағаздары	458	0,64
Шетелдік инвестициялық қорлардың пайлары	0	0
ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	14 097	19,51
акциялар	1 327	1,84
облигациялар	12 769	17,67
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	1 058	1,46
акциялар	775	1,07
облигациялар	283	0,39
"Кері РЕПО" операциялары	1 280	1,77
Жиынтығы:	72 254	100

2011 жылғы 1 қазанда жинақтаушы зейнетақы қорларының жиынтық меншікті портфеліндегі ең көп көлемін ҚР мемлекеттік емес бағалы қағаздары алады – 37 234 млн. теңге (51,5%). Бұл ретте меншікті активтер портфелінің 24,9%-ы екінші деңгейдегі банктердің салымдарына орналастырылған. ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздарының үлесі 19,5% құрады.

Инвестициялық қорлардың саны

	1.10.2010	1.01.2011	1.04.2011	1.07.2011	1.10.2011
Инвестициялық пай қорларының саны, оның ішінде	168	162	156	155	152
ашық	15	13	12	12	12
жабық	129	123	118	118	116
аралық	24	26	26	25	24

Акционерлік инвестициялық қорлардың саны	34	33	32	32	32
--	----	----	----	----	----

Инвестициялық пай қорлары пайшыларының саны

	1.10.2010	1.01.2011	1.04.2011	1.07.2011	1.10.2011
Инвестициялық пай қорлары пайшыларының саны, оның ішінде	1 960	1 984	2 028	2 069	1 960
Занды тұлғалар	82	74	67	64	78
Жеке тұлғалар	1 878	1 910	1 961	2 005	1 882

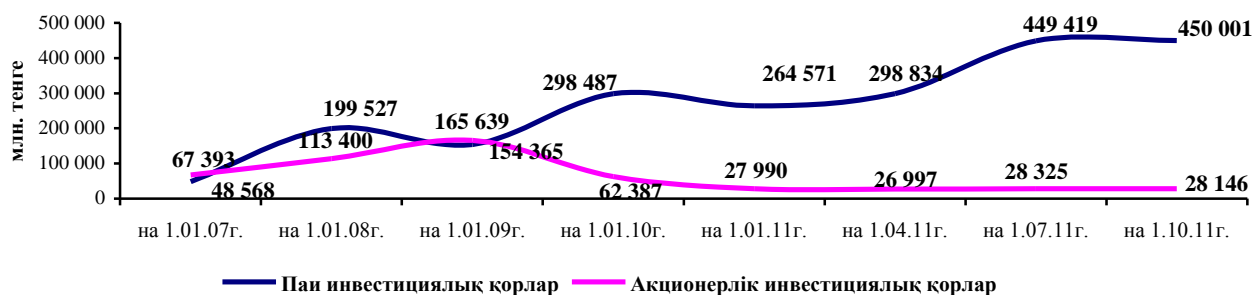
2011 жылғы 1 қазандағы инвестициялық қорлар активтері

2011 жылғы 1 қазандағы жағдай бойынша инвестициялық пай қорының және акционерлік инвестициялық қорлардың жиынтық активтері тиісінше 450 001 млн. теңге және 28 146 млн. теңге болды. 2011 жылғы 3-тоқсанда инвестициялық пай қорларының активтері 0,1%-ға ұлғайды, акционерлік инвестициялық қорлардың активтері 0,6%-ға өсті.

(млн. теңге)

	2010 жылғы 1 қазанда	2011 жылғы 1 қаңтарда	2011 жылғы 1 сәуірде	2011 жылғы 1 шілдеде	2011 жылғы 1 қазанда
Инвестициялық пай қорлары	231 562	264 571	298 834	449 419	450 001
жабық	228 934	261 980	296 161	446 847	447 526
ашық	823	806	793	706	624
аралық	1 805	1 785	1 880	1 866	1 851
Акционерлік инвестициялық қорлар	28 543	27 990	26 997	28 325	28 146

Инвестициялық қорлар активтерінің өзгеру динамикасы



2011 жылғы 1 қазандағы инвестициялық қорлардың жиынтық инвестициялық портфелі

(млн. теңге)

Қаржы құралдары	Инвестициялық пай қорлары		Акционерлік инвестициялық қорлар	
	млн. теңге	жиынтық а, %-бен	млн. теңге	жиынтыққа, %-бен
ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары, оның ішінде:	164	0,04	72	0,26
ҚР еурооблигациялары	0	0	0	0
Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	143	0,03	72	0,26
Ұлттық Банктің ноттары	21	0	0	0
жергілікті атқарушы органдардың бағалы қағаздары	0	0	0	0
Екінші деңгейдегі банктердегі салымдар	28 141	6,25	133	0,47

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:	8 879	1,97	3 668	13,03
акциялар	6 343	1,41	325	1,15
облигациялар	2 536	0,56	3 343	11,88
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	1 741	0,39	149	0,53
акциялар	1 714	0,38	149	0,53
облигациялар	27	0,01	0	0
Инвестициялық қорлардың пайлары	180	0,04	154	0,55
Депозитарлық қолхаттар	411	0,09	314	1,12
"Кері РЕПО" операциясы	417	0,09	6	0,02
Жер учаскелері	5 164	1,15	1 654	5,87
Үйлер мен ғимараттар	295	0,07	11 993	42,61
Жылжымайтын мүліктің салынып жатқан және қайта құрастырылып жатқан объектілері	2 208	0,49	6 111	21,71
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	387 758	86,17	742	2,64
Туынды қаржы құралдары	-2	0	0	0
Өзге активтер/ дебиторлық берешек	14 645	3,25	3 146	11,18
Жиынтығы:	450 001	100	28 146	100

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 87,8% (395,4 млрд.теңге) және 72,8% (20,4 млрд.теңге).

ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары инвестициялық пай қорларының инвестициялық портфелінде 2,0%, акционерлік инвестициялық қорлар портфелінде – 13,0%-ды иеленіп отыр. Шетел эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздарының ИПҚ-ның жиынтық портфеліндегі үлесі қомақты емес – 0,4% болса, АИҚ-ның портфелінде - 0,5% болды.

2011 жылғы 1 қазандағы екінші деңгейдегі банктердің инвестициялық портфелінің құрылымы

Қаржы құралдары	млн. теңге	жиынтығында %-бен
ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары, оның ішінде:	1 112 949	70,5
ҚР Ұлттық Банктің ноттары	575 239	36,4
ҚР Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	532 679	33,8
жергілікті атқарушы органдардың бағалы қағаздары	5 031	0,3
Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары	43 768	2,8
Шет мемлекеттердің бағалы қағаздары	8 312	0,5
ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	317 705	20,1

акциялар	40 841	2,6
облигациялар	276 864	17,5
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	96 408	6,1
акциялар	2 917	0,2
облигациялар	93 491	5,9
Жиынтығы:	1 579 142	100

ЕДБ портфелінің қомақты үлесін ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары құрайды – 70,5% немесе 1 112 949 млн. теңге. ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздарының үлесіне 20,1%-ы келеді. Шетел эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары жиынтық портфельдің 6,1%-ын, шет мемлекеттердің бағалы қағаздары – 0,5%-ын құрайды.

2011 жылғы 1 қазандағы сақтандыру ұйымдарының инвестициялық портфелінің құрылымы

Қаржы құралдары	млн. теңге	жиынтығында %-бен
ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары, оның ішінде:	47 579	17,74
- ҚР еурооблигациялары	0	0,00
- Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	38 869	14,49
- Ұлттық Банктің ноттары	6 174	2,30
- жергілікті атқарушы органдарының бағалы қағаздары	2 536	0,95
Екінші деңгейдегі банктердегі салымдар	86 032	32,08
Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары	8 425	3,14
Инвестициялық қорлардың пайлары	504	0,19
Туынды қаржы құралдары	1	0,00
Шет мемлекеттердің бағалы қағаздары	6 584	2,45
ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	98 088	36,57
- акциялар	3 717	1,38
- облигациялар	94 371	35,19
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	14 515	5,41
- акциялар	4 466	1,67
- облигациялар	10 049	3,74
"Кері РЕПО" операциялары	6 467	2,41
Жиынтығы:	268 196	100,00

Есепті күнге сақтандыру ұйымдарының жиынтық инвестициялық портфелінің көлемі 268 196 млн. теңге болды. Бұл ретте екінші деңгейдегі банктердегі салымдарға - 32,08%, ҚР эмитенттерінің корпоративті бағалы қағаздарына – 36,57%, Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздарының үлесіне 17,74%-дан келеді.

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

Қаржы құралдары	млн. теңге	жиынтығында %-бен
ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары, оның ішінде:	4 924	12,10
ҚР еурооблигациялары	0	0
Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	4 887	12,01
Ұлттық Банктің ноттары	0	0

жергілікті атқарушы органдарының бағалы қағаздары	37	0,09
Екінші деңгейдегі банктердегі салымдар	2 774	6,82
Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары	106	0,26
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік бағалы қағаздары	254	0,62
ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	21 775	53,50
акциялар	9 789	24,05
облигациялар	11 986	29,45
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	6 430	15,80
акциялар	1 300	3,19
облигациялар	5 130	12,60
Инвестициялық қорлардың пайлары	3 520	8,65
Туынды қаржы құралдары	0	0
"Кері РЕПО" операциялары	917	2,25
Жиынтығы:	40 701	100

2011 жылғы 1 қазандағы жағдай бойынша бағалы қағаздар нарығына кәсіби қатысушылардың жиынтық инвестициялық портфелі 41 701 млн. теңге болды. Портфель құрылымындағы ең көп үлесті ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары иеленеді – 53,5%. ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары – 12,1% құрады, шетел эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары 15,8%-ды құрайды.