

**2009 жылғы 1 қазандағы Қазақстан Республикасының
бағалы қағаздар нарығының ағымдағы жағдайы**

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

	1.10.08 ж.	1.01.09 ж.	1.04.09 ж.	1.07.09ж.	1.10.09ж.
Оның ішінде барлық брокерлер–дилерлер:	106	104	99	92	86
банктер	24	24	24	24	24
олардың I -санаттағысы	22	22	22	22	22
банктік емес ұйымдар	62	60	57	56	53
олардың I -санаттағысы	53	51	48	47	44
АӨҚО қатысушылары	20	20	18	12	9
Тіркеушілер	15	15	14	13	12
Кастодиандар	11	11	11	11	11
ЖЗҚ зейнетақы активтерін инвестициялық басқарушылар	13	13	13	14	14
Инвестициялық портфельді басқарушылар, оның ішінде:	68	66	63	60	54
инвестициялық компаниялар	4	4	4	4	3
ӨӨРУ	2	2	2	2	2
Трансфер-агенттер	4	4	3	3	3
Бағалы қағаздармен сауда-саттықты ұйымдастырушы	1	1	1	1	1

2009 жылғы үшінші тоқсанда инвестициялық портфельді басқаруға 1 лицензия ("FATTAN FINANCE" АҚ) берілді. Сондай-ақ есепті кезеңде 8 лицензияның, оның ішінде бағалы қағаздар нарығында номиналды ұстаушы ретінде клиенттер шоттарын жүргізу құқығымен брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыруға 4 лицензияның ("BWK-INVEST" ЖШС, «Resmi Investment House Almaty» ЖШС, «AIM Capital» АҚ, «Астана-Финанс» АҚ), инвестициялық портфельді басқаруға 3 лицензияның («GLOTUR INVEST» АҚ, «AIM Capital» АҚ, «Астана-Финанс» АҚ) және бағалы қағаздарды ұстаушылар тізілімі жүйесін жүргізу жөніндегі қызметті жүзеге асыруға 1 лицензияның («Лотос Секьюритиз» АҚ) қолданылуы тоқтатылды. Сонымен қатар, есепті кезеңде 4 ұйым ("West investment company"/Уэст инвестмен компани/ АҚ, "Capital Almakhan Invest" ("Капитал Алмахан Инвест") АҚ, «Алан Секьюритис» АҚ, «Asia Broker Services» АҚ) инвестициялық портфельді басқару жөніндегі қызметті жүзеге асыруға берілген лицензиясынан және 2 ұйым («Алан Секьюритис» АҚ, «Asia Broker Services» АҚ) бағалы қағаздар нарығында номиналды ұстаушы ретінде клиенттер шоттарын жүргізу құқығымен брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыруға берілген лицензиясынан айырылды.

	1.07.09ж.	1.10.09ж. *	2009 жылғы 3-тоқсандағы өзгеруі, %-бен
Жиынтық активтер, оның ішінде: *	403 343	158 682	-60,66
брокерлер-дилерлер	10 193	8 833	-13,34
брокерлер-дилерлер (АӨҚО қатысушылары)	1 211	888	-26,67
тіркеушілер	1 055	1 022	-3,13
ИПБ	101 664	103 719	2,02
инвестициялық компаниялар	282 763	36 326	-87,15
ЗАИБЖАҰ	6 457	7 894	22,25
Міндеттемелер, оның ішінде:	314 962	45 103	-85,68
брокерлер-дилерлер	5 810	4 868	-16,21

* ЕДБ қоспағанда қаржылық көрсеткіштер бойынша ақпарат

брокерлер-дилерлер (АӨҚО қатысушылары)	41	37	-9,76
тіркеушілер	38	36	-5,26
ИПБ	27 403	27 525	0,45
инвестициялық компаниялар	281 523	9 207	азауы 30,5 есе
ЗАИБЖАҰ	147	3 430	23,3 есе
Капитал, оның ішінде:	88 381	113 579	28,51
брокерлер-дилерлер	4 383	3 965	-9,54
брокерлер-дилерлер (АӨҚО қатысушылары)	1 170	851	-27,26
тіркеушілер	1 017	986	-3,05
ИПБ	74 261	76 194	2,6
инвестициялық компаниялар	1 240	27 119	21,9 есе
ЗАИБЖАҰ	6 310	4 464	-29,26
Жарғылық капитал, оның ішінде:	138 094	106 057	-23,20
брокерлер-дилерлер	1 912	1 975	3,29
брокерлер-дилерлер (АӨҚО қатысушылары)	995	851	-14,47
Тіркеушілер	995	986	-0,90
ИПБ	73 611	72 255	-1,84
инвестициялық компаниялар	51 506	20 915	-59,39
ЗАИБЖАҰ	9 075	9 075	-

Эмитенттер және қаржы құралдары Акциялар шығарылымы

Акциялар шығарылымы және шығарылымдарды жою туралы деректер

	2008 жылғы 3-тоқсанда	2008 жылғы 4-тоқсанда	2009 жылғы 1-тоқсанда	2009 жылғы 2-тоқсанда	2009 жылғы 3-тоқсанда
Шығарылымдар тіркелді	28	31	18	19	14
Шығарылым және орналастыру қорытындысы туралы есептер бекітілді	128	191	147	160	180
Шығарылымдар жойылды	10	656	160	22	46

Есепті күнде қолданыстағы акциялар шығарылымының жалпы саны 2 206 құрады. 2009 жылдың үшінші тоқсанында 14 акциялар шығарылымы тіркелді, акциялардың шығарылымы және орналастыру қорытындысы туралы 180 есеп бекітілді, сондай-ақ 46 акциялар шығарылымы жойылды.

Тіркелген мемлекеттік емес облигациялар шығарылымы туралы деректер

	2008 жылғы 3- тоқсанда	2008 жылғы 4- тоқсанда	2009 жылғы 1- тоқсанда	2009 жылғы 2- тоқсанда	2009 жылғы 3- тоқсанда
Шығарылымдар саны	25	21	55	10	11
Шығарылымдар көлемі, млн. теңгемен	149 540	253 940	2 148 575	37 100	874 583

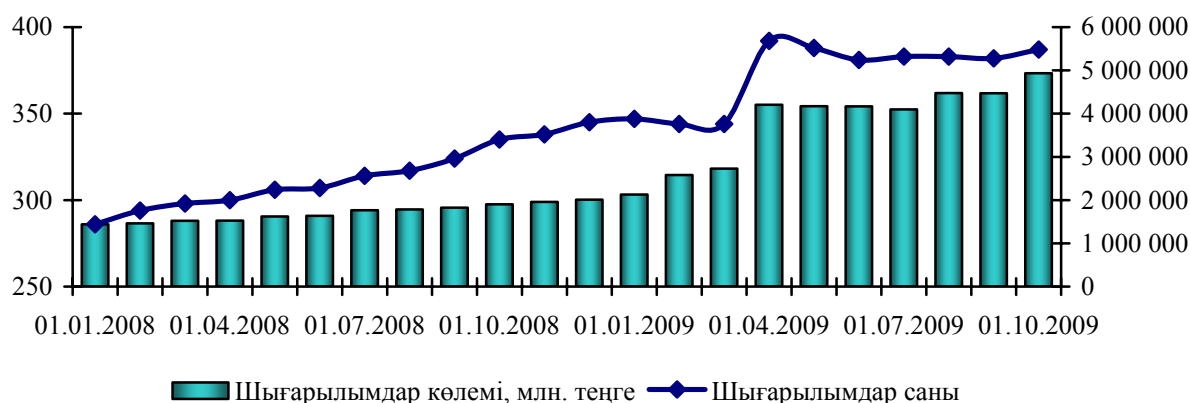
2009 жылғы үшінші тоқсан ішінде Агенттікпен жалпы көлемі 874 583 млн. теңгемен мемлекеттік емес облигациялардың 11 шығарылымы тіркелген.

Мемлекеттік емес облигациялардың қолданыстағы шығарылымы туралы деректер

	2008 жылғы 1 қазанда	2009 жылғы 1 қаңтарда	2009 жылғы 1 сәуірде	2009 жылғы 1 шілдеде	2009 жылғы 1 қазанда
Шығарылымдар саны	335	347	392	383	387
Шығарылымдар көлемі, млн. теңгемен	1 901 656	2 129 234	4 204 170	4 097 185	4 935 108

2009 жылғы 1 қазандағы жағдай бойынша жиынтық номиналды құны 4 935 108 млн. теңгені құрайтын қолданыстағы облигациялар шығарылымының саны 387 болды, олардың ішінде рейтингтік бағасы бар 35 шығарылымы, 225 шығарылымы – бірінші шағын санаттың рейтингтік бағасы жоқ және 43 шығарылымы – екінші шағын санаттың рейтингтік бағасы жоқ KASE ресми тізіміне енгізілген.

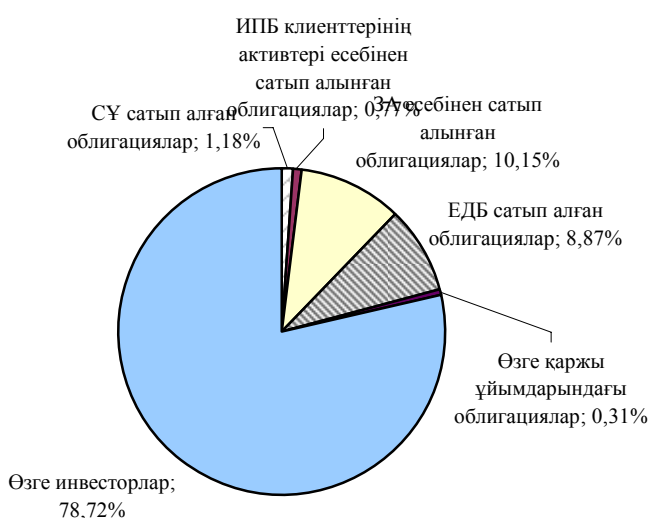
Қолданыстағы облигациялар шығарылымдарының саны мен көлемінің өзгеру динамикасы



2009 жылғы 1 қазандағы жағдай бойынша корпоративті облигациялардың қолданыстағы шығарылымдарының жиынтық көлемі былайша көрініс алады:

- зейнетақы активтері есебінен сатып алынған облигациялар – 10,15%;
- екінші деңгейдегі банктер сатып алған облигациялар – 8,87%;
- инвестициялық портфельді басқарушы клиенттердің активтері есебінен сатып алынған облигациялар – 0,77%;
- сақтандыру (қайта сақтандыру) ұйымдары сатып алған облигациялар – 1,18%;
- өзге қаржы ұйымдары сатып алған облигациялар – 0,31%;
- өзге инвесторлар – 78,72%.

1.10.2009 ж. ҚР корпоративті облигацияларының қолданыстағы шығарылымдарының жиынтық көлеміндегі инвесторлармен сатып алынған облигациялар үлесі



ҚР корпоративтік облигацияларының қолданыстағы шығарылымдарының жиынтық көлеміндегі 78,72%-ы кәсіби емес инвесторлардың үлесіне тиеді.

Институционалды инвесторлар–облигацияларды ұстаушылардың (ИПБ клиенттерінің активтері және ЗА) Қазақстан Республикасының аумағында шығарылған облигациялардың жалпы көлеміндегі үлес салмағы 10,92% болды.

Тіркелген пайлар шығарылымдары туралы деректер

	2008 жылғы 3-тоқсанда	2008 жылғы 4-тоқсанда	2009 жылғы 1-тоқсанда	2009 жылғы 2-тоқсанда	2009 жылғы 3-тоқсанда
Шығарылымдар тіркелді	19	11	6	7	3
Шығарылым және орналастыру қорытындысы туралы есептер бекітілді	61	46	75	35	42
Қолданыстағы шығарылымдар	219	205	186	186	176

2009 жылғы 1 қазанда қолданыстағы пайлар шығарылымының саны 176 болды. Бұл ретте шілде-қаңтар айларында 3 пай шығарылымы тіркелді, шығарылым мен орналастыру қорытындылары туралы 42 есеп бекітілді және 13 шығарылым өтелді.

Қазақстан Республикасының аумағында айналыста болатын мемлекеттік бағалы қағаздар, *

	(млн. теңге)				
	2008 жылғы 1 қазанда	2009 жылғы 1 қаңтарда	2009 жылғы 1 сәуірде	2009 жылғы 1 шілдеде	2009 жылғы 1 қазанда
Айналыста барлығы, оның ішінде	1 202 734	1 128 338	1 044 627	1 104 276	1 299 549
Ұлттық Банктің ноттары	471 815	312 272	191 389	145 013	180 213
Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	730 919	816 066	853 238	959 263	1 119 336
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:	95	72
"Борыштық бағалы қағаздар" секторы:	303	90
"Инвестициялық қорлардың бағалы қағаздары" секторы:	1	1
"Депозитарлық қолхаттар" секторы:	0	0
"Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары" секторы:	1	1
"Мемлекеттік бағалы қағаздар" секторы:	116	2
"Туынды бағалы қағаздар" секторы:	0	0
"Баламалы алаң"	0	0
Жиынтығы:	516	125

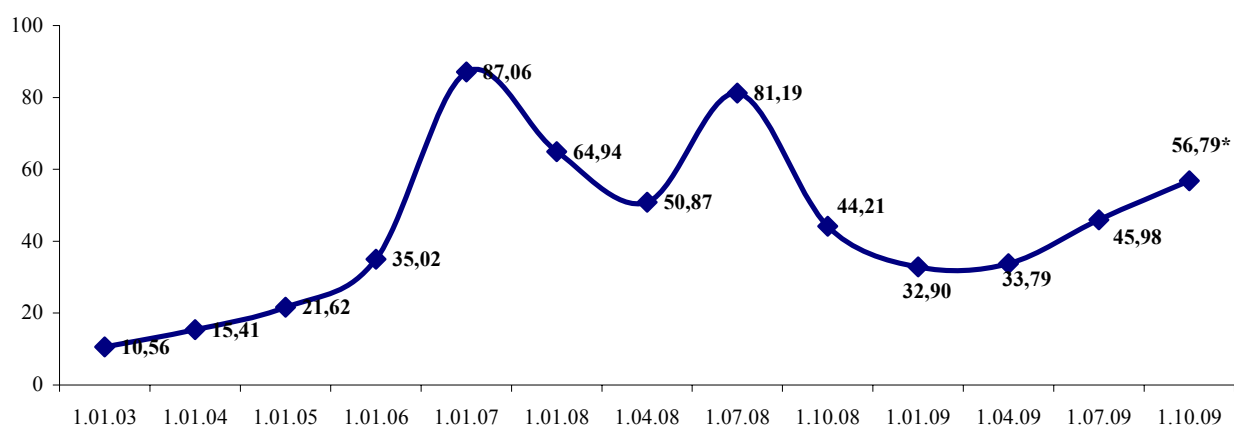
* Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің деректері бойынша ұсынылған ақпарат

** Биржа нарығы жөніндегі ақпарат KASE деректері бойынша ұсынылған

KASE айналымын жіберілген бағалы қағаздардың негізгі үлес салмағы борыштық бағалы қағаздарға - 58,72% (303 шығарылым) келеді. Акциялар және мемлекеттік бағалы қағаздары секторы бойынша 18,41% (95 шығарылым) және тиісінше 22,48% (116 шығарылым) болып келеді. Инвестициялық қорлардың бағалы қағаздарының үлесі 0,2%-ды (1 шығарылым) құрайды.

KASE жалпы капиталдандыру ЖІӨ-ден 9 578 500 млн. теңгені немесе 56,79% құрады. 2009 жылғы 1 шілдедегі жағдай бойынша осындай көрсеткіш 7 755 722 млн. теңгені немесе ЖІӨ-ден 45,98% құрады. Осылайша, қор нарығын капиталдандырудың абсолюттік көріністегі көбеюі де, сондай ЖІӨ-ге қатысты қор нарығын капиталдандыру көрсеткішінің көбеюі де байқалады.

ЖІӨ-ге KASE-нің капиталдандырылуы *



* Экономика және бюджеттік жоспарлау министрлігінің ресми сайтынан алынған деректер (16 865,2 млрд. теңге)

KASE-дегі мемлекеттік емес бағалы қағаздармен жасалған мәмілелер көлемі

(млн. теңге)

	2009 жылғы 1-тоқсанда	2009 жылғы 2-тоқсанда	2009 жылғы 3-тоқсанда
бастапқы орналастыру:	9 689	0	827
– "Акциялар" секторы бойынша	4 840	0	0
– "Борыштық бағалы қағаздар" секторы бойынша	4 849	0	827
– "Инвестициялық қорлардың бағалы қағаздары" секторы бойынша	0	0	0
– "Депозитарлық қолхаттар" секторы бойынша	0	0	0
– "Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары" секторы бойынша	0	0	0
– "Туынды бағалы қағаздар" секторы бойынша	0	0	0
қосалқы айналыс:	212 164	147 306	121 596
– "Акциялар" секторы бойынша	97 909	39 336	46 515
– "Борыштық бағалы қағаздар" секторы бойынша	114 113	107 605	75 064
– "Инвестициялық қорлардың бағалы қағаздары" секторы бойынша	142	365	17
– "Депозитарлық қолхаттар" секторы бойынша	0	0	0
– "Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары" секторы бойынша	0	0	0
– "Туынды бағалы қағаздар" секторы бойынша	0	0	0
"Листингтік емес бағалы қағаздар" секторы	175	105	42
"репо" мәмілелері	1 267 325	984 152	414 023
– "Акциялар" секторы бойынша	515 470	320 719	119 174
– "Борыштық бағалы қағаздар" секторы бойынша	750 404	662 625	294 438
– "Инвестициялық қорлардың бағалы қағаздары" секторы бойынша	0	0	194

– "Депозитарлық қолхаттар" секторы бойынша	0	0	0
– "Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары" секторы бойынша	0	0	0
– "Туынды бағалы қағаздар" секторы бойынша	0	0	0
– "Листингтік емес бағалы қағаздар" секторы	1 451	808	217
Жиынтығы	1 489 353	1 131 563	536 488

Кестеде келтірілген деректерден көрініп отырғандай, 2009 жылдың үшінші тоқсанында мемлекеттік емес бағалы қағаздармен жасалған мәмілелер көлемі 52,6%-ға азайды.

KASE-дегі мемлекеттік бағалы қағаздармен жасалған мәмілелер көлемі

(млн. теңге)

	2008 жылғы 3-тоқсанда	2008 жылғы 4-тоқсанда	2009 жылғы 1-тоқсанда	2009 жылғы 2-тоқсанда	2009 жылғы 3-тоқсанда
Мәмілелер көлемі, оның ішінде:	6 612 484	7 744 093	5 880 912	4 403 865	4 869 825
бастапқы орналастырулар	125 916	147 380	100 251	164 460	212 705
"репо" мәмілелері	6 373 982	7 414 364	5 698 168	4 072 546	4 410 550

Ағымдағы жылдың 3-тоқсанында ұйымдасқан нарықтағы мемлекеттік бағалы қағаздар бойынша жасалған биржалық мәмілелер көлемі 10,6%-ға ұлғайды. Бастапқы орналастырулар көлемі 29,3%-ға ұлғайды. Мемлекеттік бағалы қағаздармен жасалған мәмілелердің жалпы көлеміндегі "репо" мәмілесінің үлесі 8,3%-ға ұлғайды.

KASE капиталдандырылуының өзгеру динамикасының

(млн.теңге)

Ресми тізім секторы	2008 жылғы 1 қазанда	2009 жылғы 1 қаңтарда	2009 жылғы 1 сәуірде	2009 жылғы 1 шілдеде	2009 жылғы 1 қазанда
"Акциялар" секторы:	5 544 606	3 756 213	3 956 116	6 000 153	7 722 635
"Борыштық бағалы қағаздар" секторы "	1 496 041	1 520 839	1 737 777	1 751 705	1 852 884
"Инвестициялық қорлардың бағалы қағаздары" секторы	4 293	4 293	4 269	3 864	2 981
"Депозитарлық қолхаттар" секторы	0	0	0	0	0
"Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары" секторы	0	0	0	0	0
"Мемлекеттік бағалы қағаздар" секторы	0	0	0	0	0
"Туынды бағалы қағаздар" секторы	0	0	0	0	0
Жиынтығы	7 044 940	5 281 345	5 698 162	7 755 722	9 578 500

Кестеде келтірілген деректерден көрініп отырғандай, KASE ресми тізіміне кіргізілген мемлекеттік емес бағалы қағаздар бойынша нарықты жалпы капиталдандыру 2009 жылғы 1 қазандағы жағдай бойынша 2009 жылғы 1 шілдедегі көрсеткішпен салыстарғанда 23,5%-ға көбейді.

Бағалы қағаздар нарығындағы инвесторлар Инвестициялық басқарудағы зейнетақы активтері

2009 жылғы 1 қазандағы жағдай бойынша ЗАИБЖАҰ-ның инвестициялық басқаруындағы зейнетақы активтерінің жиынтық көлемі ағымдағы жылдың екінші тоқсанында 112,3 млрд. теңгеге немесе 6,8%-ға өсіп, 1 754,4 млрд. теңге болды.

Зейнетақы активтерінің орташа айлық өсімі 2008 жылғы 1 қазаннан бастап 2009 жылғы 1 қазанға дейінгі кезеңде 31,4 млрд. теңге болды.

Зейнетақы активтерінің жиынтық көлемін бөлу

ЗАИБЖАҰ / ЖЗҚ	зейнетақы активтері	
	млн. теңге	%-бен
«Қазақстан Халық Банкі» АҚ еншілес ұйымы «Қазақстан Республикасы Халық Банкінің жинақтаушы зейнетақы қоры» АҚ	522 680	29,80
"МЖЗҚ "Жинақтаушы зейнетақы қоры" АҚ	280 641	16,00
"Жетісу" ЗАИБЖАҰ" АҚ	222 713	12,69
"ҰларҮміт "Жинақтаушы зейнетақы қоры" АҚ	222 713	12,69
«БТА Қазақстан» Жинақтаушы зейнетақы қоры «БТАБанкі» АҚ еншілес ұйымы» АҚ	212 775	12,13
"GRANTUM Asset Management" ЗАИБЖАҰ" АҚ («Казкоммерцбанк» АҚ еншілес ұйымы АҚ)»	102 949	5,87
" ГРАНТУМ Жинақтаушы зейнетақы қоры" АҚ («Казкоммерцбанк» АҚ еншілес ұйымы АҚ)	102 949	5,87
«Банк ЦентрКредит» АҚ еншілес ұйымы» - «Капитал» ЖЗҚ» АҚ	77 072	4,39
«Еуразиялық жинақтаушы зейнетақы қоры» АҚ («Еуразиялық банк» АҚ ЕҰ)	57 438	3,27
«МұнайГаз-Дем» ЖЗҚ» АҚ	56 348	3,21
«Отан» Ашық жинақтаушы зейнетақы қоры» АҚ («АТФ Банк» АҚ ЕҰ)	52 995	3,02
«Нұр-Траст» ЗАИБЖАҰ» АҚ, «Нұрбанк» АҚ еншілес ұйымы	50 851	2,90
"Атамекен" Жинақтаушы зейнетақы қоры" «Нұрбанк» АҚ еншілес ұйымы" АҚ	50 851	2,90
«АМАНАТ ҚАЗАҚСТАН Жинақтаушы Зейнетақы Қоры» АҚ	34 604	1,97
«РЕСПУБЛИКА» Жинақтаушы зейнетақы» АҚ	32 927	1,88
«Қазақмыс Жинақтаушы зейнетақы Қоры» АҚ	28 927	1,65
"Өрлеу" ЗАИБЖАҰ» АҚ	21 431	1,22
"Қорғау" Жинақтаушы зейнетақы қоры АҚ	21 431	1,22
Барлық ЖЗҚ бойынша барлығы	1 754 351	100

2009 жылдың үшінші тоқсанында инвестицияланған зейнетақы активтерінің көлемі 133,2 млрд. теңгеге немесе 8,4%-ға өсіп, 2009 жылғы 1 қазанда 1 725,2 млрд. теңге болды.

Жинақтаушы зейнетақы қорларының инвестициялық портфеліндегі ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздарының үлесі 38,57% құрайды. 2009 жылғы 1 қазандағы жағдай бойынша мемлекеттік бағалы қағаздардың үлесі инвестицияланған зейнетақы активтерінің жалпы көлемінен (609,2 млрд. теңге) 35,31%-ды құрады және 2009 жылғы 1 шілдедегі жағдай бойынша осындай көрсеткішке қатысты 21,4%-ға немесе 107,4 млрд. теңгеге өсті.

ЖЗҚ-ның жиынтық инвестициялық портфелі

Қаржы құралдары	1.07.2009ж.		1.10.2009ж.	
	млн. теңге	%	млн. теңге	%
ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары, оның ішінде	501 764	31,52	609 168	35,31
ҚР еурооблигациялары	0	0	0	0
Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	462 415	29,05	568 107	32,93
Ұлттық Банктің ноттары	39 349	2,47	41 061	2,38
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес бағалы қағаздары	191 415	12,02	206 662	11,98
акциялар	40 778	2,56	45 337	2,63
облигациялар	150 637	9,46	161 325	9,35
Шетелдік инвестициялық қорлардың пайлары	0	0	0	0
Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары	80 434	5,05	91 450	5,30
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік бағалы қағаздары	95 299	5,99	68 909	3,99
Тазартылған алтын	0	0	0	0
ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде	637 526	40,04	665 336	38,57
акциялар	186 050	11,69	194 807	11,29

облигациялар оның ішінде:	451 476	28,35	470 529	27,28
шетелдік валютада номинирленген	23 773	1,49	27 169	1,58
теңгемен номинирленген	427 703	26,86	443 360	25,70
Екінші деңгейдегі банктердегі салымдар	81 771	5,14	80 487	4,67
Туынды бағалы қағаздар	3 831	0,24	3 169	0,18
Жиынтығы	1 592 040	100	1 725 181	100

Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктеріндегі салымдар көлемі бір тоқсанда 1,6%-ға азайып, 80,5 млрд. теңге болды.

2009 жылғы 1 қазандағы меншікті активтер есебінен сатып алынған ЖЗҚ-ның жиынтық инвестициялық портфелі

Қаржы құралдары	млн. теңге	жиынтыққа, %-бен
ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары, оның ішінде:	39 593	58,32
ҚР еурооблигациялары	0	0
Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	31 454	46,33
Ұлттық Банктің ноттары	8 139	11,99
жергілікті атқарушы органдардың бағалы қағаздары	0	0
Екінші деңгейдегі банктердегі салымдар	5 264	7,75
Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары	2 044	3,01
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік бағалы қағаздары	529	0,78
Шетелдік инвестициялық қорлардың пайлары	0	0
ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	11 871	17,48
акциялар	3 430	5,05
облигациялар	8 441	12,43
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	8 345	12,29
акциялар	619	0,91
облигациялар	7 726	11,38
"Кері РЕПО" операциялары	248	0,37
Жиынтығы:	67 894	100,00

2009 жылғы 1 қазанда жинақтаушы зейнетақы қорларының жиынтық меншікті портфеліндегі ең көп көлемді ҚР мемлекеттік емес бағалы қағаздары алады – 39 593 млн. теңге (58,32%). Бұл ретте меншікті активтер портфелінің 7,75%-ы екінші деңгейдегі банктердің салымдарына орналастырылған. ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздарының үлесі 17,48% құрады.

Инвестициялық қорлардың саны

	1.10.2008	1.01.2009	1.04.2009	1.07.2009	1.10.2009
Инвестициялық пай қорларының саны, оның ішінде	219	205	186	186	176
ашық	25	23	20	18	17
жабық	165	157	141	143	136
аралық	29	25	25	25	23
Акционерлік инвестициялық қорлардың саны	50	54	53	45	42

Инвестициялық пай қорлары пайшыларының саны

	1.10.2009
Инвестициялық пай қорлары пайшыларының саны, оның ішінде	1628
Количество пайщиков паевых инвестиционных фондов, в т.ч.	
Занды тұлғалар	83
Юридических лиц	
Жеке тұлғалар	1 545
Физических лиц	

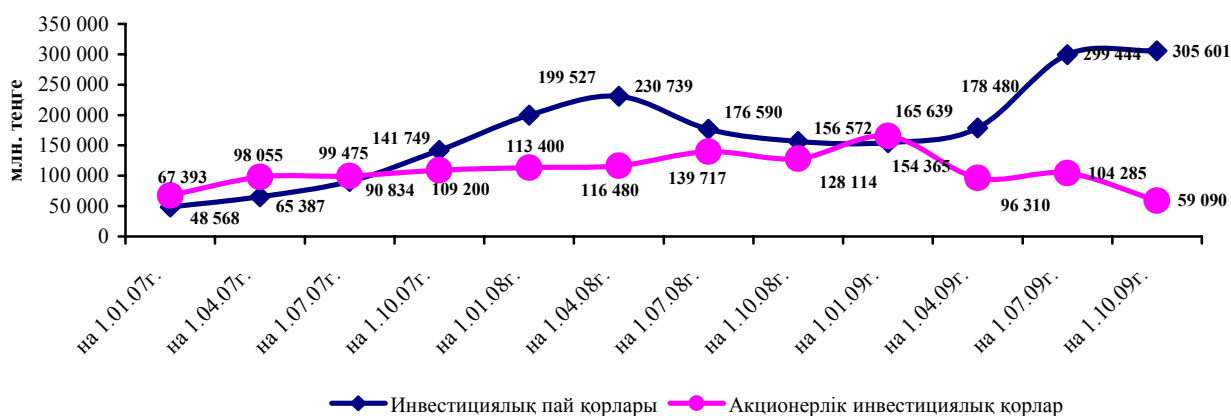
2009 жылғы 1 қазандағы инвестициялық қорлар активтері

2009 жылғы 1 қазандағы жағдай бойынша инвестициялық пай қорының және акционерлік инвестициялық қорлардың жиынтық активтері 305 601 млн. теңге және сәйкесінше 59 090 млн. теңге болды. 2009 жылғы 3-тоқсанда инвестициялық пай қорларының активтері 2,1%-ға өсті, акционерлік инвестициялық қорлардың активтері 43,3%-ға азайды.

(млн. теңге)

	2008 жылғы 1 қазанда	2009 жылғы 1 қаңтарда	2009 жылғы 1 сәуірде	2009 жылғы 1 шілдеде	2009 жылғы 1 қазанда
Инвестициялық пай қорлары	156 572	154 365	178 480	299 444	305 601
ашық	152 256	150 672	175 442	296 939	302 691
жабық	1 662	1 386	629	613	680
аралық	2 654	2 307	2 409	1 892	2 230
Акционерлік инвестициялық қорлар	128 114	165 639	96 310	104 285	59 090

Инвестициялық қорлар активтерінің өзгеру динамикасы



2009 жылғы 1 қазандағы инвестициялық қорлардың жиынтық инвестициялық портфелі

(млн. теңге)

Қаржы құралдары	Инвестициялық пай қорлары		Акционерлік инвестициялық қорлар	
	млн. теңге	жиынтығы на, %-бен	млн. теңге	жиынтыққа, %-бен
ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары, оның ішінде:	447	0,15	6	0,01

ҚР еурооблигациялары	-	-	-	-
Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	447	0,15	6	0,01
Ұлттық Банктің ноттары жергілікті атқарушы органдардың бағалы қағаздары	-	-	-	-
Екінші деңгейдегі банктердегі салымдар	4 965	1,62	898	1,51
Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары	436	0,14	-	-
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік бағалы қағаздары	0	0	-	-
Тазартылған алтын	-	-	-	-
ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	51 357	16,81	2 311	3,91
акциялар	46 382	15,18	507	0,86
облигациялар	4 975	1,63	1 803	3,05
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	4 655	1,52	1 712	2,90
акциялар	2 466	0,81	50	0,08
облигациялар	2 189	0,72	1 612	2,81
Инвестициялық қорлардың пайлары	106	0,03	156	0,26
Депозитарлық қолхаттар	386	0,13	59	0,10
"Кері РЕПО" операциясы	1 918	0,63	275	0,47
Жер учаскелері	7 378	2,41	3 008	5,09
Үйлер мен ғимараттар	641	0,21	7 407	12,54
Жылжымайтын мүліктің салынып жатқан және қайта құрастырылып жатқан объектілері	16 409	5,37	6 131	10,38
Жобалық-сметалық құжаттама	650	0,21	-	-
Жерді пайдалану және жер қойнауын пайдалану құқықтары	-	-	-	-
Акционерлік қоғам болып табылмайтын заңды тұлғалардың капиталындағы инвестициялық қордың инвестициялары	202 293	66,2	35 402	59,91
Туынды қаржылық құралдар	0	0,0	-	-
Өзге активтер/ дебиторлық берешек	13 960	4,57	1 725	2,92
Жиынтығы:	305 601	100	59 090	100

Инвестициялық пай қорларының жиынтық инвестициялық портфеліндегі негізгі үлесті үлесі акционерлік қоғам болып табылмайтын заңды тұлғалар капиталына инвестициялар иеленеді, олардың үлесіне 202 293 млн. теңге немесе 66,2% және тиісінше 35 402 млн. теңге немесе 59,9% тиеді.

Одан басқа акционерлік инвестициялық қорлар портфелінің 30% өзге мүлік (жер учаскелері, үйлер мен ғимараттар, жылжымайтын мүліктің салынып жатқан және қайта құрастырылып жатқан объектілері) иеленіп отыр, сол кезде осы мүлік инвестициялық пай қорлары портфелінің 8,2%-ын алады.

ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары инвестициялық пай қорларының инвестициялық портфелінде 16,81%, акционерлік инвестициялық қорлар портфелінде – 3,91%-ды иеленіп отыр. Шетел эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздарының ИПҚ-ның жиынтық портфеліндегі үлесі қомақты емес – 1,52% болса, АИҚ-ның портфелінде - 2,90% болды.

2009 жылғы 1 қазандағы екінші деңгейдегі банктердің инвестициялық портфелінің құрылымы

Қаржы құралдары	млн. теңге	жиынтыққа %-бен
ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары, оның ішінде:	351 979	24,3
ҚР Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	228 758	15,8
ҚР Ұлттық Банктің ноттары	123 221	8,5
Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары	44 640	3,1
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік бағалы қағаздары	9 138	0,6
ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	957 358	65,9
акциялар	51 534	3,5
облигациялар	905 824	62,4
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	88 711	6,1
акциялар	681	0,0
облигациялар	88 030	6,1
Жиынтығы:	1 451 826	100

ЕДБ портфелінің қомақты үлесін ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары құрайды – 65,9% немесе 957 358 млн. теңге. ҚР мемлекеттік бағалы қағаздарының үлесіне 24,3%-ы келеді. Шетел эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары жиынтық портфельдің 6,1%-ын, шетел эмитенттерінің мемлекеттік бағалы қағаздары – 0,6%-ын құрайды.

2009 жылғы 1 қазандағы сақтандыру ұйымдарының инвестициялық портфелінің құрылымы

Қаржы құралдары	млн. теңге	жиынтыққа %-бен
ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары, оның ішінде:	37 770	18,30
- ҚР еурооблигациялары	0	0,00
- Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	33 740	16,35
- Ұлттық Банктің ноттары	4 030	1,95
- жергілікті атқарушы органдарының бағалы қағаздары	0	0,00
Екінші деңгейдегі банктердегі салымдар	70 653	34,23
Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары	2 166	1,05
Инвестициялық қорлардың пайлары	150	0,07
Шет мемлекеттердің бағалы қағаздары	5 615	2,72
ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	64 187	31,10
- акциялар	5 967	2,89
- облигациялар	58 220	28,21
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	16 081	7,79
- акциялар	1 036	0,50
- облигациялар	15 045	7,29
"Кері РЕПО" операциялары	9 764	4,74
Жиынтығы:	206 386	100,00

Есепті күнге сақтандыру ұйымдарының жиынтық инвестициялық портфелінің көлемі 206 386 млн. теңге болды. Бұл ретте екінші деңгейдегі банктердегі салымдарға - 34,23%, ҚР эмитенттерінің корпоративті бағалы қағаздарына – 31,10%, Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздарының үлесіне 18,30%-дан келеді.

2009 жылғы 1 қазандағы бағалы қағаздар нарығы кәсіби қатысушыларының инвестициялық портфелінің құрылымы

Қаржы құралдары	млн. теңге	жиынтыққа %-бен
ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары, оның ішінде:	6 001	12,81
ҚР еурооблигациялары	0	0
Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	5 921	12,65
Ұлттық Банктің ноттары	80	0,17
жергілікті атқарушы органдарының бағалы қағаздары	0	0
Екінші деңгейдегі банктердегі салымдар	6 095	13,02
Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары	88	0,19
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік бағалы қағаздары	21	0,05
ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	20 012	42,75
акциялар	8 882	18,97
облигациялар	11 130	23,78
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	11 720	25,03
акциялар	2 322	4,96
облигациялар	9 398	20,07
Инвестициялық қорлардың пайлары	1 362	2,91
Туынды қаржы құралдары	0	0
"Кері РЕПО" операциялары	1 516	3,24
Жиынтығы:	46 815	100

2009 жылғы 1 қазандағы жағдай бойынша бағалы қағаздар нарығына кәсіби қатысушылардың жиынтық инвестициялық портфелі есепті тоқсан ішінде 11 037 млн. теңгеге немесе 19,1%-ға өсті және 46 815 млн. теңге болды. Портфель құрылымындағы ең көп үлесті ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары иеленеді - 42,75%. Шетел эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары 25,03%-ды құрайды, екінші деңгейдегі банктердегі салымдар – 13,02%, мемлекеттік бағалы қағаздар - 12,81%, «Кері РЕПО» операциялары – 3,24%.