

2006 жылғы 1 сәуірдегі Қазақстан Республикасының бағалы қағаздар рыногының ағымдағы жағдайы

Қазақстан Республикасының бағалы қағаздар рыногының институтционалдық инфрақұрылымының жағдайы 2006 жылдың 1 тоқсанында тұрақты болды.

	01.01.06 .	01.04.06 г.
Брокерлер – дилерлердің барлығы оның ішінде:	62	63
банктер	25	25
оның ішінде I санатты	22	22
банктік емес ұйымдар	37	38
оның ішінде I санатты	29	30
Тіркеушілер	18	17
Кастодиандар	11	11
ЖЗҚ-ның зейнетақы активтерін инвестициялық басқарушылар	10	10
Инвестициялық портфельді басқарушылар	28	28
ӨРҰ	2	2
Трансфер-агенттер	0	0
Бағалы қағаздармен сауда-саттықты ұйымдастырушылар	1	1

2006 жылғы бірінші тоқсанда брокерлік және дилерлік қызметті жүзеге асыруға номиналды ұстаушы ретінде клиенттердің шоттарын жүргізу құқығымен 2 лицензия берілді ("Visor Capital" АҚ, "Астана-Финанс" АҚ). Есепті кезеңде «Tau Securities» АҚ лицензиясы қайтарып алынды.

2006 жылғы 1 сәуірдегі жағдай бойынша бағалы қағаздар ұстаушылар тізілімін жүрізу жөніндегі қызметті жүзеге асыратын ұйымдар саны 17 болды. Бағалы қағаздар ұстаушылар тізілімі жүйесін жүрізу жөніндегі қызметті жүзеге асыруға лицензияны ерікті қайтарып беру негізінде «Зерде» АҚ лицензиясының іс-қимылы тоқтатылды, бұдан өзге «КАЗРЕЕСТР» АҚ лицензиясының іс-қимылы бағалы қағаздар рыногы жөніндегі ҚР заңнамасын жүйелі сақтамағандығы үшін үш ай мерзімге тоқтатылды.

2006 жылғы бірінші тоқсанда кастодиандық қызметті жүзеге асыратын банктердің жалпы саны өзгерген жоқ және 2006 жылғы 1 сәуірдегі жағдай бойынша 11 болды.

Есепті кезеңде 10 ұйым жинақтаушы зейнетақы қорларының зейнетақы активтерін инвестициялық басқаруды жүзеге асырды, олардың ішінде 3-уі зейнетақы активтерін тәуелсіз басқаруға лицензиясы бар жинақтаушы зейнетақы қорлары («МЖЗҚ» жинақтаушы зейнетақы қоры) АҚ және «Қазақстан Халық Банк» ЖЗҚ» АҚ, «БТА Қазақстан ЖЗҚ» АҚ).

2006 жылғы бірінші тоқсанда инвестициялық портфельді басқару жөніндегі қызметті жүзеге асыратын ұйымдардың жалпы саны өзгерген жоқ.

БҚР кәсіби қатысушылары бойынша қаржы көрсеткіштері

(млн. тенге)

	01.01.06 .	01.04.06 .	2006 жылы 1 тоқсандағы %-тегі өзгеріс
Жиынтық активтер, оның ішінде	30 420	84 296	177,11
брокерлер-дилерлер	11 781	59 541	405,40
тіркеушілер	1 718	1 382	-19,56
ИПБ	13 244	18 996	43,43

ЗАИБЖАҰ	3 677	4 377	19,04
Міндеттемелер, оның ішінде:	16 695	60 631	263,17
брокерлер-дилерлер	9 225	50 063	442,69
тіркеушілер	436	101	-76,83
ИПБ	7 014	10 440	48,85
ЗАИБЖАҰ	20	27	35,00
Меншікті капитал, оның ішінде:	13 725	23 665	72,42
брокерлер-дилерлер	2 556	9 478	270,81
тіркеушілер	1 282	1 281	-0,08
ИПБ	6 230	8 556	37,34
ЗАИБЖАҰ	3 657	4 350	18,95
жарғылық капитал, оның ішінде	7 530	11 740	55,91
брокерлер-дилерлер	1 166	5 034	331,73
тіркеушілер	1 106	1 136	2,71
ИПБ	3 628	3 940	8,60
ЗАИБЖАҰ	1 630	1 630	0,00

Келтірілген мәліметтерден көріп отырғанымыздай есепті кезеңде брокерлер мен дилерлердің қаржылық көрсеткіштері елеулі өсті. 2006 жылғы бірінші тоқсанда брокерлер мен дилерлердің жиынтық активтері 2006 жылғы 1 сәуірде 59 541 млн. теңгені құрап, 47 760 млн. теңгеге (5,1 есеге) өсті, міндеттеме 50 063 млн. теңгені құрап, 40 838 млн. теңгеге өсті (5,4 есеге). Бұл ең алдымен бағалы қағаздар рыногында жаңа ірі кәсіби қатысушы – «Астана-Қаржы» АҚ пайда болғандығымен негізделді. Есепті кезеңде тіркеушілердің негізгі қаржы көрсеткіштері кеміді: 2006 жылғы 1 сәуірдегі жағдай бойынша 19,56%-ке кеміп, жиынтық активтер 1 382 млн. теңгені құрады, ал міндеттемелер 76,83%-ке кеміп, 101 млн. теңгені құрады.

Бірінші тоқсанда инвестициялық портфельді басқарушылардың активтері және ЗАИБЖАҰ ұлғайды және 18 996 млн. теңгені (5 752 млн. теңгеге немесе 43,43%-ке өсті) және 4 377 млн. теңгені тиісінше құрады (өсу 700 млн. теңгеге немесе 19,04%-ке).

Бағалы қағаздар рыногындағы жұмыс үшін мамандарды дайындау

2006 жылғы 1 сәуірдегі жағдай бойынша Қазақстанда біреуі уәкілетті органның рұқсатымен бірінші және екінші санаттар бойынша мамандар дайындайтын және үшеуі – бірінші, екінші және үшінші санаттар бойынша мамандар дайындайтын төрт оқу орталығы жұмыс істейді.

2006 жылғы 1 тоқсанда барлығы 159 маман аттестациядан өтті және біліктілік куәліктерін алды, оның ішінде:

I санат бойынша – 67 маман;

II санат бойынша – 75 маман;

III санат бойынша – 17 маман.

Эмитенттер және қаржы құралдары

Акция шығарылымдары

2006 жылы үш ай ішінде 104 акция шығарылымын тіркеді, акциялар шығарылымы мен орналастыру қорытындылары туралы 102 есеп бекітілді, сондай-ақ 80 акция шығарылымының күші жойылды.

Акциялар шығарылымдары және шығарылымдар күшінің жойылғандығы туралы деректер

	2005 жылғы 1 тоқсанда	2005 жылғы 2 тоқсанда	2005 жылғы 3 тоқсанда	2005 жылғы 4 тоқсанда	2006 жылғы 1 тоқсанда
Тіркелген шығарылымдар	99	132	112	124	104
Шығарылымдар және орналастыру қорытындылары туралы есептер бекітілді	74	105	104	106	102
Күші жойылған шығарылымдар	124	179	121	123	80

2006 жылғы 1 сәуірдегі жағдай бойынша акциялардың қолданыстағы шығарылымының жалпы саны 2 440 болды, бұл ретте қолданыстағы шығарылымдармен акционерлік қоғамдар саны есепті күнге 2 277 болды. Бұл ретте «Қазақстан қор биржасы» АҚ ресми тізіміне «А» санаты бойынша 49 шығарылым, «В» санаты бойынша – 38 шығарылым енгізілді.

Қолданыстағы акция шығарылымдары бар акционерлік қоғамдар саны туралы деректер

	2005 жылғы 1 қаңтарға	2006 жылғы 1 қаңтарға	2006 жылғы 1 сәуірге
Акция шығарылымдарының саны	3 154	2 484	2 440
Акционерлік қоғамдар саны	3 071	2 300	2 277

Мемлекеттік емес облигациялардың шығарылымдары

2006 жылғы бірінші тоқсан ішінде Агенттік жалпы көлемі 143 909 млн. теңге 26 мемлекеттік емес облигация шығарылымын тіркеді, олардың ішінде жиынтық көлемі 10 500 млн. теңге 3 ипотекалық шығарылым бар.

Мемлекеттік емес облигациялардың тіркелген шығарылымдары туралы деректер

	2005 жылғы 1 тоқсанға	2005 жылғы 2 тоқсанға	2005 жылғы 3 тоқсанға	2005 жылғы 4 тоқсанға	2006 жылғы 1 тоқсанға
Шығарылымдар саны	7	17	15	16	26
Шығарылымдардың көлемі, млн. теңге	33 000	72 130	93 750	58 400	143 909

2006 жылғы бірінші тоқсанда жиынтық номиналды құны 41 530 млн. теңге облигация шығарылымдарын орналастыру нәтижелері туралы 14 есеп бекітілді.

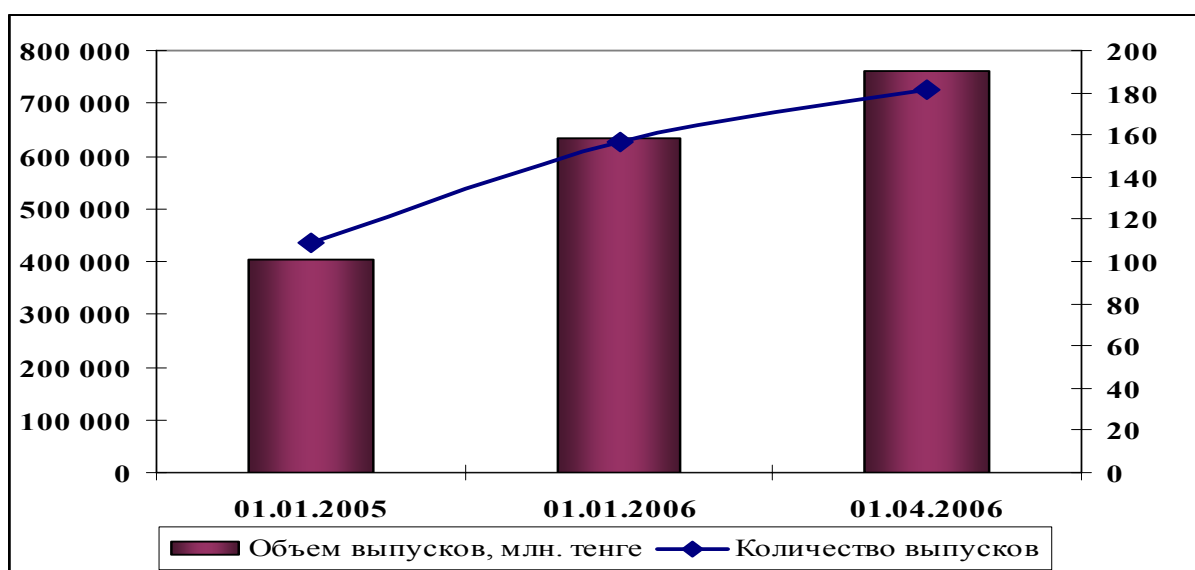
2006 жылғы бірінші тоқсанда облигацияны өтеу туралы сомасы 642 млн. теңге 1 есеп бекітілді.

Мемлекеттік емес облигациялардың қолданыстағы шығарылымдары туралы деректер

	2005 жылғы 1 қаңтарға	2006 жылғы 1 қаңтарға	2006 жылғы 1 сәуірге
Шығарылымдар саны	109	157	181
Шығарылымдардың көлемі, млн. теңге	404 752	632 456	759 342

2006 жылғы 1 сәуірдегі жағдай бойынша облигациялардың жиынтық номиналды құны 759 342 млн. теңге қолданыстағы шығарылымдарының саны 181 болды, олардың ішінде жиынтық номиналды құны 454 751 млн. теңге (59,89%) 143 шығарылымы KASE ресми тізіміне «А» санаты бойынша енгізілді және «В» санаты бойынша жиынтық номиналды құны 12 701 млн. теңге (1,67%) 9 облигация шығарылымы енгізілген. 2006 жылғы 1 сәуірдегі жағдай бойынша ЖІӨ-ге қатынасы бойынша облигациялардың қолданыстағы шығарылымдарының жиынтық көлемі 2006 жылғы бірінші тоқсандағы 0,21 проценттік тармаққа өсумен 8,70% болды. 2006 жылғы 1 қаңтардағы жағдай бойынша осындай көрсеткіш 8,49% процентті құрады.

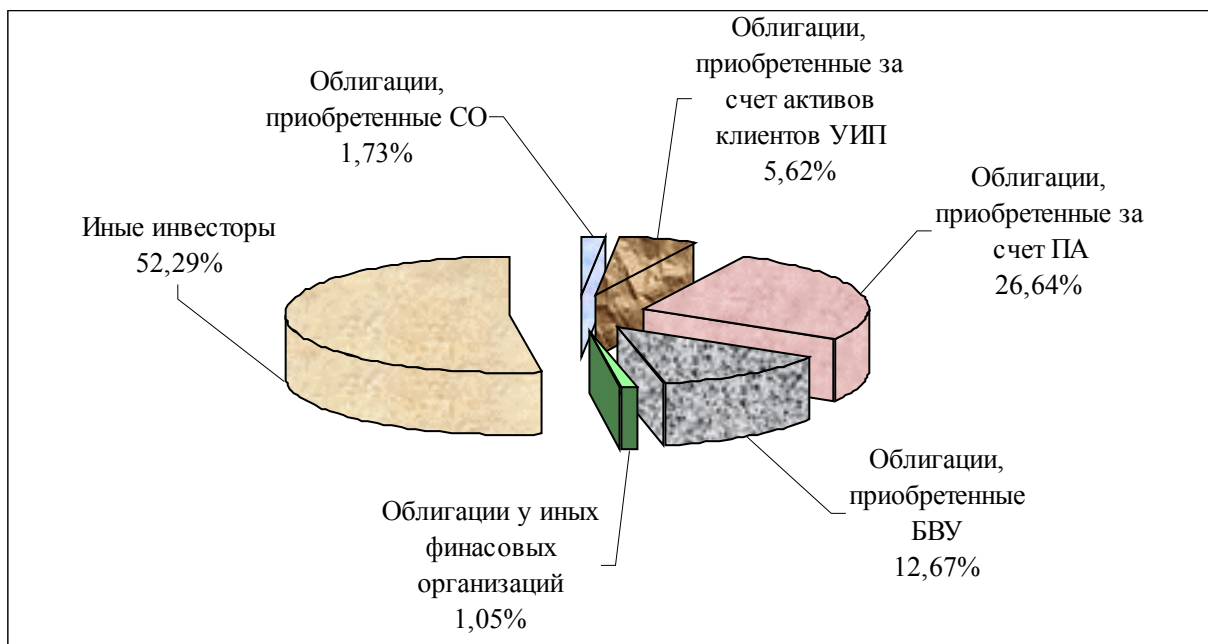
Облигациялардың қолданыстағы шығарылымдарының саны мен көлеміндегі өзгерістер динамикасы



2006 жылғы 1 сәуірдегі жағдай бойынша қолданыстағы корпоративтік облигациялар шығарылымдарының жиынтық көлемінде бөлу мынадай болды:

- зейнетақы активтері есебінен сатып алынған облигациялар – 26,64%;
- екінші деңгейдегі банктерден сатып алынған облигациялар – 12,67%;
- инвестициялық портфельді басқаратын клиенттердің активтері есебінен сатып алынған облигациялар – 5,62%;
- сақтандыру (қайта сақтандыру) ұйымдарынан сатып алынған облигациялар – 1,73%;
- өзге қаржы ұйымдардан сатып алынған облигациялар - 1,05%;
- өзге инвесторлар – 52,29%.

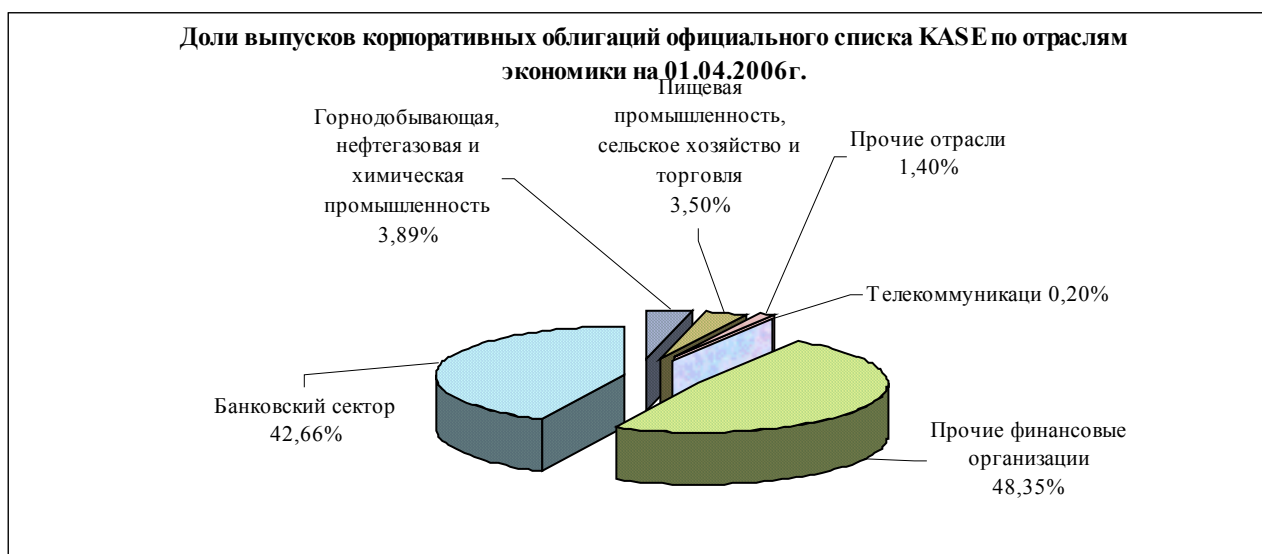
01.04.2006ж. ҚР корпоративті облигацияларының қолданыстағы шығарылымдарының жиынтық көлемінде инвесторлардың сатып алған облигацияларының үлесі



Айналыстағы корпоративтік облигациялардың үнемі өсуіне қарамастан жартысынан астамы кәсіби емес инвесторларда. Бұл ретте Қазақстан Республикасының аумағында шығарылған облигациялардың жалпы көлеміндегі облигацияларды институциональдық инвесторлар-ұстаушылардың үлес салмағы 47,71% болды.

Экономиканың салалары бойынша корпоративті облигациялардың қолданыстағы шығарылымын бөлу былай жүргізілді:

- тау-кен өндіруші, мұнай-газ және химия өнеркәсібі – 3,89%;
- тамақ өнеркәсібі, ауыл шаруашылығы және сауда – 3,50%;
- телекоммуникации – 0,20%;
- басқа салалар – 1,40%;
- банк секторы – 42,66%;
- басқа қаржылық ұйымдар – 48,35%.



KASE ресми тізіміне енгізілген корпоративті облигациялар мен еурооблигациялардың негізгі эмитенттері болып, қаржы секторының ұйымы -91,01%, оның ішінде екінші деңгейдегі банктер - 42,66% және қаржы секторының өзге ұйымдары - 48,35% болып табылады. Экономиканың өзге салаларына ресми тізімнің 8,99% келеді.

2006 жылғы 1 сәуірдегі жағдай бойынша бағалы қағаздар рыногында 52 инвестициялық пай қоры, оның ішінде 41 - жабық, 5 - ашық және 6 - аралық 2006 жылғы 1 қаңтардан басталған кезеңде ПИФ-тер саны 7-ге артты. Осындай тәсілмен, 2006 жылғы 1-тоқсанда 7 пай шығарылымы тіркелді, шығарылым нәтижелері мен пайларды орналастыру туралы 7 есеп бекітілді, 2006 жылғы 1 сәуірдегі жағдай бойынша 52 пай шығарылымы қолданыста.

Тіркелген пайлар шығарылымдары туралы деректер

	2005 жылғы 1 тоқсанға	2005 жылғы 2 тоқсанда	2005 жылғы 3 тоқсанда	2005 жылғы 4 тоқсанда	2006 жылғы 1 тоқсанда
Шығарылым тіркелді	4	15	15	9	7
Шығарылым және орналастыру қорытындысы туралы есептер бекітілді	2	4	8	12	7
Қолданыстағы шығарылымдар	6	21	36	45	52

Қазақстан¹ Республикасының аумағында айналыстағы мемлекеттік бағалы қағаздар

(млн. тенге)

	2006 жылғы 1 қаңтарда	2006 жылғы 1 сәуірде
Айналысқа шығарылғандардың барлығы оның ішінде	464 669	493 019
Ұлттық Банктің ноттары	161 000	182 861
Қаржы миинстрлігінің бағалы қағаздары	297 222	310 158
жергілікті атқарушы органдардың бағалы қағаздары	6 447	Мәліметтер жоқ

Биржалық бағалы қағаздар² рыногының негізгі көрсеткіштері

Бұрынғыдай, Қазақстандағы қор рыногы жағдайының негізгі индикаторы болып - KASE қор биржасы ұсынған ұйымдастырылған рыногы болып табылады.

Есепті кезеңде бағалы қағаздары KASE сауда-саттығына жіберілген қазақстандық эмитенттер саны тұрақты болып қалды.

Айналысқа жіберілген бағалы қағаздар шығарылымдарының негізгі үлес салмағы “В” санаты бойынша бағалы қағаздар шығарылымдарының үлесі 19,67% болғанда, “А” санаты бойынша шығарылымдар 80,33% құрады. Бұл ретте “А” санаты бойынша ресми тізімдегі бағалы қағаздардың жартысынан астамы екінші деңгейдегі банктердің шығарылымдарына келеді.

2006 жылғы 1 сәуірдегі жағдай бойынша “А” санаты бойынша KASE ресми тізіміне енгізілген корпоративтік облигациялар мен акция шығарылымдарының саны 143 және 49 болғанда, “В” санаты бойынша тиісінше 9 және 38 шығарылым болды.

KASE-гі сауда-саттыққа жіберілген бағалы қағаздар

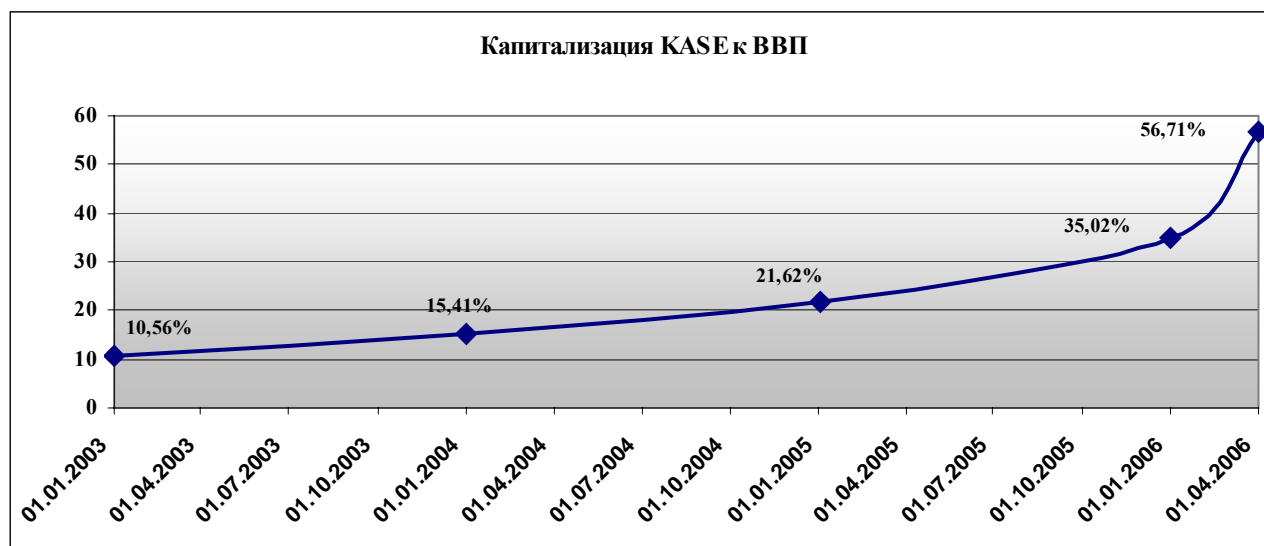
	2006 жылғы 1 қаңтарда		2006 жылғы 1 сәуірде	
	шығарылымдар саны	эмитенттер саны	шығарылымдар саны	эмитенттер саны
"А" листингі	189	61	192	59
"В" листингі	46	35	47	36
Жиынтығы:	235	96	239	95

2006 жылғы 1 сәуірдегі жағдай бойынша «А» және «В» санаты бойынша ресми тізіміне енгізілген мемлекеттік емес бағалы қағаздар бойынша рынокты жалпы капиталдандыру тиісінше 4 851 354 млн. теңге және 96 707 млн. теңге болды. Бұл ретте облигациялар бойынша капиталдандыру 1,79%-ке кеміді және акциялар бойынша қор рыногын капиталдандыру 167,63%-ке өсті.

(млн. теңге)

Листинг санаты	2006 жылғы 1 қаңтарда		2006 жылғы 1 сәуірде	
	акциялар	облигациялар	акциялар	облигациялар
"А" санаты	1 354 358	1 091 490	3 683 286	1 168 068
"В" санаты	53 061	111 427	83 350	13 357
Барлығы	1 407 419	1 202 917	3 766 636	1 181 425
Жиынтығы	2 610 336		4 948 061	

KASE жалпы капиталдандыру 4 948 061 млн. теңгені құрады, 2006 жылғы бірінші тоқсанда 21,69 проценттік тармаққа өсумен ЖІӨ-нің 56,71%-ін құрады. 2006 жылғы 1 қаңтардағы жағдай бойынша осындай көрсеткіш 35,02% болды. Қор рыногын капиталдандыруды ұлғайтумен қатар ЖІӨ-ге қор рыногын капиталдандыру көрсеткішінің өсуі де байқалады.



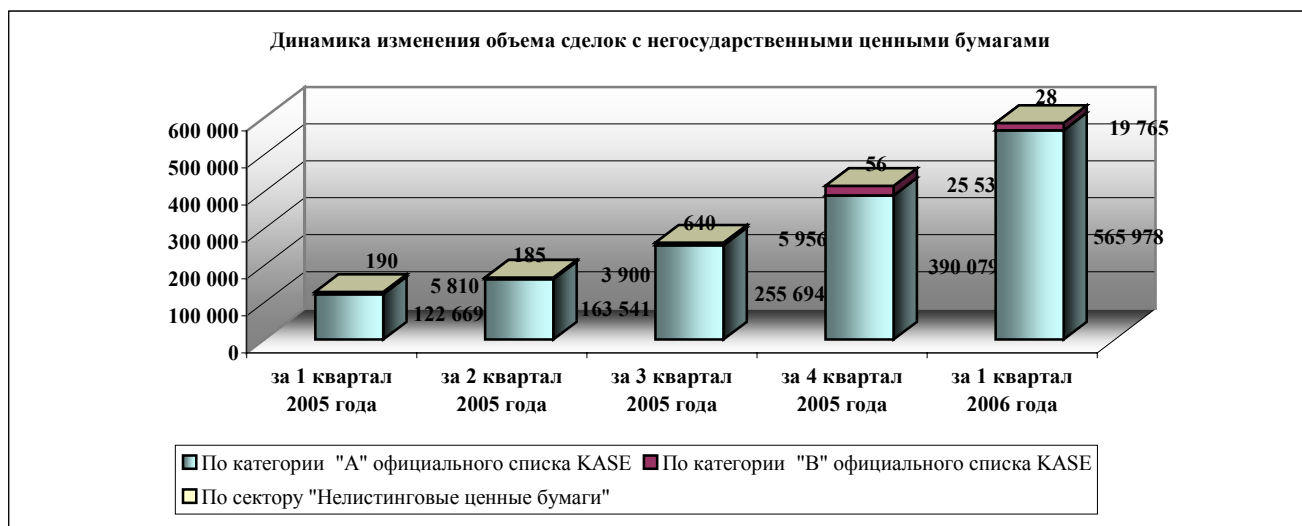
2006 жылғы бірінші тоқсанда мемлекеттік емес бағалы қағаздармен мәмілелер көлемі 40,92%-ке өсті. Бұл ретте «А» санаты бойынша ресми тізімге енгізілген мәмілелер көлемі 45,09%-ке өсті, ал «В» санаты бойынша 22,58%-ке кемісе, «Листингті емес бағалы қағаздар» секторы бойынша 50,00%-ке кеміді.

**Мемлекеттік емес бағалы қағаздармен жасалатын KASE-гі
мәмілелердің көлемі**

(млн. тенге)

	2005 жылғы 4 тоқсан үшін	2006 жылғы 1 тоқсан үшін	% өзгеріс
"А" ресми тізімі бойынша оның ішінде:	390 079	565 978	45,09
<i>бастапқы орналастырулар:</i>	9 308	2 383	-74,40
– акциялар бойынша	4286	908	-78,81
– облигациялар бойынша	5 022	1 475	-70,63
<i>қайталама айналыс:</i>	106 180	140 834	32,64
– акциялар бойынша	39 804	30 072	-24,45
– облигациялар бойынша	66 376	110 762	66,87
<i>"repo" мәмілелері:</i>	274 591	422 761	53,96
– акциялар бойынша	108 483	225 154	107,55
– облигациялар бойынша	166 108	197 607	18,96
"В" ресми тізімі бойынша оның ішінде:	25 531	19 765	-22,58
<i>бастапқы орналастырулар</i>	0	0	
– акциялар бойынша	0	0	
– облигациялар бойынша	0	0	
<i>қайталама айналыс:</i>	15 885	9 110	-42,65
– акциялар бойынша	12 365	6 561	-46,94
– облигациялар бойынша	3520	2 549	-27,59
<i>"repo" мәмілелері:</i>	9 646	10 655	10,46
– акциялар бойынша	9449	8 827	-6,58
– облигациялар бойынша	197	1 828	827,92
"Листингтік емес бағалы қағаздар" секторы бойынша	56	28	-50,00
Жиынтығы	415 666	585 771	40,92

KASE-де жасалатын мәмілелердің негізгі үлес салмағы бұрынғыша бағалы қағаздар рыногының негізгі инвесторларының ЖЗК, банктер және сақтандыру (қайта сақтандыру) ұйымдарының активтері осы санат эмитенттерінің бағалы қағаздарына орналастырғандығына байланысты «А» санатының ресми тізімі бойынша сауда-саттыққа жіберілген мемлекеттік емес бағалы қағаздарға (96,62%) келеді.

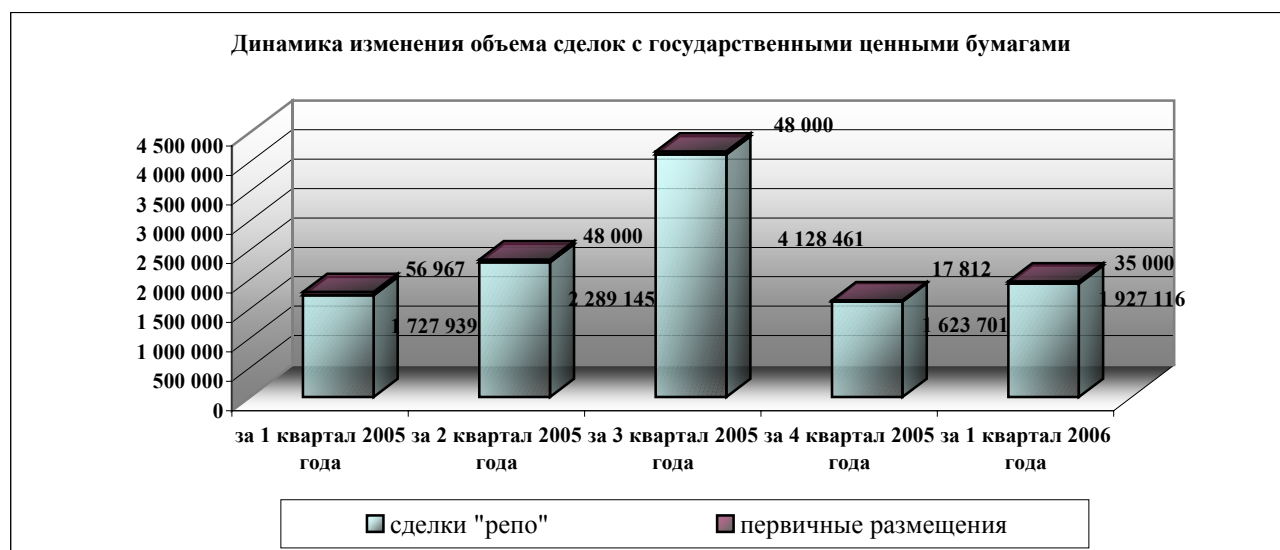


**Мемлекеттік бағалы қағаздармен жасалған
KASE-гі мәмілелердің көлемі**

(млн. тенге)

	2005 жылғы 4 тоқсан үшін	2006 жылғы 1 тоқсан үшін	% өзгеріс
Мәмілелердің көлемі оның ішінде:	1 754 640	2 045 976	16,60
бастапқы орналастырулар	17 812	35 000	96,50
“репо” мәмілелері	1 623 701	1 927 116	18,69

2006 жылғы бірінші тоқсанда ұйымдастырылған рыноктағы мемлекеттік бағалы қағаздар бойынша биржалық мәмілелер көлемі 16,60%-ке өсті, бұл ретте бастапқы орналастырулардың және «репо» мәмілелер көлемінің артуы аталған кезеңде тиісінше 96,50% және 18,69% болды.



Мемлекеттік бағалы қағаздармен жасалған мәмілелердің жалпы көлемінде «репо» мәмілелерінің үлесіне 94,19% келеді.

Бағалы қағаздар рыногындағы инвесторлар

**2006 жылғы 1 сәуірдегі инвестициялық
басқарудағы зейнетақы активтері**

Жинақтаушы зейнетақы қорларының зейнетақы активтерінің құрылымы

2006 жылғы 1 сәуірде инвестицияланған зейнетақы активтерінің көлемі 2006 жылғы 1 қаңтардағы кезеңнен бастап 76 648 млн. теңгеге немесе 12,07%-ке өсіп, 711 590 млн. теңге болды.

ЖЗҚ жиынтық инвестициялық портфелі

Қаржы құралдары	01.04.2006	
	млн. тенге	%
ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары, оның ішінде:	210 954	29,65
ҚР еурооблигациялары	3 920	0,55
Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	150 124	21,10
Ұлттық Банктің ноттары	56 834	7,99
жергілікті атқарушы органдардың бағалы қағаздары ценные	76	0,01

Шетел эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары	35 407	4,98
акциялар	2 928	0,41
облигациялар	32 479	4,57
Шетелдік инвестициялық қорлардың пайлары	279	0,04
Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары	3 540	0,50
Шетел эмитенттерінің мемлекеттік бағалы қағаздары	28 054	3,94
Тазартылған алтын	5 165	0,71
ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде	310 794	43,68
акциялар	90 761	12,76
облигациялар оның ішінде:	220 033	30,92
АҚШ долларына номинирленген	3 390	0,48
теңгеге номинирленген	215 588	30,30
Екінші деңгейдегі салымдар	117 397	16,50
жиынтығы	711 590	100,00

Келтірілген деректерден көріп отырғандай, 2006 жылғы 1 қаңтармен салыстырғанда мемлекеттік бағалы қағаздар үлесі 1 902 млн. теңгеге немесе 0,89%-ке кеміп, 210 954 млн. теңге немесе 29,65% болды. Қазақстан Республикасы эмитенттерінің корпоративті бағалы қағаздары көлемінің өсуі 2006 жылғы бірінші тоқсанда 50 773 млн. теңге или 19,53% болды. Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктеріндегі салымдарының көлемі 5 057 млн. теңгеге немесе 4,50%-ке өсіп, 117 397 млн. теңге болды.

Зейнетақы активтерін дербес инвестициялық басқаруды жүзеге асырушы ЗАИБЖАҰ мен ЖЗҚ зейнетақы активтерін екінші деңгейдегі банктерге салымға тек ұлттық валютада орналастырғанын атап өткен жөн.

2006 жылғы 1 сәуірдегі жағдай бойынша ЖЗҚ жиынтық инвестициялық портфеліндегі халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздарының үлесіне 0,50% келіп отыр. ЖЗҚ-ның жиынтық портфеліндегі шетелдік эмитенттерінің мемлекеттік бағалы қағаздарының көлемі 28 054 млн. теңге (3,94%) болды. Шетел эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздарының үлесіне 4,98% келді.

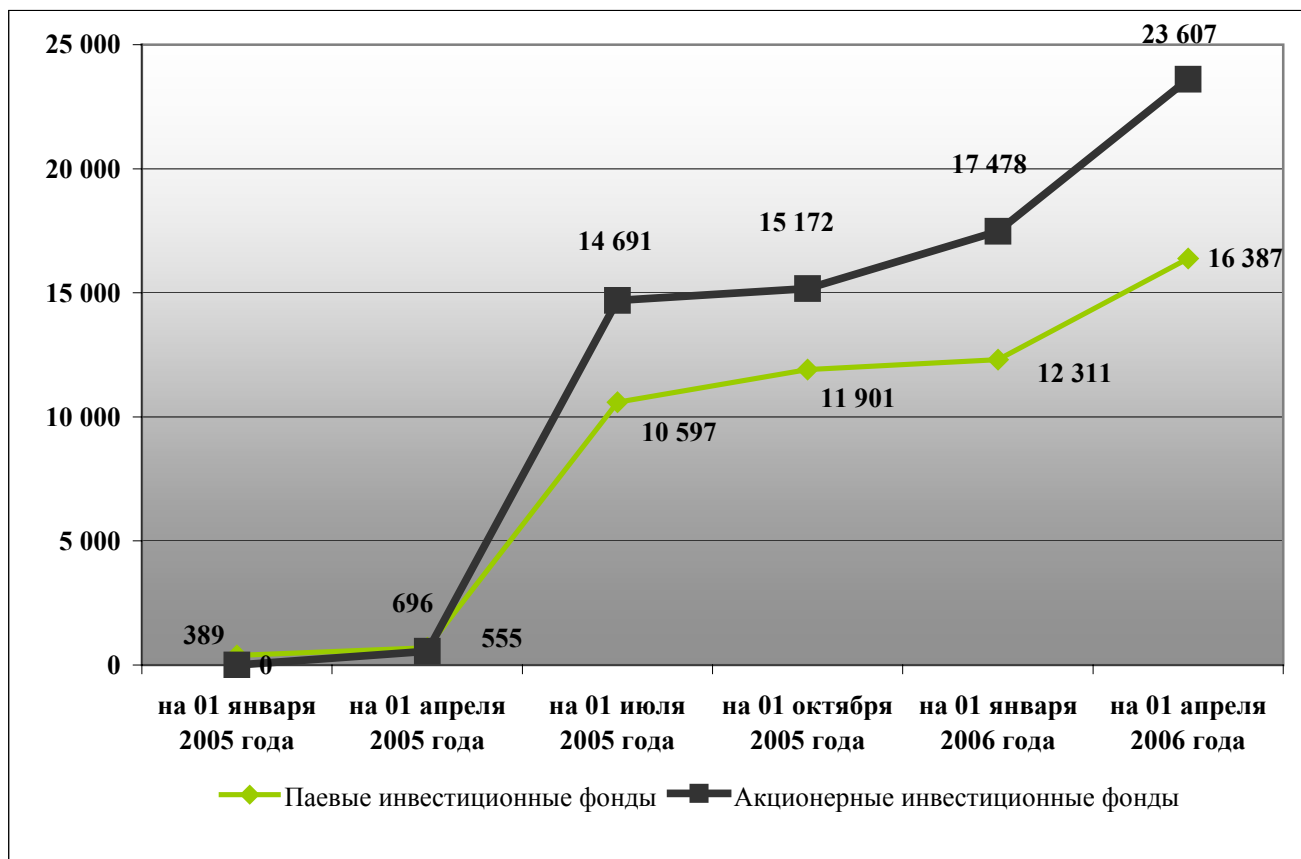
2006 жылғы 1 сәуірдегі инвестициялық қорлардың активтері

2006 жылғы 1 сәуірдегі жағдай бойынша инвестициялық пай қорларының және акционерлік инвестициялық қорлардың жиынтық активтері тиісінше 16 387 млн. теңге және 23 607 млн. теңге болды. 2006 жылғы 1 тоқсанда инвестициялық пай қорлары активтері көлемінің өсуі 33,11% болды. 2006 жылғы 1 қаңтардан бастап 1 сәуірге дейінгі кезеңде акционерлік инвестициялық қорлардың жиынтық активтерінің өсуі 35,07% болды.

(млн. теңге)

	2005 жылғы 1 қаңтарда	2005 жылғы 1 сәуірде	2005 жылғы 1 шілдеде	2005 жылғы 1 қазанда	2006 жылғы 1 қаңтарда	2006 жылғы 1 сәуірде
Инвестициялық пай қорлары	389	696	10 597	11 901	12 311	16 387
жабық	389	585	10 422	11 216	11 213	14 773
ашық	0,0	111	175	579	735	1 118
аралық	0,0	0,0	0,0	106	363	496
Акционерлік инвестициялық қорлар	0,0	555	14 691	15 172	17 478	23 607

Инвестициялық қорлардың активтерінің өзгеру динамикасы



2006 жылғы 1 сәуірдегі инвестициялық қорлардың жиынтық инвестициялық портфелі

Қаржы құралдары	Инвестициялық пай қорлар		Акционерлік инвестициялық қорлар	
	млн. тенге	жиынтығы %-пен	млн. тенге	жиынтығы %-пен
ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары, оның ішінде:	0	0,00	0	0,00
ҚР еурооблигациялары	0	0,00	0	0,00
Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	0	0,00	0	0,00
Ұлттық Банктің ноттары	0	0,00	0	0,00
жергілікті атқарушы органдардың бағалы қағаздары	0	0,00	0	0,00
Екінші деңгейдегі банктердің салымдары	2 414	15,59	60	0,27
Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары	0	0,00	0	0,00
Шетел эмитенттерінің мемлекеттік бағалы қағаздары	71	0,46	233	1,04
Тазартылған алтын	0	0,00	0	0,00

ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде	6 004	38,77	8 291	37,10
<i>акциялар</i>	<i>2 561</i>	<i>16,54</i>	<i>5 931</i>	<i>26,54</i>
<i>облигациялар</i>	<i>3 443</i>	<i>22,23</i>	<i>2 360</i>	<i>10,56</i>
Шетел эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары	2497	16,12	603	2,70
<i>акциялар</i>	<i>1720</i>	<i>11,10</i>	<i>0</i>	<i>0,00</i>
<i>облигациялар</i>	<i>777</i>	<i>5,02</i>	<i>603</i>	<i>2,70</i>
Инвестициялық қорлардың пайлары	45	0,29	7 361	32,94
Депозитарлық қолхаттар	1055	6,81	186	0,83
"Кері РЕПО" операциясы	2 033	13,13	1 667	7,46
Жер учаскелері	156	1,01	508	2,27
Үй-жайлар және ғимараттар	0	0,00	0	0,00
Жылжымайтын мүліктің салынып жатқан және қайта құрылатын объектілері	256	1,65	73	0,33
Жоба-сметалық құжаттамасы	0	0,00	0	0,00
Жерді пайдалану және жер қойнауын пайдалану құқықтары	0	0,00	0	0,00
Акционерлік қоғам болып табылмайтын заңды тұлғалардың капиталындағы инвестициялық қордың инвестициялары	738	4,76	540	2,42
Өзге активтер/дебиторлық берешек	219	1,41	2 825	12,64
Жиынтығы:	15 488	100,00	22 347	100,00

2006 жылғы 1 сәуірдегі жағдай бойынша инвестициялық қорлардың жиынтық инвестициялық портфелінде негізгі үлесті ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары 14 295 млн. теңге (37,78%) және инвестициялық қорлардың пайлары 7 406 млн. теңге (19,57%) алып отыр.

2006 жылғы 1 сәуірде меншікті активтердің есебінен алынған ЖЗК жиынтық инвестициялық портфелі

Қаржы құралдары	млн. теңге	жиынтық %-пен
ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары, оның ішінде:	3 164	25,44
ҚР еурооблигациялары	0	0,00
Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары ценные бумаги	1 665	13,39
Ұлттық Банктің ноттары	1 402	11,27
жергілікті атқарушы органдарының бағалы қағаздары ценные	97	0,78
Екінші деңгейдегі банктердегі салымдар	3 346	26,90
Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары	0	0,00
Шетел эмитенттерінің мемлекеттік бағалы қағаздары	0	0,00
Шетел инвестициялық қорларының пайлары	0	0,00
ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы	4 607	37,04

қағаздары, оның ішінде:		
акциялар	1 335	10,73
облигациялар	3 272	26,31
Шетел эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары	0	0,00
акциялар	0	0,00
облигациялар	0	0,00
"Кері РЕПО" операциясы	1 321	10,62
Жиынтығы:	12 438	100

Жинақтаушы зейнетақы қорларының жиынтық меншікті портфеліндегі ең көп көлемін ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары – 4 607 млн. теңгені (37,04%) алып отыр, екінші деңгейдегі банктердегі салымдарға меншікті активтер портфелінің 26,9%-і орналастырылды. Мемлекеттік бағалы қағаздар үлесі 25,44%.

2006 жылғы 1 сәуірдегі екінші деңгейдегі банктердің инвестициялық портфелінің құрылымы

Қаржы құралдары	млн. теңге	жиынтығы %-пен
ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары, оның ішінде:	215 086	29,75
ҚР еурооблигациялары	38 398	5,31
Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	99 612	13,78
Ұлттық Банктің ноттары	74 544	10,31
жергілікті атқарушы органдардың бағалы қағаздары	2 532	0,35
Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары	141 452	19,56
Шетел эмитенттерінің мемлекеттік бағалы қағаздары	155 853	21,55
ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	124 785	17,26
акциялар	3 994	0,55
облигациялар	120 791	16,71
Шетел эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	85 924	11,88
акциялар	0	0,00
облигациялар	85 924	11,88
Жиынтығы:	723 100	100

2006 жылғы 1 сәуірде екінші деңгейдегі банктердің жиынтық инвестициялық портфелі 723 100 млн. теңгені құрады. Портфельдің 30%-ін ҚР эмитенттерінің мемлекеттік бағалы қағаздары немесе 217 598 млн. теңге құрады. ҚР эмитенттерінің мемлекеттік бағалы қағаздарының үлесіне 16,91% келді. Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары жиынтық портфельдің 19,56%-ін құрады, ал шетел эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары – 11,88%-ін алып отыр.

2006 жылғы 1 сәуірдегі Қазақстан Даму Банкінің инвестициялық портфелінің құрылымы

Қаржы құралдары	млн. тенге	жиынтығы %-пен
ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары, оның ішінде:	50 824	70,28
ҚР еурооблигациялары	0	0,00
Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	47 835	66,15
Ұлттық Банктің ноттары	0	0,00
жергілікті атқару органдарының бағалы қағаздары	2 989	4,13
Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары	1 349	1,87
Шетел эмитенттерінің мемлекеттік бағалы қағаздары	0	0,00
ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	20 143	27,85
акциялар	0	0,00
облигациялар	20 143	27,85
Шетел эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	0	0,00
акциялар	0	0,00
облигациялар	0	0,00
Жиынтығы:	72 316	100

2006 жылғы 1 сәуірде «Қазақстан Даму Банкі» жиынтық инвестициялық портфелі 72 316 млн. теңгені құрады, портфельді әртараптандыру былай байқалды: мемлекеттік бағалы қағаздар 70,28%, ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары 27,85%, халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары – 1,87%.

2006 жылғы 1 сәуірдегі сақтандыру ұйымдарының инвестициялық портфелінің құрылымы

Қаржы құралдары	млн. тенге	жиынтығы %-пен
ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары, оның ішінде:	22 651	37,40
- ҚР еурооблигациялары	342	0,55
- Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	16 918	27,94
- Ұлттық Банктің ноттары	5 371	8,87
- жергілікті атқару органдарының бағалы қағаздары	20	0,03
Екінші деңгейдегі банктердегі салымдар	13 448	22,21
Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары	332	0,55
Шетел мемлекеттерінің бағалы қағаздары	332	0,55
ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	14 620	24,15
- акциялар	1 694	2,80
- облигациялар	12 926	21,35
Шетел эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	0	0,00
- акциялар	0	0,00

- облигациялар	0	0,00
«Кері РЕПО» операциясы	9 499	15,69
Жиынтығы:	60 550	100,00

2006 жылғы 1 сәуірде СҰ жиынтық инвестициялық портфелінің көлемі 60 550 млн. теңге болды. СҰ жиынтық инвестициялық портфеліндегі Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздарының үлесі 37,40% құрады, бұл уақытта Қазақстан Республикасы эмитенттерінің корпоративті бағалы қағаздар үлесі – 24,15% болды, ал екінші деңгейдегі банктердегі салымдар үлесі – 22,21% болды

2006 жылғы 1 сәуірдегі «Экспорттық кредиттерді және инвестицияларды сақтандыру жөніндегі мемлекеттік сақтандыру корпорациясы» АҚ инвестициялық портфелінің құрылымы

Қаржы құралдары	млн. теңге	жиынтығы %-пен
ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары, оның ішінде:	8 507	96,59
-ҚР еурооблигациялары	0	0,00
- Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	8 507	96,59
-Ұлттық Банктің ноттары	0	0,00
-жергілікті атқару органдарының бағалы қағаздары	0	0,00
Екінші деңгейдегі банктердегі салымдар	0	0,00
Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары	0	0,00
Шет мемлекеттердің бағалы қағаздары	0	0,00
ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	0	0,00
- акциялар	0	0,00
- облигациялар	0	0,00
Шетел эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	0	0,00
- акциялар	0	0,00
- облигациялар	0	0,00
«Кері РЕПО» операциясы	300	3,41
Жиынтығы:	8 807	100,00

2006 жылғы 1 сәуірдегі жағдай бойынша «Экспорттық кредиттерді және инвестицияларды сақтандыру жөніндегі мемлекеттік сақтандыру корпорациясы» АҚ инвестициялық портфелі 8 507 млн. теңге болды. Бұл ретте портфельдің 100%-ін ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары немесе 8 507 млн. теңге алды.

2006 жылғы 1 қаңтардағы бағалы қағаздар рыногы кәсіби қатысушыларының инвестициялық портфелінің құрылымы

Қаржы құралдары	млн. теңге	жиынтығы %-пен
ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары, оның ішінде:	1 514	4,49
ҚР еурооблигациялары	19	0,06
Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	1 359	4,03
Ұлттық Банктің ноттары	125	0,37

жергілікті атқару органдарының бағалы қағаздары	11	0,03
Екінші деңгейдегі банктердегі салымдар	1 629	4,83
Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары	1 823	5,41
Шетел эмитенттерінің мемлекеттік бағалы қағаздары	6 796	20,16
ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	16 018	47,53
акциялар	10 249	30,41
облигациялар	5 769	17,12
Шетел эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	2 428	7,21
акциялар	275	0,82
облигациялар	2 153	6,39
Инвестициялық қорлардың пайлары	215	0,64
«Кері РЕПО» операциясы	3 281	9,73
Жиынтығы:	33 704	100

2006 жылғы 1 сәуірдегі жағдай бойынша инвестициялық портфельдің жиынтық көлемі 2006 жылғы 1 тоқсанда 21 486 млн. теңгеге немесе 175,85%-ке өсе отырып, 33 704 млн. теңгені құрады.

¹ По данным Национального Банка РК

² По данным KASE