

2005 жылғы 1 сәуірдегі Қазақстан Республикасының бағалы қағаздар рыногының ағымдағы жағдайы

Қазақстан Республикасының бағалы қағаздар нарығының институтционалды инфроқұрылымының жағдайы 2005 жылдың 1 тоқсанында тұрақты болды.

Состояние институциональной инфраструктуры рынка ценных бумаг Республики Казахстан в I квартале 2005 года в целом оставалось стабильным.

Өткен есепті кезеңде елеусіз сандық өзгеріске брокер-дилерлердің санының 2 ұйымға артуы болып табылады. Сонымен қатар бірінші кезекте бірінші инвестициялық қорлардың пайда болуымен байланысты инвестициялық портфельді басқаруды жүзеге асыратын ұйымдардың өсуі жалғасуда.

	01.01.05 .	01.04.05 .
Брокерлер – дилерлер барлығы оның ішінде:	57	59
банктер	24	24
оның ішінде I санатты	22	22
банктік емес ұйымдар	33	35
оның ішінде I санатты	27	28
Тіркеушілер	18	18
Кастодиандар	10	10
ЖЗҚ-ның зейнетақы активтерін инвестициялық басқарушылар	10	10
Инвестициялық портфельді басқарушылар	14	18
ӨРҰ	2	2
Трансфер-агенттер	0	0

Брокерлер-дилерлер

Есепті кезеңде бағалы қағаздар рыногында брокерлік-дилерлік қызметті жүзеге асыруға 2 лицензия берілді, оның ішінде номиналды ұстаушы ретінде клиенттердің шоттарын жүргізу құқығымен ("NOMAD FINANCE" АҚ) – 1 және клиенттердің шоттарын жүргізу құқығынсыз – 1 лицензия (АЛЬФА ТРАСТ" "ЗАИБЖАҰ "АҚ) берілді. 2005 жылғы 1 тоқсанда ұйымдардың атауының өзгеруіне байланысты осы қызмет түрлерін жүзеге асыру үшін 6 лицензия қайта ресімделді.

2005 жылғы 1 сәуірдегі жағдай бойынша Агенттік бағалы қағаздар рыногында брокерлік-дилерлік қызметті жүзеге асыруға лицензия беру үшін 5 өтініш қарады.

(млн. тенге)

Брокерлер-дилерлер бойынша қаржы көрсеткіштері	01.01.05 .	01.04.05 .	2005 жылы 1 тоқсандағы өзгеріс
Жиынтық активтер, оның ішінде:	2 661 379	2 924 609	9,89
екінші деңгейдегі банктер	2 646 181	2 908 244	9,90
банктік емес ұйымдар	5 248	3 460	-34,07
ИПБ	5 518	6 393	15,86
УИП	4 432	6 512	46,93
ЗАИБЖАҰ	4 432	6 512	46,93
Міндеттемелер оның ішінде:	2 392 494	2 640 667	10,37
екінші деңгейдегі банктер	2 387 752	2 637 354	10,45

банктік емес ұйымдар	1 916	526	-72,55
ИПБ	2 767	2 691	-2,75
ЗАИБЖАҰ	59	96	62,71
Меншікті капитал оның ішінде:	268 885	283 942	5,60
екінші деңгейдегі банктер	258 429	270 890	4,82
банктік емес ұйымдар	3 332	2 934	-11,94
ИПБ	2 751	3 702	34,57
ЗАИБЖАҰ	4 373	6 416	46,72
жарғылық капитал, оның ішінде:	149 211	151 806	1,74
екінші деңгейдегі банктер	143 770	145 440	1,16
банктік емес ұйымдар	1 887	1 646	-12,77
ИПБ	1 354	1 940	43,28
ЗАИБЖАҰ	2 200	2 780	26,36

Келтірілген кестеден көрініп отырғандай, брокерлер-дилерлер бойынша жиынтық активтер, 2005 жылғы 1 тоқсанда 9,89% -ке өсе отырып, 2005 жылғы 1 сәуірде 2 924 609 млн теңгені құрады, жиынтық міндеттемелер - 2 640 667 млн. теңге (10,37%), меншікті капитал - 283 942 млн. теңге (5,6%).

Тіркеушілер

2005 жылғы 1 тоқсанда бағалы қағаздарды ұстаушылар тізілімін жүргізу жөніндегі қызметті жүзеге асыратын ұйымдардың жалпы санында өзгерістер болған жоқ. 2005 жылғы 1 сәуірдегі жағдай бойынша Агенттік бағалы қағаздарды ұстаушылар тізілімін жүргізу жөніндегі қызметті жүзеге асыруға лицензия беру үшін 2 өтінішті қарады. Есепті кезеңде заңды тұлғаның атауының өзгеруіне байланысты тіркеушілер қызметін жүзеге асыруға 2 лицензия қайта ресімделді.

Тіркеушілер бойынша қаржылық көрсеткіштері	(млн. теңге)		
	01.01.05 .	01.04.05 .	2005 жылғы 1 тоқсан ішіндегі өзгеруі
Жиынтық активтер	1 097	1194	8,84
Міндеттемелер	18	79	338,89
Меншікті капитал оның ішінде	1 079	1115	3,34
Жарғылық капитал	834	912	9,35

Келтіріп отырған кестеден көріп отырғанымыздай, тіркеушілер бойынша жиынтық активтер 2005 жылғы 1 тоқсандағы жағдай бойынша 8,84%-ке өсе отырып 2005 жылғы 1 сәуірде 1 194 млн. теңге болды, жиынтық міндеттемелер –79 млн. теңге (338,89%), меншікті капитал -1 115 млн. теңге (3,34%).

Инвестициялық портфельді басқарушылар

2005 жылғы 1 тоқсанның ішінде инвестициялық портфельді басқару жөніндегі қызметті жүзеге асыру үшін 4 лицензия берілді. ("KG Securities" АҚ, "Фондовый сервис" АҚ, "NOMAD FINANCE" АҚ "Halyk Finance" АҚ). 2005 жылғы 1 сәуірдегі жағдай бойынша инвестициялық портфельді басқаруды жүзеге асыратын ұйымдардың саны 18 болды. Бұдан өзге, есепті күнге қызметтің осы түрін жүзеге асыруға лицензия беру үшін 1 өтініш қаралып жатыр.

(млн. тенге)

ИПБ бойынша қаржы көрсеткіштері	01.01.05 .	01.04.05 .	2005 жылғы 1 тоқсан ішіндегі өзгеруі
Жиынтық активтер, оның ішінде	7 521	8 965	19,20
банктік емес ұйымдар	5 606	6 488	15,73
ЗАИБЖАҰ	1 915	2 477	29,35
Міндеттемелер, оның ішінде	2 812	2 734	-2,77
банктік емес ұйымдар	2 767	2 693	-2,67
ЗАИБЖАҰ	45	41	-8,89
Меншікті капитал, оның ішінде	4 709	6 231	32,32
банктік емес ұйымдар	2 839	3 795	33,67
ЗАИБЖАҰ	1870	2436	30,27

2005 жылғы 1 сәуірдегі жағдай бойынша инвестициялық портфельді басқарушы активтердің жиынтық баланс құны 8 965 млн. теңгені құрады, сонымен қатар есепті кезеңде 1 444 млн. теңгеге өсті. (19,2%). Меншікті капиталдың өсуі - 1 522 млн. теңгеге немесе 32,32% болды. Меншікті капиталдың өсуі - 1 522 млн. теңге немесе 32,32% болды.

Кастодиандар

1 тоқсанда кастодиандық қызметті жүзеге асыратын банктердің жалпы санында өзгеріс болған жоқ,. 2005 жылғы 1 сәуірдегі жағдай бойынша Агенттік кастодиандық қызметті жүзеге асыруға лицензия беру туралы 2 өтінішті қарады.

Есепті кезеңде заңды тұлға атауының өзгеруіне байланысты кастодиандық қызметті жүзеге асыруға 1 лицензия қайта ресімделді.

Зейнетақы активтерін инвестициялық басқаруды жүзеге асыратын ұйымдар (ЗАИБЖАҰ)

Есепті кезеңде зейнетақы активтерін инвестициялық басқаруды жүзеге асыратын ұйымдардың жапы санында өзгеріс болған жоқ, 2004 жылы 1 сәуірде жинақтаушы зейнетақы қорларының зейнетақы активтерін инвестициялық басқаруды 10 ұйым жүзеге асырды, олардың ішінде 3 жинақтаушы зейнетақы қорында зейнетақы активтерін дербес басқаруға лицензия болды (“МЖЗҚ” ЖЗҚ” АҚ және “Қазақстан Халық Банкі ЖЗҚ” АҚ, БТА Құрмет-Қазақстан ЖЗҚ” АҚ).

Есепті кезеңде атаудың өзгеруіне байланысты 2 лицензия қайта ресімделді.

(млн. тенге)

ЗАИБЖАҰ бойынша қаржы көрсеткіштері Финансовые показатели по ООИУПА	01.01.05.	01.04.05.	2005 жылғы 1 тоқсан ішіндегі өзгеруі Изменение за 1 квартал 2005 года
Жиынтық активтер	2 620	3139	19,81
Совокупные активы			
Міндеттемелер	49	45	-8,16
Обязательства			
Меншікті капитал, оның ішінде	2 571	3094	20,34
Собственный капитал, в.ч.:			
жарғылық капитал	1 630	1630	0,00
уставный капитал			

Трансфер-агенттер

2005 жылғы 1 тоқсанның ішінде трансфер-агенттік қызметті жүзеге асыруға лицензиялар берілген жоқ және аталған лицензияларды алуға өтініштер қабылданған жоқ.

Эмитенттер және қаржы құралдары Акциялардың шығарылымы

Акциялардың шығарылымдары мен шығарылымдардың күшін жою туралы деректер

	2004 жылғы 4 тоқсанда	2005 жылғы 1 тоқсанда
Шығарылымдар тіркелді	93	99
Шығарылымдар мен орналастыру қорытындылары туралы есептер бекітілді	104	74
Шығарылымдардың күші жойылды	192	124

Агенттік 1 тоқсанда 99 акцияның шығарылымын тіркеді, шығарылымдар мен акцияларды орналастыру қорытындылары туралы 74 есеп бекітілді, сондай-ақ 124 акция шығарылымының күші жойылды.

Қолданыстағы акция шығарылымдары бар акционерлік қоғамдардың саны туралы деректер

	2005 жылғы 1 қаңтарға	2005 жылғы 1 сәуірге
Акция шығарылымдарының саны	3 154	2 829
Акционерлік қоғамдардың саны	3 071	2 554

Осылайша, акциялардың қолданыстағы шығарылымдарының жалпы саны 2005 жылғы 1 сәуірде - 2 829 құрады, бұл ретте қолданыстағы шығарылымдары бар акционерлік қоғамдардың саны көрсетілген күнге 2 554 болды.

2005 жылғы 1 сәуірдегі жағдай бойынша ашық халықтық акционерлік қоғамның мәртебесі 13 қазақстандық акционерлік қоғамға берілді.

Мемлекеттік емес облигациялардың шығарылымы

2005 жылғы 1 тоқсанда Агенттік жалпы көлемі 33 000 млн. теңге мемлекеттік емес облигацияның 7 шығарылымын, оның ішінде 25 000 млн. теңгеге 5 ипотекалық шығарылым (осы бағалы қағаздар облигациялық бағдарлама шеңберінде шығарылды) тіркелді.

Мемлекеттік емес облигациялардың тіркелген шығарылымдары туралы деректер

	2004 жылғы 4 тоқсанда	2005 жылғы 1 тоқсанда
Шығарылымдардың көлемі	20	7
Шығарылымдардың көлемі, млн. теңге	62 550	33 000

№	Эмитенттің атауы	Көлемі (млн. теңге)	Айналыс мерзімі (жылдар)	Түрі
1	"Астана-Финанс" АҚ	5 000	5	Ипотекалық
2	"Қазақстан Ипотекалық Компаниясы" АҚ	5 000	5	Ипотекалық
3	Шағын кәсіпкерлікті дамыту қоры" АҚ"	3 000	5	Агенттік
4	"VITA" АҚ	5 000	5	Қамтамасыз етпейтін купонды
5	"Қазақстан Ипотекалық Компаниясы" АҚ	5 000	10	Ипотекалық
6	"Қазақстан Ипотекалық Компаниясы" АҚ	5 000	3	Ипотекалық
7	"Қазақстан Ипотекалық Компаниясы" АҚ	5 000	12	Ипотекалық

Есепті кезеңде жиынтық номиналды құны 33 316 млн. теңге облигациялардың шығарылымдарын орналастыру қорытындылары туралы 17 есеп бекітілді.

2005 жылғы 1 тоқсанда облигацияларды өтеу туралы есептер бекітілген жоқ.

Мемлекеттік емес облигациялардың қолданыстағы шығарылымы туралы деректер

(млн. теңге)

	2005 жылғы 1 қаңтарға	2005 жылғы 1 сәуірге
Шығарылымдардың саны	109	116
Шығарылымның көлемі, млн. теңге	404 752	437 752

2005 жылғы 1 сәуірдегі жағдай бойынша жиынтық номиналды құны 437 752 миллион теңге қолданыстағы шығарылымы бар облигациялар 116 болды, оның ішінде "B" санаты бойынша 8 облигация шығарылымы және 95 шығарылым "A" санаты бойынша KASE ресми тізіміне енгізілген.

Қолданыстағы шығарылымдар қатарында 21 – ипотекалық облигацияның бар екендігін атап өткен жөн:

№ п/п	Заңды тұлғаның атауы	Шығарылымның көлемі (млн. теңге)	Айналыстың ұзақтығы (жыл)
1	"Қазақстан Ипотекалық Компаниясы" АҚ	5 000	10
2	"Қазақстан Ипотекалық Компаниясы" АҚ	5 000	12
3	"Қазақстан Ипотекалық Компаниясы" АҚ	5 000	3
4	"Қазақстан Ипотекалық Компаниясы" АҚ	5 000	5
5	"Астана-Қаржы" АҚ	5 000	5
6	"Банк ЦентрКредит" АҚ	1 300	10
7	"БТА Ипотека" АҚ	2 000	7
8	"Валют-Транзит-Банкі" АҚ	1 400	5
9	"Қазақстан Ипотекалық Компаниясы" АҚ	5 000	10
10	"Қазақстан Ипотекалық Компаниясы" АҚ	5 000	7
11	" ЦентрКредит Банкі " АҚ	500	3
12	"БТА Ипотека" АҚ	1 500	10
13	"Қазақстан Ипотекалық Компаниясы" АҚ	5 000	7
14	"Қазақстан Ипотекалық Компаниясы" АҚ	5 000	5

15	“Қазақстан Ипотекалық Компаниясы” АҚ	5 000	10
16	"Астана-Қаржы" АҚ	1 000	5
17	“Қазақстан Ипотекалық Компаниясы” АҚ	5 000	10
18	"БТА Ипотека" АҚ	500	7
19	“Қазақстан Ипотекалық Компаниясы” АҚ	3 000	10
20	“Қазақстан Ипотекалық Компаниясы” АҚ	1 500	3
21	"ЛАРИБА-БАНК" бірлескен банкі” АҚ	156	3

Тіркелген пайлар шығарылымы туралы деректер

	<i>2005 жылғы 1 тоқсанда</i>
Шығарылымдар тіркелді	4
Шығарылымдар мен орналастыру қорытындылары туралы есептер бекітілді	2
Қолданыстағы шығарылымдар	6

Қазақстан Республикасының¹ аумағында айналыста болып табылатын мемлекеттік бағалы қағаздар

(млн. тенге)

	2005 жылғы 1 қаңтарда	2005 жылғы 1 сәуірде
Айналыстағы барлығы, оның ішінде:	635 345	677 606
Ұлттық Банктің ноттары	396 121	383 637
Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	230 471	285 200
жергілікті атқару органдарының бағалы қағаздары	8 753	8 769

Бағалы қағаздар² рыногының биржалық және биржалық емес негізгі көрсеткіштері

Бұрынғыдай, Қазақстандағы қор рыногы жағдайының негізгі индикаторы KASE – бір қор биржасы 2005 жылғы 1 қаңтарда ұсынған ұйымдастырылған рынок болып табылады.

Есепті кезеңде бағалы қағаздары “А” ресми тізімдері бойынша KASE-ге сауда-саттыққа жіберілген қазақстандық эмитенттер санының өсуі жалғасуда.

2005 жылғы 1 сәуірдегі “А” санатты бағалы қағаз сауда-саттығын ұйымдастырушылардың тізімінің 57,58%-і екінші деңгейдегі банктердің бағалы қағаздар шығарылымынан тұрды.

KASE-ге айналысқа жіберілген бағалы қағаздар шығарылымының негізгі үлес салмағы “В” санаты бойынша (24,32%) болғанда, “А” санаты бойынша (75,68%) бағалы қағаздардың шығарылымына келді. 2005 жылғы 1 сәуірдегі жағдай бойынша “А” санаты бойынша KASE ресми тізіміне енгізілген корпоративтік облигация және акция шығарылымының саны “В” санаты бойынша 45 және 37 шығарылым болғанда, тиісінше 95 және 8 болды.

КASE-гі сауда-саттыққа жіберілген бағалы қағаздар

	2005 жылғы 1 қаңтарға		2005 жылғы 1 сәуірге	
	шығарылымда рдың саны	эмитенттердің саны	шығарылымда рдың саны	эмитенттердің саны
“А” листингі	132	49	140	47
“В” листингі	42	32	45	32
Жиынтығы:	174	81	185	79

Мемлекеттік емес бағалы қағаздармен жасалатын КASE-гі мәмілелердің көлемі

(млн. тенге)

	2004 жылғы 4 тоқсанда.	2004 жылғы 1тоқсанда
"А" ресми тізімі бойынша оның ішінде:	114 268	122 669
бастапқы орналастырулар:	5 671	2 416
– акциялар бойынша	0	0
– облигациялар бойынша	5 671	2 416
қайталама айналыс:	50 622	49 523
– акциялар бойынша	27 011	9 455
– облигациялар бойынша	23 611	40 068
"репо" мәмілелері:	57 975	70 730
– акциялар бойынша	29 585	34 106
– облигациялар бойынша	28 390	36 624
"В" ресми тізімі бойынша оның ішінде:	5 415	5 810
бастапқы орналастырулар:	150	0
– акциялар бойынша	–	0
– облигациялар бойынша	150	0
қайталама айналыс:	4 343	3 193
– акциялар бойынша	2 411	1 109
– облигациялар бойынша	1 932	2 084
"репо" мәмілелері:сделки "репо":	923	2 617
– акциялар бойынша	840	2544
– по акциям		
– облигациялар бойынша	83	73
"Листингтік емес бағалы қағаздар" секторы бойынша	103	190
Жиынтығы:	119 786	128 669

2005 жылғы 1 тоқсанда мемлекеттік емес бағалы қағаздармен жасалатын мәмілелер көлемі 2004 жылғы 4 тоқсанмен салыстырғанда 7,42%-ке өсті. “А” санатының ресми тізіміне енгізілген бағалы қағаздармен жасалған мәмілелердің көлемі - 7,35%, ал “В” санаты бойынша - 7,29% болды, сонымен қатар "Листингтік емес бағалы қағаздар" секторында жасалатын мәмілелердің көлемі 84,47%-ке айтарлықтай ұлғайғаныны көреміз.

КASE-де жасалған мәмілелердің негізгі үлес салмағы (95,34%) бұрынғыша “А” санатының ресми тізімі бойынша КASE-дегі сауда-саттыққа жіберілген мемлекеттік емес бағалы қағаздарға келеді. Осы дерек ЖЗҚ-ның, банктердің және сақтандыру (қайта сақтандыру) ұйымдарының бағалы қағаздар рыногы негізгі инвесторларының активтері “А” санаты бойынша КASE ресми тізіміне енгізілген эмитенттердің бағалы қағаздарына орналастыруға жататындығының нәтижесі болып табылады.

Мемлекеттік бағалы қағаздармен жасалған

KASE-гі мәмілелердің көлемі

(млн. теңге)

	2004 жылғы 4 тоқсанда	2005 жылғы 1- тоқсанда
Мәмілелердің көлемі оның ішінде:	1 952 585	1 894 551
бастапқы орналастырулар	0	56 967
“репо” мәмілелері	1 747 782	1 727 939

2005 жылғы 1 тоқсанда ұйымдастырылған рыноктағы мемлекеттік бағалы қағаздар бойынша биржалық мәмілелердің көлемі 2004 жылғы 4 тоқсанмен салыстырғанда 2,97%-ке кеміді, сонымен қатар репо" мәмілелерінің көлемі 1,14%-ке кеміді және мемлекеттік бағалы қағаздармен жасалатын мәмілелердің жалпы көлемінің 91,21%-ін құрады.

2005 жылғы 1 тоқсанда бағалы қағаздардың ұйымдастырылмаған рыногында мемлекеттік емес бағалы қағаздармен жасалған мәмілелердің көлемі

(млн. теңге)

	Мәмілелердің көлемі (дана)	Мәмілелердің көлемі
Барлығы:	61	19 043
оның ішінде:		
облигация бойынша	52	19 030
акция бойынша	9	13

2005 жылғы 1 тоқсанда ұйымдастырылмаған бағалы қағаздар рыногында жасалған мәмілелердің көлемі 19 043 млн. теңге болды, сонымен қатар жасалған мәмілелердің негізгі көлемі облигацияға келді, бұл жалпы көлемнің 99,93%-ін құрады.

Листингтің санаты	2005 жылғы 1 қаңтарда		2005 жылғы 1 сәуірде	
	акциялар	облигациялар	акциялар	облигациялар
“А” санаты	379 518	676 652	420 772	808 826
“В” санаты	132 769	9 207	132 123	9 294
Жиынтығы:	512 287	685 859	552 895	818 120
Барлығы:	1 198 146		1 371 015	

2005 жылғы 1 сәуірдегі жағдай бойынша “А” және “В” санаты бойынша ресми тізіміне енгізілген мемлекеттік емес бағалы қағаздар бойынша рынокты жалпы капиталдандыру 1 371 015 млн. теңге болды, осы көрсеткіш 2005 жылғы 1 қаңтардағы ұқсас көрсеткішпен салыстырғанда 14,43%-ке өсті. Сонымен қатар облигация бойынша капиталдандыру 19,28%-ке, қор рыногын капиталдандыру 7,93%-ке өсті.

Бағалы қағаздар рыногындағы инвесторлар.

2005 жылғы 1 сәуірдегі жағдай бойынша ЗАИБЖАҰ инвестициялық басқаруында болып табылатын зейнетақы активтерінің жиынтық көлемі есепті тоқсанда 35 110 млн. теңгеге немесе 7,25%-ке өсіп, 519 525 млн. теңге болды.

2005 жылғы 1 сәуірдегі инвестициялық басқарудағы зейнетақы активтері

ЗАИБЖАҰ /ЖЗҚ	млн. теңге	%-пен в %
"ABN AMRO Asset Management" ЗАИБЖАҰ" АҚ	44 138	8,50
"АБН АМРО - КаспийМұнайГаз" Жинақтаушы зейнетақы қоры" АҚ	37 861	7,29
"Капитал" Жинақтаушы зейнетақы қоры" АҚ	6 277	1,21
"Bailyk asset management" ЗАИБЖАҰ" АҚ	45 096	8,68
"Д.А. Қонаев атындағы ашық үлгідегі мемлекеттік емес жинақтаушы зейнетақы қоры" АҚ	1 532	0,29
"Нефтегаз - ДЕМ" Жинақтаушы зейнетақы қоры" ЖАҚ ЗАО	13 443	2,59
"СЕНІМ" Ашық жинақтаушы зейнетақы қоры" АҚ	22 344	4,30
"Қорғау" Жинақтаушы зейнетақы қоры" АҚ	7 777	1,50
"Premier Asset Management" ЗАИБЖАҰ" АҚ	9 543	1,84
"Отан" Ашық жинақтаушы зейнетақы қоры" АҚ	9 543	1,84
"Актив-Инвест" "ЗАИБЖАҰ" АҚ	22 937	4,41
"Валют-Транзит" жинақтаушы зейнетақы қоры АҚ	22 937	4,41
"АЛЬФА-ТРАСТ" ЗАИБЖАҰ" АҚ	13 768	2,65
"Қазақмыс" Жинақтаушы зейнетақы қоры" АҚ	13 768	2,65
"ЖЕТІСУ" ЗАИБЖАҰ" АҚ	93 240	17,95
"ҰларҮміт" Жинақтаушы зейнетақы қоры" ЖАҚ	93 240	17,95
"НҰРТРАСТ" ЗАИБЖАҰ" АҚ	12 094	2,33
АО "ООИУПА "Нур-Траст"		
"Халық зейнетақы қоры" "АЖЗҚ" АҚ	12 094	2,33
АО "ОНПФ "Народный пенсионный фонд"		
"МЖЗҚ" Жинақтаушы зейнетақы қоры" АҚ	110 286	21,22
"БТА Құрмет-Қазақстан" Жинақтаушы зейнетақы қоры" АҚ	37 526	7,22
"Қазақстан Халық Банкі жинақтаушы зейнетақы қоры" АҚ	130 897	25,20
Зейнетақы активтерінің жиынтығы	519 525	100,00

2005 жылғы 1 сәуірде инвестицияланған зейнетақы активтерінің көлемі есепті тоқсанда 35 572 млн. теңгеге немесе 7,4%-ке өсіп, 516 562 млн. теңге болды.

2005 жылғы 1 сәуірдегі ЖЗҚ жиынтық инвестициялық портфелі

(млн. теңге)

Қаржы құралдары	01.04.2005	жиынтық %-пен
ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары, оның ішінде:	252 519	48,88
ҚР еврооблигациялары	2 549	0,49
Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	117 948	22,83
Ұлттық Банктің ноттары	131 859	25,53
Жергілікті атқарушы органдардың бағалы қағаздары	163	0,03
Екінші деңгейдегі банктердің салымдары	62 692	12,14
Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары	3 402	0,66
Шетел эмитенттерінің мемлекеттік бағалы қағаздары	9 503	1,84
Шетелдік инвестициялық қорлардың паилары	126	0,02
ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде	178 839	34,62
Акциялар	31 429	6,08

Оның ішінде облигациялар	147 410	28,54
АҚШ долларына номинирленген	8 251	1,60
Теңгеге номинирленген	139 159	26,94
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес бағалы қағаздары	9 481	1,84
Акциялар	7 211	1,40
Облигациялар	2 270	0,44
жиынтығы	516 562	100,00

Келтірілген деректерден көріп отырғанымыздай, мемлекеттік бағалы қағаздар үлесі ЖЗҚ жиынтық инвестициялық портфелінде елеулі орын алып отыр және 252 519 млн теңгені немесе 48,88%-ті құрайды, сонымен қатар осы бағалы қағаздар көлемі 2005 жылғы 1 тоқсанда 6 906 млн. теңгеге немесе 2,66%-ке кеміді.

Қазақстан Республикасының эмитенттері корпоративтік бағалы қағаздар көлемі есепті тоқсан ішінде 16,69%-ке өсіп, 178 839 млн. теңге немесе 30,62% болды, Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктеріндегі салымдардың көлемі 62 692 млн. теңге немесе 12,14% болды.

ЗАЙБЖАҰ екінші деңгейдегі банктердегі зейнетақы активтерінің салымдарын тек қана ұлттық валютада жүзеге асыратынын айта кетуіміз керек.

2005 жылғы 1 сәуірдегі жағдай бойынша халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздарының үлесіне 0,66% келеді. Шетел эмитенттерінің мемлекеттік бағалы қағаздарының үлесі 9 503 млн. теңге, ал шетел эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздарының көлемі - 9 481 млн. теңге болды.

Меншікті активтердің есебінен алынған ЖЗҚ жиынтық инвестициялық портфелі

Қаржы құралдары	(млн. тенге)	
	01.04.2005	жиынтық %-пен
ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары, оның ішінде:	3 306,6	47,23
ҚР еурооблигациялары		
Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	1 572,8	22,46
Ұлттық Банктің ноттары	1 733,8	24,76
жергілікті атқару органдарының бағалы қағаздары		
Екінші деңгейдегі банктердегі салымдар	1 483,5	21,19
Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары		
Шетел эмитенттерінің мемлекеттік бағалы қағаздары		
Шетел инвестициялық қорларының пайлары		
ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	2 211,6	31,58
Акциялар	328,8	4,70
Оның ішінде облигациялар	1 882,8	26,89
АҚШ долларына деноминирленген		
Теңгеге номиналданған		
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес бағалы қағаздары		
Акциялар		
Облигациялар		
Жиынтығы:	7 001,7	100,0

ҚР мемлекеттік бағалы қағаздарының үлесі жинақтаушы зейнетақы қорларының жиынтық меншікті портфелінің ең үлкен көлемін - 3 306,6 млн. теңгені құрды. Портфельдің үштен бірінен көбін ҚР эмитенттерінің корпоративті бағалы қағаздары (31,58%) және екінші деңгейдегі банктерге орналастырылған меншікті активтері 21,19 % құрды.

2005 жылғы 1 тоқсанға мемлекеттік бағалы қағаздардың өсуі 14,6%, ҚР мемлекеттік емес бағалы қағаздар – 6,88%, салымдар - 46,1% құрады.

2005 жылғы 1 сәуірдегі сақтандыру ұйымдарының инвестициялық портфелінің құрылымы

(млн. тенге)

Қаржы құралдары	01.04.2005	жиынтық %-пен
ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары, оның ішінде:	19 135	51,0
- ҚР еурооблигациялары -	216	0,5
- Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары -	12 707	33,9
- Ұлттық Банктің ноттары -	6 193	16,5
- жергілікті атқару органдарының бағалы қағаздары -	19	0,1
Екінші деңгейдегі банктердегі салымдар	8 018	21,4
Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары		
Шетел мемлекеттерінің бағалы қағаздары		
ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	10 330	27,6
- акциялар	2 216	5,9
- облигациялар	8 114	21,6
Шетел эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:		
- акциялар		
- облигациялар		
Жиынтығы:	37 483	100,0

2005 жылғы 1 сәуірде СҰ жиынтық инвестициялық портфелінің көлемі есепті тоқсанда 3 322 млн. тенгеге немесе 9,72% -ке өсіп, 37 483 млн. теңгені құрады. Қазақстан Республикасы эмитенттерінің корпоративтік бағалы қағаздар үлесі 27,6%-ті, екінші деңгейдегі банктердегі салымдардың үлесі - 21,4%-ті құрағанда, Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздарының СҰ жиынтық инвестициялық портфеліндегі үлесі 51,0% болды.

2005 жылғы 1 сәуірдегі екінші деңгейдегі банктердің инвестициялық портфелінің құрылымы

(млн. тенге)

Қаржы құралдары	01.04.2005	жиынтық %-пен
ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары, оның ішінде:	419 078	61,0
- ҚР еурооблигациялары еврооблигация РК	38 364	5,6
- Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	107 031	15,6
- Ұлттық Банктің ноттары	270 540	39,3
- жергілікті атқару органдарының бағалы қағаздары	3 143	0,5
Екінші деңгейдегі банктердегі салымдар	78 841	11,5
Шетел мемлекеттерінің бағалы қағаздары	31 763	4,6
ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	43 668	6,3
акциялар	3 470	0,5
облигациялар	40 198	5,8
Шетел эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	5 382	0,8
-акциялар	0	0
облигациялар	5 382	0,8

Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары	108 520	15,8
Жиынтығы:	687 252	100

Екінші деңгейдегі банктердің жиынтық инвестициялық портфельінің құрылымы 2005 жылғы 1 тоқсанда 137 918 немесе 25,11%-ке өсті және 687 252 млн. теңгені құрады.

ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары портфельдің 60%-ке жуығын немесе 419 078 млн. теңгені құрап отыр.

ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздарының және екінші деңгейдегі банктердегі салымдарға тиісінше 6,3% және 11,5% келеді. Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары жиынтық портфельдің 15,8 %-ін, шетел эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары 0,8% құрайды.

2005 жылғы 1 сәуірдегі бағалы қағаздар рыногының кәсіби қатысушыларының инвестициялық портфельінің құрылымы.

(млн. тенге)

Қаржы құралдары	01.04.2005	жиынтық %-пен
ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары, оның ішінде:	1 709	20,36
-ҚР еурооблигациялары		
Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	1 307	15,57
Ұлттық Банктің ноттары	386	4,60
жергілікті атқару органдарының бағалы қағаздары	16	0,19
Екінші деңгейдегі банктердегі салымдар	313	3,73
Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары		
Шетел эмитенттерінің мемлекеттік бағалы қағаздары		
ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	6 371	75,91
акции	3 402	40,54
облигациялар	2 969	35,37
Шетел эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:		
акциялар		
облигациялар		
Жиынтығы:	8 393	100,00

2005 жылғы 1 сәуірдегі жағдай бойынша инвестициялық портфельдің жиынтық көлемі бұрынғыша қазақстандық қаржы құралдарынан тұрды, есепті тоқсанда 1 483 млн. теңгеге немесе 15%-ке кеміді және 8 393 млн. теңгені құрады. ҚР мемлекеттік бағалы қағаздарының үлесіне 20,36%, корпоративті бағалы қағаздарға - 75,91%, қазақстандық банктегі салымдар - 3,73% келеді.

¹Ақпарат Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкінің деректері бойынша ұсынылды;

¹Ақпарат Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкінің деректері бойынша ұсынылды;

² Биржа нарығы жөніндегі ақпарат KASE деректері бойынша ұсынылды;

² Биржа нарығы жөніндегі ақпарат KASE деректері бойынша ұсынылды;

¹ Информация представлена по данным Национального Банка Республики Казахстан;

² Информация по биржевому рынку представлена по данным KASE.