

**Қазақстан Республикасының бағалы қағаздар нарығының
2012 жылғы 1 қазандағы ағымдағы жағдайы**

Институционалды инфрақұрылым

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

	1.07.11 жылға	1.10.11 жылға	1.01.12 жылға	1.04.12 жылға	1.07.12 жылға	1.10.12 жылға
Оның ішінде барлық брокерлер–дилерлер:	76	73	73	72	66	65
банктер	24	24	24	24	24	24
олардың I -санаттағысы	22	22	22	22	22	22
банктік емес ұйымдар	47	44	44	43	38	37
олардың I -санаттағысы	39	36	36	35	30	28
АӨҚО қатысушылары	5	5	5	5	4	4
Тіркеушілер	10	10	10	10	10	10
Кастодиандар	10	10	10	10	10	10
ЖЗҚ зейнетақы активтерін инвестициялық басқарушылар	16	14	14	13	13	13
Инвестициялық портфельді басқарушылар, оның ішінде:	38	34	33	33	32	33
инвестициялық компаниялар	2	0	0	0	0	0
ӨӨРУ	2	2	2	2	2	2
Трансфер-агенттер	3	3	3	3	2	2
Бағалы қағаздармен сауда- саттықты ұйымдастырушы	1	1	1	1	1	1
Оның ішінде барлық брокерлер–дилерлер:	0	0	0	0	0	1

2012 жылғы үшінші тоқсанда инвестициялық портфельді басқаруға 1 лицензия ("JAZZ CAPITAL" брокерлік үйі" АҚ) және номиналды ұстаушы ретінде клиенттер шоттарын жүргізу құқығымен брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыруға 1 лицензия ("Нұрбанк" АҚ ЕҰ"Атамекен" ЖЗҚ" АҚ) берілген. Сонымен қатар, номиналды ұстаушы ретінде клиенттер шоттарын жүргізу құқығымен брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыруға берілген 1 лицензияның (Секьюритиз (Қазақстан) ЕБ» АҚ) қолданылуы тоқтатылды. Сондай-ақ есепті тоқсанда 1 ұйым ("Premier Capital" АҚ) номиналды ұстаушы ретінде клиенттер шоттарын жүргізу құқығымен брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыруға берілген лицензиясынан айрылды.

Одан басқа «Қазақстан Республикасының кейбір заңнамалық актілеріне банк қызметін және қаржы ұйымдарын тәуекелдерді азайту тұрғысынан реттеу мәселелері бойынша өзгерістер мен толықтырулар енгізу туралы» ҚР Заңына сәйкес нарықта 1 бірегей тіркеуші қызмет етеді.

(млн. теңге)

	1.07.12 жылға	1.10.12 жылға	2012 жылғы ІІІ тоқсандағы өзгеруі, %-бен

Жиынтық активтер*, оның ішінде:	94 033	96 195	2,3
брокерлер-дилерлер қатысушылары) (АӨҚО)	6 470	3 171	-51,0
тіркеушілер	1 457	1 422	-2,4
ИПБ	80 579	85 526	6,1
инвестициялық компаниялар ЗАИБЖАҰ	5 527	6 076	9,9
Міндеттемелер, оның ішінде:	1 332	686	-48,5
брокерлер-дилерлер қатысушылары) (АӨҚО)	31	64	2 раза
тіркеушілер	18 564	21 782	17,3
ИПБ	397	420	5,8
инвестициялық компаниялар ЗАИБЖАҰ	73 709	73 243	-0,6
Капитал, оның ішінде:	1 426	1 358	-4,8
брокерлер-дилерлер қатысушылары) (АӨҚО)	62 015	63 744	2,8
тіркеушілер	5 130	5 656	10,3
ИПБ	93 436	93 255	-0,2
инвестициялық компаниялар ЗАИБЖАҰ	4 463	1 937	-56,6
Жарғылық капитал, оның ішінде:	79 358	81 313	2,5
брокерлер-дилерлер қатысушылары) (АӨҚО)	8 620	8 620	0,0

Эмитенттер және қаржы құралдары

Акциялар шығарылымы

Акциялар шығарылымы және шығарылымдарды жою туралы деректер

	2011 жылғы 3-тоқсанда	2011 жылғы 4-тоқсанда	2012 жылғы 1-тоқсанда	2012 жылғы 2-тоқсанда	2012 жылғы 3-тоқсанда
Шығарылымдар тіркелді	8	7	11	17	14
Шығарылым және орналастыру қорытындысы туралы есептер	169	219	189	214	164
Шығарылымдар жойылды	11	14	16	14	238

Есепті күнде қолданыстағы акциялар шығарылымы бар акционерлік қоғамдардың жалпы саны 1918 құрады. 2012 жылғы III тоқсанда 181 акциялар шығарылымы (оның ішінде шығарылымдар проспектілеріне енгізілген өзгерістер) тіркелді, акциялардың шығарылымы және орналастыру қорытындысы туралы 164 есеп бекітілді, сондай-ақ 238 акциялар шығарылымы жойылды.

* ЕДБ қоспағанда қаржылық көрсеткіштер бойынша ақпарат

Тіркелген мемлекеттік емес облигациялар шығарылымы туралы деректер

	2011 жылғы 3-тоқсанда	2011 жылғы 4-тоқсанда	2012 жылғы 1-тоқсанда	2012 жылғы 2-тоқсанда	2012 жылғы 3-тоқсанда
Шығарылымдар саны	7	10	1	8	0
Шығарылымдар көлемі, млн. теңгемен	84 560	151 347	5 000	76 000	0

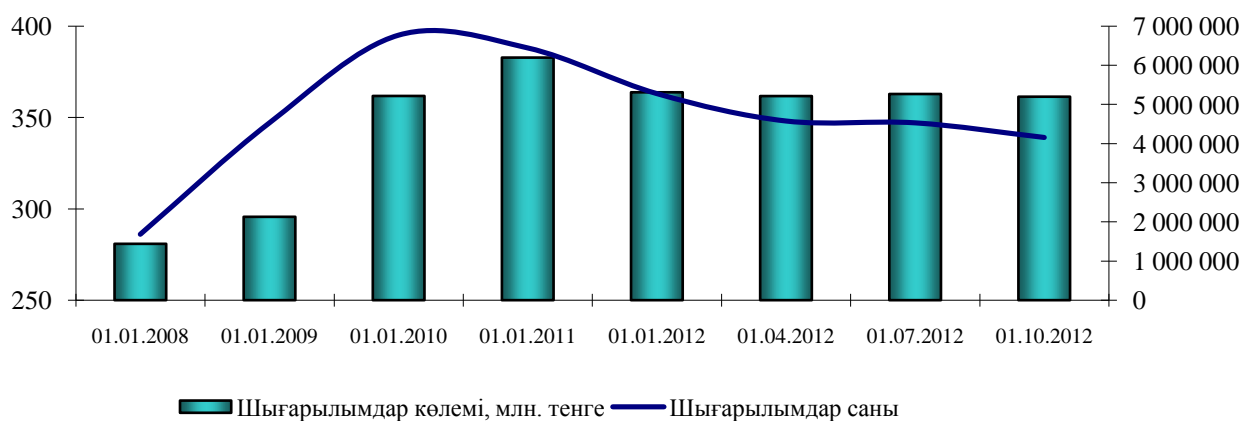
Комитет 2012 жылғы үшінші тоқсан ішінде мемлекеттік емес облигациялар тіркелмеді.

Мемлекеттік емес облигациялардың қолданыстағы шығарылымы туралы деректер

	2011 жылғы 1 қазанда	2012 жылғы 1 қаңтарда	2012 жылғы 1 сәуірде	2012 жылғы 1 шілдеде	2012 жылғы 1 қазанда
Шығарылымдар саны	361	363	348	347	339
Шығарылымдар көлемі, млн. теңгемен	5 195 826	5 309 673	5 213 423	5 266 314	5 197 277

2012 жылғы 1 қазандағы жағдай бойынша жиынтық номиналды құны 5 197 277 млн. теңгені құрайтын қолданыстағы облигациялар шығарылымының саны 339 болды, олардың ішінде рейтингтік бағасы бар 134 шығарылымы, 68 шығарылымы – бірінші шағын санаттың рейтингтік бағасы жоқ, 19 шығарылымы – екінші шағын санаттың рейтингтік бағасы жоқ және 12 шығарылымы – буферлік санатты KASE ресми тізіміне енгізілген.

Қолданыстағы облигациялар шығарылымдарының саны мен көлемінің өзгеру динамикасы

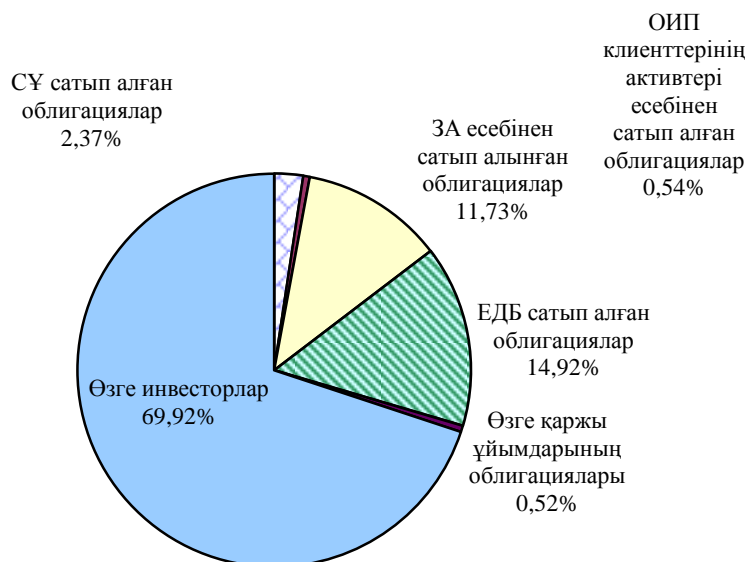


2012 жылғы 1 қазандағы жағдай бойынша корпоративті облигациялардың қолданыстағы шығарылымдарының жиынтық көлемі былайша көрініс алады:

- зейнетақы активтері есебінен сатып алынған облигациялар – 11,73%;
- екінші деңгейдегі банктер сатып алған облигациялар – 14,92%;
- инвестициялық портфельді басқарушы клиенттердің активтері есебінен сатып алынған облигациялар – 0,54%;
- сақтандыру (қайта сақтандыру) ұйымдары сатып алған облигациялар – 2,37%;
- өзге қаржы ұйымдары сатып алған облигациялар – 0,52%;

–өзге инвесторлар – 69,92%.

1.10.2012 жылғы ҚР корпоративті облигацияларының қолданыстағы шығарылымдарының жиынтық көлеміндегі инвесторлармен сатып алынған облигациялар үлесі



ҚР корпоративтік облигацияларының қолданыстағы шығарылымдарының жиынтық көлеміндегі 69,9%-ы кәсіби емес инвесторлардың үлесіне тиеді. Институционалды инвесторлар–облигацияларды ұстаушылардың (ОИП және ЗА клиенттерінің активтері) Қазақстан Республикасының аумағында шығарылған облигациялардың жалпы көлеміндегі үлес салмағы 12,3% болды.

Тіркелген пайлар шығарылымдары туралы деректер

	2011 жылғы 3-тоқсанда	2011 жылғы 4-тоқсанда	2012 жылғы 1-тоқсанда	2012 жылғы 2-тоқсанда	2012 жылғы 3-тоқсанда
Шығарылымдар тіркелді	0	3	0	0	0
Шығарылым және орналастыру қорытындысы туралы есептер	25	22	22	18	18
Шығарылымдар жойылды	152	152	148	146	127

2012 жылғы 1 қазанда қолданыстағы пайлар шығарылымының саны 127 болды. Бұл ретте 2012 жылғы шілде-қазан айларында шығарылым мен орналастыру қорытындылары туралы 18 есеп бекітілді және 19 шығарылым өтелді.

Қазақстан Республикасының аумағында айналыста

болатын мемлекеттік бағалы қағаздар*

(млн. теңге)

	2011 жылғы 1 қазанда	2012 жылғы 1 қаңтарда	2012 жылғы 1 сәуірде	2012 жылғы 1 шілдеде	2012 жылғы 1 қазанда
Айналыста барлығы, оның ішінде	2 659 131	2 590 035	2 745 137	2 826 021	2 961 317
Ұлттық Банктің ноттары	742 568	509 805	535 980	449 496	414 906
Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	1 916 563	2 080 229	2 209 157	2 376 525	2 546 410
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 сәуірде 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:	94	70
"Борыштық бағалы қағаздар" секторы:	233	67
"Инвестициялық қорлардың бағалы қағаздары" секторы:	2	2
"Депозитарлық қолхаттар" секторы:	0	0
"Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары" секторы:	1	1
"Мемлекеттік бағалы қағаздар" секторы:	199	3
"Туынды бағалы қағаздар" секторы:	0	0
"Баламалы алаң"	0	0
Жиынтығы:	529	115

KASE айналымына жіберілген бағалы қағаздардың негізгі үлес салмағы борыштық бағалы қағаздарға – 44,0% (233 шығарылым) келеді. Акциялар және мемлекеттік бағалы қағаздары секторы бойынша тиісінше 17,8% (94 шығарылым) және 37,6% (199 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.

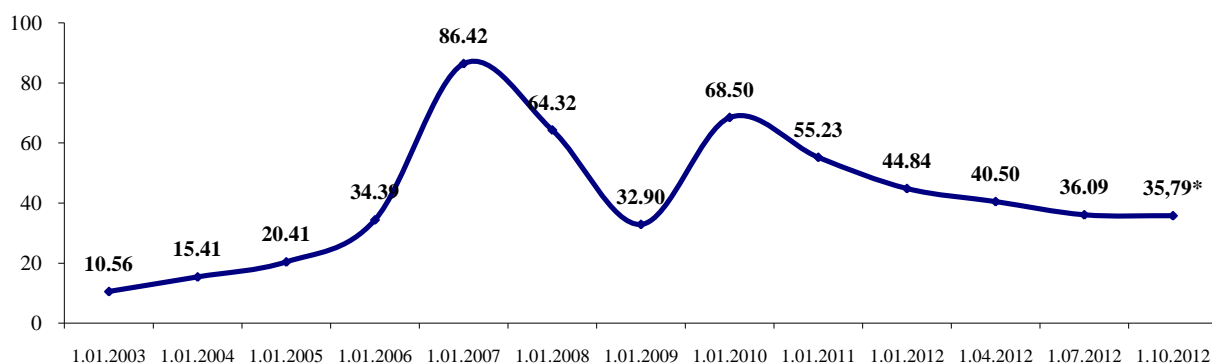
Мемлекеттік емес бағалы қағаздар бойынша KASE жалпы капиталдандыру 11 253 643 млн. теңгені немесе ЖІӨ-ден 35,8% құрады. 2012 жылғы 1 шілдедегі жағдай бойынша осындай көрсеткіш 11 349 384 млн. теңгені немесе ЖІӨ-ден 36,1% құрады.

* Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің деректері бойынша ұсынылған ақпарат

** Биржа нарығы жөніндегі ақпарат KASE деректері бойынша ұсынылған

Осылайша, қор нарығын капиталдандырудың абсолюттік көріністегі азаюы да, сондай ЖІӨ-ге қатысты қор нарығын капиталдандыру көрсеткішінің азаюы да байқалады.

ЖІӨ-ге KASE-тің капиталдандырылуы *



* ҚР экономикалық даму және сауда министрлігі ресми сайтының деректері (31 442,7 млрд.тенге)

KASE-тегі мемлекеттік емес бағалы қағаздармен жасалған мәмілелер көлемі

(млн. тенге)

	2011 жылғы 4- тоқсанда	2012 жылғы 1- тоқсанда	2012 жылғы 2- тоқсанда	2012 жылғы 3- тоқсанда
бастапқы орналастыру:	3 501	17 877	14 111	35 868
– "Акциялар" секторы бойынша	0	3 923	0	0
– "Борыштық бағалы қағаздар" секторы бойынша	3 501	13 954	14 111	35 868
– "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:	82 574	74 070	165 024	76 997
– "Акциялар" секторы бойынша	21 513	11 216	117 450	23 257
– "Борыштық бағалы қағаздар" секторы бойынша	57 840	62 800	47 432	53 680
– "Инвестициялық қорлардың бағалы қағаздары" секторы бойынша	274	54	142	60
– "Депозитарлық қолхаттар" секторы бойынша	0	0	0	0
– "Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары" секторы бойынша	0	0	0	0
– "Туынды бағалы қағаздар" секторы бойынша	2 947	0	0	0

секторы бойынша				
"Листингтік емес бағалы қағаздар" секторы	706	11	41	62
"репо" мәмілелері:	18 720	26 753	26 354	30 348
– "Акциялар" секторы бойынша	15 822	20 676	22 436	20 745
– "Борыштық бағалы қағаздар" секторы бойынша	2 898	6 077	3 918	9 603
– "Инвестициялық қорлардың бағалы қағаздары" секторы бойынша	0	0	0	0
– "Депозитарлық қолхаттар" секторы бойынша	0	0	0	0
– "Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары" секторы бойынша	0	0	0	0
– "Туынды бағалы қағаздар" секторы бойынша	0	0	0	0
– "Листингтік емес бағалы қағаздар" секторы	0	0	0	0
Жиынтығы	105 501	118 711	205 530	143 275

Кестеде келтірілген деректерден көрініп отырғандай, 2012 жылдың үшінші тоқсанында мемлекеттік емес бағалы қағаздармен жасалған мәмілелер көлемі 30,3%-ға азайды.

KASE-тегі мемлекеттік бағалы қағаздармен жасалған мәмілелер көлемі

(млн. теңге)

	2011 жылғы 3-тоқсанда	2011 жылғы 4-тоқсанда	2012 жылғы 1-тоқсанда	2012 жылғы 2-тоқсанда	2012 жылғы 3-тоқсанда
Мәмілелер көлемі, оның ішінде:	7 904 954	5 948 927	5 589 825	5 664 216	6 018 305
бастапқы орналастырулар	170 912	216 505	190 803	244 811	224 093
"репо" мәмілелері	7 591 643	5 664 077	5 328 790	5 337 925	5 757 833

Мемлекеттік бағалы қағаздар бойынша биржалық мәмілелер көлемі ұйымдастырылған нарықта ағымдағы жылдың 3-тоқсанында 6,3%-ға төмендеді. Бастапқы орналастыру көлемі 8,5%-ға азайды. Мемлекеттік бағалы қағаздармен жасалған мәмілелердің жалпы көлеміндегі "репо" көлемі 7,9%-ға азайды.

Зейнетақы активтерінің жиынтық көлемін бөлу

(млн.теңге)

Ресми тізім секторы	2011 жылғы 1 қазанда	2012 жылғы 1 қаңтарда	2012 жылғы 1 сәуірде	2012 жылғы 1 шілдеде	2012 жылғы 1 қазанда
"Акциялар" секторы:	6 214 033	6 425 940	6 837 355	5 421 602	5 260 665
"Борыштық бағалы қағаздар" секторы	6 038 463	5 936 540	5 893 801	5 927 782	5 992 978

"Инвестициялық қорлардың бағалы қағаздары" секторы	1 472	1 840	1 779	0	-
"Депозитарлық қолхаттар" секторы	0	0	0	0	-
"Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары" секторы	0	0	0	0	-
"Мемлекеттік бағалы қағаздар" секторы	2 668 388	2 577 656	2 877 773	2 840 698	2 887 268
"Туынды бағалы қағаздар" секторы	0	0	0	0	-
Жиынтығы	14 922 356	14 941 976	15 610 708	14 190 082	14 140 911

Кестеде келтірілген деректерден көрініп отырғандай, KASE ресми тізіміне кіргізілген мемлекеттік бағалы қағаздар бойынша нарықты жалпы капиталдандыру 2012 жылғы 1 шілдедегі жағдай бойынша 2012 жылғы 1 қазандағы көрсеткішпен салыстарғанда 0,3%-ға азайды.

Бағалы қағаздар нарығындағы инвесторлар Инвестициялық басқарудағы зейнетақы активтері

2011 жылғы 1 қазандағы жағдай бойынша ЗАИБЖАҰ-ның инвестициялық басқаруындағы зейнетақы активтерінің жиынтық көлемі 2012 жылдың 3-тоқсанында 2 150,9 млрд. теңгеге немесе 5,2%-ға өсіп, 3 041,7 млрд. теңге болды.

Зейнетақы активтерінің орташа айлық өсімі 2011 жылғы 1 қазаннан бастап 2012 жылғы 1 қазанға дейінгі кезеңде 43,0 млрд. теңге болды.

Зейнетақы активтерінің жиынтық көлемін бөлу

ЗАИБЖАҰ/ ЗЖҚ	зейнетақы активтері	
	млн. теңге	%-бен
«Қазақстан Халық Банкі ЖЗҚ» АҚ, «Қазақстан Халық Банкі» АҚ ЕҰ	1 004 488	33,0
«ГНПФ» ЖЗҚ» АҚ»	586 882	19,3
«ҰларҮміт» ЖЗҚ» АҚ»	394 037	13,0
«ГРАНТУМ» ЖЗҚ» АҚ («Казкоммерцбанк» АҚ ЕҰ)	289 499	9,5
"Астана" ЖЗҚ" АҚ	190 029	6,2
«Капитал» ЖЗҚ» АҚ - «Банк ЦентрКредит» АҚ еншілес ұйымы	175 274	5,8
"МұнайГаз-Дем" ЖЗҚ" АҚ	133 771	4,4
"Нұрбанк" АҚ ЕҰ "Атамекен "ЖЗҚ" АҚ	89 936	3,0
«Отан» АЖЗҚ» АҚ	82 195	2,7
«РЕСПУБЛИКА» ЖЗҚ» АҚ	76 591	2,5
"Индустриалды Қазақстан" ЖЗҚ" АҚ	18 988	0,6
Барлық ЖЗҚ бойынша жиынтығы	3 041 690	100

2012 жылдың 3-тоқсанында инвестицияланған зейнетақы активтерінің көлемі 151,2 млрд. теңгеге немесе 5,3%-ға өсіп, 2012 жылғы 1 қазанда 2 998,9 млрд. теңге болды.

Жинақтаушы зейнетақы қорларының инвестициялық портфеліндегі ҚР эмитенттерінің мемлекеттік бағалы қағаздарының үлесі инвестицияланған зейнетақы

активтерінің жалпы көлемінен 50,1%-ды (1 502,0 млрд. теңге) құрайды және 2012 жылғы 1 шілдедегі жағдай бойынша осындай көрсеткішке қатысты 25,2 млрд. теңгеге артты. ҚР мемлекеттік емес бағалы қағаздардың үлесі 2012 жылғы 1 қазандағы жағдай бойынша инвестицияланған зейнетақы активтерінің жалпы көлемінен 26,2%-ды (786,4 млрд. теңге) құрады.

ЖЗҚ-ның жиынтық инвестициялық портфелі

Қаржы құралдары	1.07.2012ж.		1.10.2012ж.	
	млн. теңге	%	млн. теңге	%
ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары, оның ішінде	1 476 755	51,9	1 501 976	50,1
Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	1 297 546	45,6	1 349 097	45,0
Ұлттық Банктің ноттары	173 616	6,1	147 386	4,9
орталық атқарушы органдардың бағалы қағаздары	5 593	0,2	5 493	0,2
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес бағалы қағаздары	154 599	5,4	146 328	4,9
акциялар	24 471	0,8	26 056	0,9
облигациялар	130 128	4,6	120 272	4,0
Шетелдік инвестициялық қорлардың пайлары	63 603	2,2	61 491	2,0
Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары	83 925	2,9	112 207	3,7
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік бағалы қағаздары	109 890	3,9	115 619	3,9
Тазартылған алтын	722 764	25,4	786 350	26,2
ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде	134 526	4,7	144 289	4,8
акциялар	588 238	20,7	642 061	21,4
облигациялар оның ішінде:	43 965	1,6	74 888	2,5
шетелдік валютада номинирленген	544 273	19,1	567 173	18,9
теңгемен номинирленген	236 101	8,3	274 915	9,2
Жиынтығы	2 847 637	100	2 998 886	100

Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктеріндегі салымдар көлемі ағымдағы жылдың 3-тоқсанында 16,4%-ға азайып, 274,9 млрд. теңге болды.

Эмитенттері бағалы қағаздар шығарылымдары бойынша дефолтқа жол берген бағалы қағаздардың үлесі 2012 жылғы 1 қазандағы зейнетақы активтерінің жалпы көлемінен 0,7%-ды құрады, бұл абсолютті мән бойынша 16,4 млрд. теңге болды.

2012 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:	41 021	47,6
ҚР еурооблигациялары	0	0,0

Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	40 028	46,4
Ұлттық Банктің ноттары	993	1,2
жергілікті атқарушы органдардың бағалы қағаздары	0	0,0
Екінші деңгейдегі банктердегі салымдар	25 512	29,6
Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары	147	0,2
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік бағалы қағаздары	718	0,8
Шетелдік инвестициялық қорлардың пайлары	0	0,0
ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	15 384	17,8
акциялар	389	0,4
облигациялар	14 995	17,4
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	601	0,7
акциялар	0	0,0
облигациялар	601	0,7
"Кері РЕПО" операциялары	2 813	3,3
Жиынтығы:	86 196	100

2012 жылғы 1 қазанда жинақтаушы зейнетақы қорларының жиынтық меншікті портфеліндегі ең көп көлемін ҚР мемлекеттік емес бағалы қағаздары алады – 41 021 млн. теңге (47,6%). Бұл ретте меншікті активтер портфелінің 29,6%-ы екінші деңгейдегі банктердің салымдарына орналастырылған. ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздарының үлесі 17,8% құрады.

Инвестициялық қорлардың саны

	1.07.2011	1.10.2011	1.01.2012	1.04.2012	1.10.2012
Инвестициялық пай қорларының саны, оның ішінде	155	152	152	148	127
ашық	12	12	12	12	11
жабық	118	116	117	113	97
аралық	25	24	23	23	19
Акционерлік инвестициялық қорлардың саны	32	32	32	32	32

Инвестициялық пай қорлары пайшыларының саны

	1.10.2011	1.01.2012	1.04.2012	1.07.2012	1.10.2012
Инвестициялық пай қорлары пайшыларының саны, оның ішінде	1 960	1 944	1 366	1 129	1 147
Занды тұлғалар	78	61	56	51	50
Жеке тұлғалар	1 882	1 883	1 310	1 078	1 097

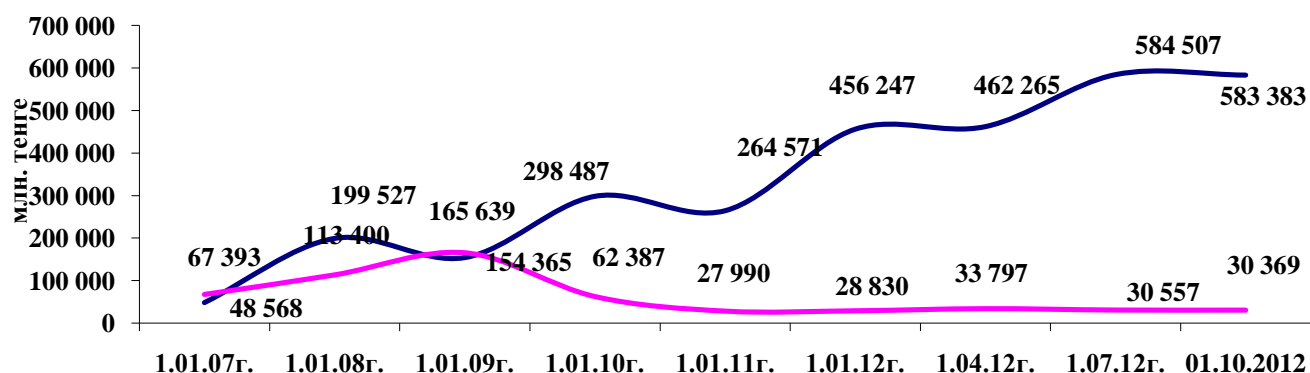
2012 жылғы 1 қазандағы инвестициялық қорлар активтері

2012 жылғы 1 қазандағы жағдай бойынша инвестициялық пай қорының және акционерлік инвестициялық қорлардың жиынтық активтері тиісінше 583 383 млн. теңге және 30 369 млн. теңге болды. 3-тоқсанда инвестициялық пай қорларының активтері 0,2%-ға ұлғайды, акционерлік инвестициялық қорлардың активтері 0,6%-ға өсті.

(млн. теңге)

	2011 жылғы 1 қазанда	2012 жылғы 1 қаңтарда	2012 жылғы 1 сәуірде	2012 жылғы 1 шілдеде	2012 жылғы 1 қазанда
Инвестициялық пай қорларының саны, оның ішінде	450 001	456 247	462 265	584 507	583 383
ашық	447 526	453 920	460 171	582 628	581 453
жабық	624	568	590	577	584
аралық	1 851	1 759	1 504	1 302	1 346
Акционерлік инвестициялық қорлардың саны	28 146	28 830	33 797	30 557	30 369

Инвестициялық қорлар активтерінің өзгеру динамикасы



2012 жылғы 1 қазандағы инвестициялық қорлардың жиынтық инвестициялық портфелі

(млн. теңге)

Қаржы құралдары	Инвестициялық пай қорлары		Акционерлік инвестициялық қорлар	
	млн. теңге	жиынтық қа, %-бен	млн. теңге	жиынтыққа, %-бен
ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары, оның ішінде:	4	0,0	47	0,2
ҚР еурооблигациялары	0	0,0	0	0,0
Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	4	0,0	47	0,2
Ұлттық Банктің ноттары	0	0,0	0	0,0
жергілікті атқарушы органдардың бағалы қағаздары	0	0,0	0	0,0
Екінші деңгейдегі банктердегі	3 631	0,6	120	0,4

салымдар				
Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары	0	0,0	0	0,0
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік бағалы қағаздары	293	0,1	0	0,0
Тазартылған алтын	0	0,0	0	0,0
ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	7 923	1,4	2 807	9,5
акциялар	6 005	1,0	487	1,7
облигациялар	1 918	0,3	2 320	7,9
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	1 905	0,3	110	0,4
акциялар	1 873	0,3	110	0,4
облигациялар	32	0,0	0	0,0
Инвестициялық қорлардың пайлары	19 607	3,4	157	0,5
Депозитарлық қолхаттар	400	0,1	69	0,2
"Кері РЕПО" операциясы	204	0,0	0	0,0
Жер учаскелері	5 118	0,9	695	2,4
Үйлер мен ғимараттар	105	0,0	12 190	41,3
Жылжымайтын мүліктің салынып жатқан және қайта құрастырылып жатқан объектілері	0	0,0	6 111	20,7
Жобалық-сметалық құжаттама	0	0,0	0	0,0
Жерді пайдалану және жер қойнауын пайдалану құқықтары	0	0,0	3 970	13,5
Акционерлік қоғам болып табылмайтын заңды тұлғалардың капиталындағы инвестициялық қордың инвестициялары	525 973	90,5	394	1,4
Туынды қаржы құралдары	2	0,0	0	0,0
Өзге активтер/ дебиторлық берешек	15 796	2,7	2 811	9,5
Жиынтығы:	580 961	100	29 481	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 91,4% (531,2 млрд.теңге) және 79,3% (23,4 млрд.теңге).

ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары инвестициялық пай қорларының инвестициялық портфелінде 1,4%, акционерлік инвестициялық қорлар портфелінде – 9,5%-ды иеленіп отыр. Шетел эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздарының ИПҚ-ның жиынтық портфеліндегі үлесі қомақты емес – 0,3% болса, АИҚ-ның портфелінде - 0,4% болды.

2012 жылғы 1 қазандағы екінші деңгейдегі банктердің инвестициялық портфелінің құрылымы

Қаржы құралдары	млн. теңге	жиынтығында %-бен
ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары, оның ішінде:	834 897	44,9
ҚР Ұлттық Банктің ноттары	223 563	12,0
ҚР Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	606 351	32,6
жергілікті атқарушы органдардың бағалы қағаздары	4 983	0,3
Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары	44 368	2,4
Шет мемлекеттердің бағалы қағаздары	11 683	0,6
ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	873 276	46,9
акциялар	38 057	2,0
облигациялар	835 219	44,9
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	96 896	5,2
акциялар	2 399	0,1
облигациялар	94 497	5,1
Жиынтығы:	1 861 120*	100

*) Есепті кезеңнен бастап, 2012 жылғы 1 қазандағы жағдай бойынша «қарыздар мен дебиторлық берешек» санатындағы борыштық құралдар бойынша ақпарат қосылған («Самұрық Қазына» ҰӘҚ» АҚ).

ЕДБ портфелінің қомақты үлесін ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары құрайды – 44,9% немесе 834 897 млн. теңге. ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздарының үлесіне 46,9%-ы келеді. Шетел эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары жиынтық портфельдің 5,2%-ын, шет мемлекеттердің бағалы қағаздары – 0,6%-ын құрайды.

2012 жылғы 1 қазандағы сақтандыру ұйымдарының инвестициялық портфелінің құрылымы

Қаржы құралдары	млн. теңге	жиынтығында %-бен
ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары, оның ішінде:	60 233	18,32
- ҚР еурооблигациялары	0	0,00
- Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	56 960	17,33
- Ұлттық Банктің ноттары	760	0,23
- жергілікті атқарушы органдарының бағалы қағаздары	2 513	0,76
Екінші деңгейдегі банктердегі салымдар	100 687	30,64
Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары	9 527	2,90
Инвестициялық қорлардың пайлары	349	0,11
Туынды қаржы құралдары	0	0,00
Шет мемлекеттердің бағалы қағаздары	8 050	2,45
ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы	129 099	39,28

қағаздары, оның ішінде:		
- акциялар	3 132	0,95
- облигациялар	125 967	38,33
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	12 737	3,88
- акциялар	1 802	0,55
- облигациялар	10 935	3,33
"Кері РЕПО" операциялары	7 942	2,42
Жиынтығы:	328 624	100,00

Есепті күнге сақтандыру ұйымдарының жиынтық инвестициялық портфелінің көлемі 328 624 млн. теңге болды. Бұл ретте екінші деңгейдегі банктердегі салымдарға - 31,46%, ҚР эмитенттерінің корпоративті бағалы қағаздарына – 30,64%, Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздарының үлесіне 18,33%-дан келеді.

2012 жылғы 1 қазандағы бағалы қағаздар нарығы кәсіби қатысушыларының инвестициялық портфелінің құрылымы

Қаржы құралдары	млн. теңге	жиынтығында %- бен
ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары, оның ішінде:	3 195	7,0
ҚР еурооблигациялары	0	0,0
Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	3 159	6,9
Ұлттық Банктің ноттары	0	0,0
жергілікті атқарушы органдарының бағалы қағаздары	37	0,1
Екінші деңгейдегі банктердегі салымдар	3 297	7,2
Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары	184	0,4
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік бағалы қағаздары	202	0,4
ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	28 986	63,1
акциялар	9 712	21,1
облигациялар	19 274	42,0
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	7 378	16,1
акциялар	921	2,0
облигациялар	6 457	14,1
Инвестициялық қорлардың пайлары	1 893	4,1
Туынды қаржы құралдары	0	0,0
"Кері РЕПО" операциялары	771	1,7
Жиынтығы:	45 907	100,0

2012 жылғы 1 қазандағы жағдай бойынша бағалы қағаздар нарығына кәсіби қатысушылардың жиынтық инвестициялық портфелі 45 907 млн. теңге болды. Портфель құрылымындағы ең көп үлесті ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары иеленеді – 63,1%. ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары – 18,5% құрады, шетел эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары 16,1%-ды құрайды.