

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

Институционалды инфрақұрылым

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

Институциональная инфраструктура рынка ценных бумаг Республики Казахстан в настоящее время представлена следующим образом.

	1.04.11ж	1.07.11 ж	1.10.11 ж	1.01.12 ж	1.04.12 ж
Оның ішінде барлық брокерлер–дилерлер:	76	76	73	73	72
банктер	24	24	24	24	24
олардың I -санаттағысы	22	22	22	22	22
банктік емес ұйымдар	47	47	44	44	43
олардың I -санаттағысы	39	39	36	36	35
АӨҚО қатысушылары	5	5	5	5	5
Тіркеушілер	10	10	10	10	11
Кастодиандар	10	10	10	10	10
ЖЗҚ зейнетақы активтерін инвестициялық басқарушылар	16	16	14	14	13
Инвестициялық портфельді басқарушылар, оның ішінде:	38	38	34	33	33
инвестициялық компаниялар	2	2	0	0	0
ӨӨРУ	2	2	2	2	2
Трансфер-агенттер	3	3	3	3	3
Бағалы қағаздармен саудасаттықты ұйымдастырушы	1	1	1	1	1

2012 жылғы бірінші тоқсанда бағалы қағаздар нарығындағы қызметті жүзеге асыру үшін берілген 2 лицензияның қолданылуы тоқтатылды, оның ішінде номиналды ұстаушы ретінде клиенттер шоттарын жүргізу құқығымен брокерлік және дилерлік қызметті жүзеге асыруға берілген 1 лицензияның («Альянс Капитал» қаржылық компаниясы» АҚ), сондай-ақ зейнетақы активтерін басқаруға 1 лицензияның («Аманат Қазақстан ЖЗҚ» АҚ) қолданылуы тоқтатылды.

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)

	1.01.12ж.	1.04.12ж.	2012 жылғы тоқсандағы өзгеруі, %-бен
Жиынтық активтер*, оның ішінде:	137 220	102 003	-25,66
брокерлер-дилерлер (АӨҚО қатысушылары)	5 900	11 598	96,58
тіркеушілер	1 236	1 429	15,61

* ЕДБ қоспағанда қаржылық көрсеткіштер бойынша ақпарат

ИПБ	119 500	83 550	-30,08
инвестициялық компаниялар	5 414	-	-100
ЗАИБЖАҰ	5 170	5 426	4,95
Міндеттемелер, оның ішінде:	31 334	33 415	6,64
брокерлер-дилерлер (АӨҚО қатысушылары)	511	3 805	в 7 раз
тіркеушілер	46	64	39,13
ИПБ	27 958	25 130	-10,12
инвестициялық компаниялар	2 651	-	-100
ЗАИБЖАҰ	168	4 416	в 26 раз
Капитал, оның ішінде:	105 886	68 588	-35,22
брокерлер-дилерлер (АӨҚО қатысушылары)	5 389	7 793	44,61
тіркеушілер	1 190	1 365	14,71
ИПБ	91 542	58 420	-36,18
инвестициялық компаниялар	2 763	-	-100
ЗАИБЖАҰ	5 002	1 010	-79,81
Жарғылық капитал, оның ішінде:	96 673	96 428	-0,25
брокерлер-дилерлер (АӨҚО қатысушылары)	4 908	7 360	49,96
тіркеушілер	1 155	1 337	15,76
ИПБ	78 892	79 111	0,28
инвестициялық компаниялар	3 098	-	-100
ЗАИБЖАҰ	8 620	8 620	-

Эмитенттер және қаржы құралдары
Акциялар шығарылымы
Акциялар шығарылымы және шығарылымдарды жою туралы деректер

	2011 жылғы 1-тоқсанда	2011 жылғы 2-тоқсанда	2011 жылғы 3-тоқсанда	2011 жылғы 4-тоқсанда	2012 жылғы 1-тоқсанда
Шығарылымдар тіркелді	9	6	8	7	11
Шығарылым және орналастыру қорытындысы туралы есептер	178	174	169	219	189
Шығарылымдар жойылды	9	14	11	14	16

Есепті күнде қолданыстағы акциялар шығарылымының жалпы саны 2 142 құрады. 2012 жылғы I тоқсанда 189 акциялар шығарылымы (оның ішінде шығарылымдар проспектілеріне енгізілген өзгерістер) тіркелді, акциялардың шығарылымы және орналастыру қорытындысы туралы 189 есеп бекітілді, сондай-ақ 16 акциялар шығарылымы жойылды.

Тіркелген мемлекеттік емес облигациялар шығарылымы туралы деректер

	2011 жылғы 1-тоқсанда	2011 жылғы 2-тоқсанда	2011 жылғы 3-тоқсанда	2011 жылғы 4-тоқсанда	2012 жылғы 1-тоқсанда
Шығарылымдар саны	3	10	7	10	1

Шығарылымдар көлемі, млн. теңгемен	14 000	80 000	84 560	151 347	5 000
------------------------------------	--------	--------	--------	---------	-------

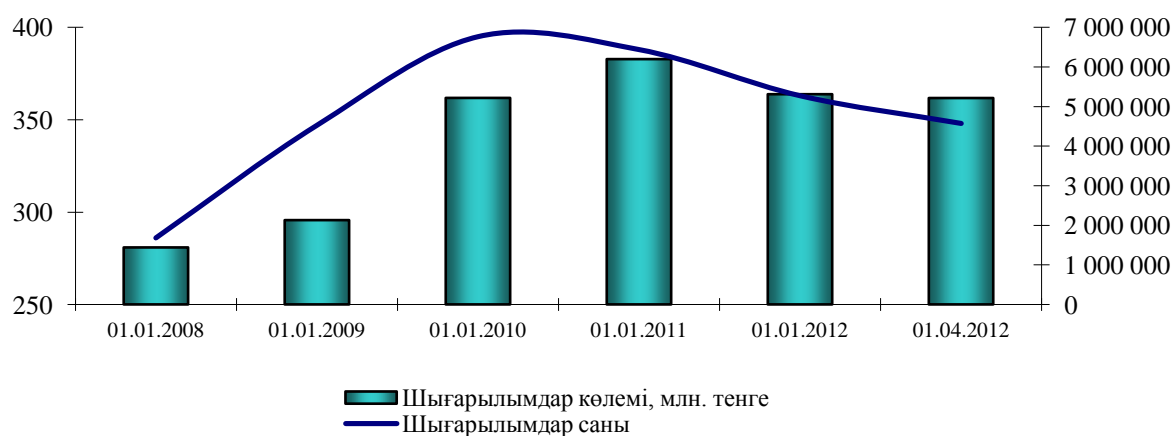
Комитет 2012 жылғы бірінші тоқсан ішінде жалпы көлемі 5 000 млн. теңгемен мемлекеттік емес облигациялардың 1 шығарылымын тіркеді.

Мемлекеттік емес облигациялардың қолданыстағы шығарылымы туралы деректер

	2011 жылғы 1 сәуірде	2011 жылғы 1 шілдеде	2011 жылғы 1 қазанда	2012 жылғы 1 қаңтарда	2012 жылғы 1 сәуірде
Шығарылымдар саны	381	365	361	363	348
Шығарылымдар көлемі, млн. теңгемен	5 973 516	5 393 016	5 195 826	5 309 673	5 213 423

2012 жылғы 1 қаңтардағы жағдай бойынша жиынтық номиналды құны 5 213 423 млн. теңгені құрайтын қолданыстағы облигациялар шығарылымының саны 348 болды, олардың ішінде рейтингтік бағасы бар 136 шығарылымы, 72 шығарылымы – бірінші шағын санаттың рейтингтік бағасы жоқ, 27 шығарылымы – екінші шағын санаттың рейтингтік бағасы жоқ және 3 шығарылымы – буферлік санатты KASE ресми тізіміне енгізілген.

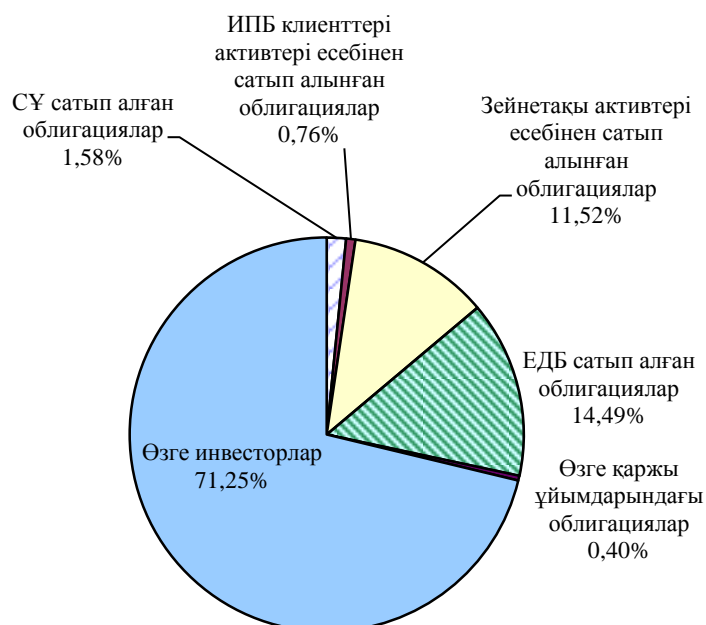
Қолданыстағы облигациялар шығарылымдарының саны мен көлемінің өзгеру динамикасы



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

- зейнетақы активтері есебінен сатып алынған облигациялар – 11,50%;
- екінші деңгейдегі банктер сатып алған облигациялар – 14,49%;
- инвестициялық портфельді басқарушы клиенттердің активтері есебінен сатып алынған облигациялар – 0,76%;
- сақтандыру (қайта сақтандыру) ұйымдары сатып алған облигациялар – 1,52%;
- өзге қаржы ұйымдары сатып алған облигациялар – 0,4%;
- өзге инвесторлар – 571,26%.

1.04.2012 жылғы ҚР корпоративті облигацияларының қолданыстағы шығарылымдарының жиынтық көлеміндегі инвесторлармен сатып алынған облигациялар үлесі



ҚР корпоративтік облигацияларының қолданыстағы шығарылымдарының жиынтық көлеміндегі 71,25%-ы кәсіби емес инвесторлардың үлесіне тиеді. Институционалды инвесторлар–облигацияларды ұстаушылардың (ИПБ клиенттерінің активтері және ЗА) Қазақстан Республикасының аумағында шығарылған облигациялардың жалпы көлеміндегі үлес салмағы 12,28% болды.

Тіркелген пайлар шығарылымдары туралы деректер

	2011 жылғы 1-тоқсанда	2011 жылғы 2-тоқсанда	2011 жылғы 3-тоқсанда	2011 жылғы 4-тоқсанда	2012 жылғы 1-тоқсанда
Шығарылымдар тіркелді	1	4	0	3	0
Шығарылым және орналастыру қорытындысы туралы есептер	26	23	25	22	22
Шығарылымдар жойылды	156	155	152	152	148

2012 жылғы 1 сәуірде қолданыстағы пайлар шығарылымының саны 148 болды. Бұл ретте 2012 жылғы қаңтар-наурыз айларында шығарылым мен орналастыру қорытындылары туралы 22 есеп бекітілді және 4 шығарылым өтелді.

**Қазақстан Республикасының аумағында айналыста
болатын мемлекеттік бағалы қағаздар***

(млн. теңге)

	2011 жылғы 1 сәуірде	2011 жылғы 1 шілдеде	2011 жылғы 1 қазанда	2012 жылғы 1 қаңтарда	2012 жылғы 1 сәуірде
Айналыста барлығы, оның ішінде	3 201 936	3 146 646	2 659 131	2 590 035	2 745 137
Ұлттық Банктің ноттары	1 449 137	1 330 612	742 568	509 805	535 980
Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	1 752 799	1 816 035	1 916 563	2 080 229	2 209 157
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:	91	68
"Борыштық бағалы қағаздар" секторы:	238	71
"Инвестициялық қорлардың бағалы қағаздары" секторы:	2	2
"Депозитарлық қолхаттар" секторы:	0	0
"Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары" секторы:	1	1
"Мемлекеттік бағалы қағаздар" секторы:	196	3
"Туынды бағалы қағаздар" секторы:	0	0
"Баламалы алаң"	0	0
Жиынтығы:	528	116

KASE айналымына жіберілген бағалы қағаздардың негізгі үлес салмағы борыштық бағалы қағаздарға – 45,1% (238 шығарылым) келеді. Акциялар және мемлекеттік бағалы қағаздары секторы бойынша тиісінше 17,2% (91 шығарылым) және 37,1% (196 шығарылым) болып келеді. Инвестициялық қорлардың бағалы қағаздарының үлесі 0,4%-ды (2 шығарылым) құрайды. Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздарының үлесіне 0,2% (1 шығарылым) келеді.

Мемлекеттік емес бағалы қағаздар бойынша KASE жалпы капиталдандыру 12 732 935 млн. теңгені немесе ЖІӨ-ден 40,7% құрады. 2012 жылғы 1 қаңтардағы жағдай бойынша осындай көрсеткіш 12 364 320 млн. теңгені немесе ЖІӨ-ден 45,3% құрады.

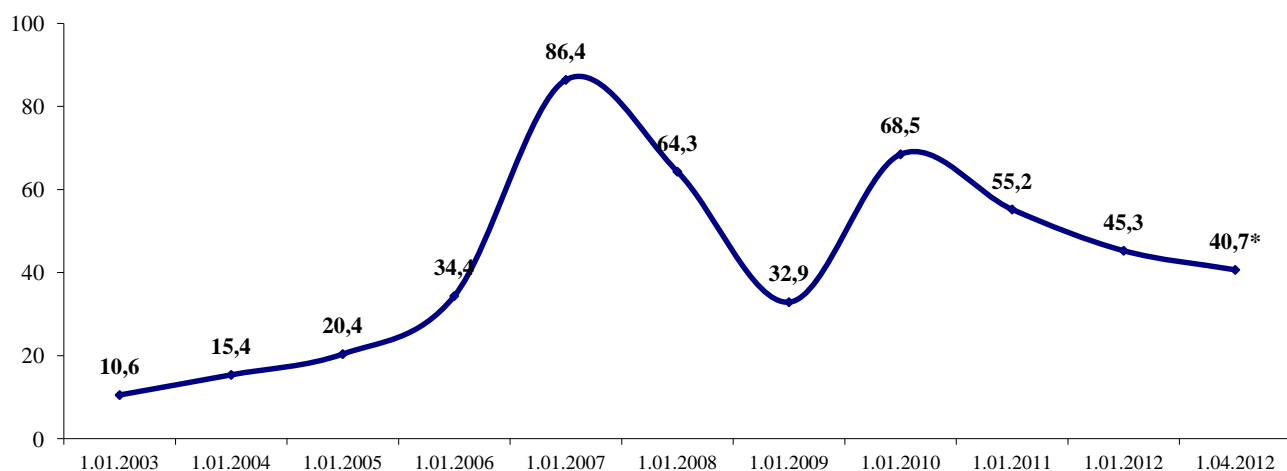
* Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің деректері бойынша ұсынылған ақпарат

* 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 *



* мәліметтер ҚР Экономикалық даму және сауда министрлігі ресми сайтынан алынған (31 297 млрд.теңге)

KASE-тегі мемлекеттік емес бағалы қағаздармен жасалған мәмілелер көлемі

	(млн. теңге)			
	2011 жылғы 2-тоқсанда	2011 жылғы 3-тоқсанда	2011 жылғы 4-тоқсанда	2012 жылғы 1-тоқсанда
бастапқы орналастыру:	19 485	735	3 501	17 877
– "Акциялар" секторы бойынша	0	0	0	3 923
– "Борыштық бағалы қағаздар" секторы бойынша	19 485	735	3 501	13 954
– "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:	107 222	77 555	82 574	74 070
– "Акциялар" секторы бойынша	26 999	18 432	21 513	11 216
– "Борыштық бағалы қағаздар" секторы бойынша	80 223	59 070	57 840	62 800
– "Инвестициялық қорлардың бағалы қағаздары" секторы бойынша	0	53	274	54
– "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	2 947	0
"Листингтік емес бағалы қағаздар" секторы	171	115	706	11
"репо" мәмілелері:	24 406	29 570	18 720	26 753
– "Акциялар" секторы бойынша	21 096	26 294	15 822	20 676
– "Борыштық бағалы қағаздар" секторы бойынша	3 310	3 276	2 898	6 077
– "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	151 284	107 975	105 501	118 711

Кестеде келтірілген деректерден көрініп отырғандай, 2012 жылдың үшінші тоқсанында мемлекеттік емес бағалы қағаздармен жасалған мәмілелер көлемі 12,5%-ға азайды.

КАСЕ-тегі мемлекеттік бағалы қағаздармен жасалған мәмілелер көлемі

(млн. теңге)

(млн. теңге)

	2011 жылғы 1 сәуірде	2011 жылғы 1 шілдеде	2011 жылғы 1 қазанда	2012 жылғы 1 қаңтарда	2012 жылғы 1 сәуірде
Мәмілелер көлемі, оның ішінде:	4 939 502	6 806 329	7 904 954	5 948 927	5 589 825
бастапқы орналастырулар	151 011	135 903	170 912	216 505	190 803
"репо" мәмілелері	4 666 525	6 543 358	7 591 643	5 664 077	5 328 790

Мемлекеттік бағалы қағаздар бойынша биржалық мәмілелер көлемі ұйымдастырылған нарықта ағымдағы жылдың 1-тоқсанында 6,0%-ға төмендеді. Бастапқы орналастыру көлемі 11,9%-ға азайды. Мемлекеттік бағалы қағаздармен жасалған мәмілелердің жалпы көлеміндегі "репо" көлемі 5,9%-ға азайды.

Зейнетақы активтерінің жиынтық көлемін бөлу

(млн. теңге)

Ресми тізім секторы	2011 жылғы 1 сәуірде	2011 жылғы 1 шілдеде	2011 жылғы 1 қазанда	2012 жылғы 1 қаңтарда	2012 жылғы 1 сәуірде
"Акциялар" секторы:	8 986 259	8 115 762	6 214 033	6 425 940	6 837 355
"Борыштық бағалы	5 793 198	5 809 341	6 038 463	5 936 540	5 893 801

қағаздар" секторы					
"Инвестициялық қорлардың бағалы қағаздары" секторы	1 779	1 779	1 472	1 840	1 779
"Депозитарлық қолхаттар" секторы	0	0	0	0	0
"Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары" секторы	0	0	0	0	0
"Мемлекеттік бағалы қағаздар" секторы	3 223 494	3 167 208	2 668 388	2 577 656	2 877 773
"Туынды бағалы қағаздар" секторы	0	0	0	0	0
Жиынтығы	18 004 730	17 094 090	14 922 356	14 941 976	15 610 708

Кестеде келтірілген деректерден көрініп отырғандай, KASE ресми тізіміне кіргізілген мемлекеттік бағалы қағаздар бойынша нарықты жалпы капиталдандыру 2012 жылғы 1 сәуірдегі жағдай бойынша 2012 жылғы 1 қаңтардағы көрсеткішпен салыстарғанда 4,5%-ға азайды.

Бағалы қағаздар нарығындағы инвесторлар

Инвестициялық басқарудағы зейнетақы активтері

2011 жылғы 1 сәуірдегі жағдай бойынша ЗАИБЖАҰ-ның инвестициялық басқаруындағы зейнетақы активтерінің жиынтық көлемі 2012 жылдың 1-тоқсанында 2 169,7 млрд. теңгеге немесе 6,5%-ға өсіп, 2 780,9 млрд. теңге болды.

Зейнетақы активтерінің орташа айлық өсімі 2011 жылғы 1 сәуірден бастап 2012 жылғы 1 сәуірге дейінгі кезеңде 33,0 млрд. теңге болды.

Зейнетақы активтерінің жиынтық көлемін бөлу

ЗАИБЖАҰ/ ЗЖҚ	зейнетақы активтері	
	млн. теңге	млн. теңге
«Қазақстан Халық Банкі ЖЗҚ» АҚ, «Қазақстан Халық Банкі» АҚ ЕҰ	924 458	33,2
«ГНПФ» ЖЗҚ» АҚ»	518 460	18,7
"Жетісу" ЗАИБЖАҰ" АҚ	397 826	14,3
«ҰларҮміт» ЖЗҚ» АҚ»	397 826	14,3
"GRANTUM Asset Management" ЗАИБЖАҰ" АҚ («Казкоммерцбанк» АҚ ЕҰ)	262 794	9,5
«ГРАНТУМ» ЖЗҚ» АҚ («Казкоммерцбанк» АҚ ЕҰ)	262 794	9,5
«Капитал» ЖЗҚ» АҚ - «Банк ЦентрКредит» АҚ еншілес ұйымы	155 885	5,6
"Астана" ЖЗҚ" АҚ	154 877	5,6
"МұнайГаз-Дем" ЖЗҚ" АҚ	114 848	4,1
"Нұрбанк" АҚ ЕҰ "Атамекен" ЖЗҚ" АҚ	83 692	3,0
«Отан» АЖЗҚ» АҚ	76 192	2,7
«РЕСПУБЛИКА» ЖЗҚ» АҚ	70 160	2,5
"Индустриалды Қазақстан" ЖЗҚ" АҚ ("Қазақмыс" ЖЗҚ" АҚ бұрынғы атауы)	21 704	0,8
Барлық ЖЗҚ бойынша жиынтығы	2 780 896	100

2012 жылдың 1-тоқсанында инвестицияланған зейнетақы активтерінің көлемі 0,2 млрд. теңгеге немесе 6,8%-ға өсіп, 2011 жылғы 1 қазанда 2 719,7 млрд. теңге болды.

Жинақтаушы зейнетақы қорларының инвестициялық портфеліндегі ҚР эмитенттерінің мемлекеттік бағалы қағаздарының үлесі инвестицияланған зейнетақы активтерінің жалпы көлемінен 49,9%-ды (1 357,6 млрд. теңге) құрайды және 2012 жылғы 1 қаңтардағы жағдай бойынша осындай көрсеткішке қатысты 0,2 млрд. теңгеге артты. ҚР мемлекеттік емес бағалы қағаздардың үлесі 2012 жылғы 1 қаңтардағы жағдай бойынша инвестицияланған зейнетақы активтерінің жалпы көлемінен 26,6%-ды (722,4 млрд. теңге) құрады.

ЖЗҚ-ның жиынтық инвестициялық портфелі

Қаржы құралдары	1.01.2012ж.		1.04.2012ж.	
	млн. теңге	%	млн. теңге	%
ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары, оның ішінде	1 154 007	45,32	1 357 593	49,92
Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	1 067 704	41,93	1 174 301	43,18
Ұлттық Банктің ноттары	80 689	3,17	177 772	6,54
орталық атқарушы органдардың бағалы қағаздары	5 614	0,22	5 520	0,20
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес бағалы қағаздары	145 952	5,73	147 646	5,43
акциялар	18 440	0,72	14 181	0,52
облигациялар	127 512	5,01	133 465	4,91
Шетелдік инвестициялық қорлардың пайлары	92 919	3,65	39 989	1,47
Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары	126 714	4,98	97 509	3,58
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік бағалы қағаздары	126 366	4,97	121 824	4,48
Тазартылған алтын	724 174	28,44	722 396	26,56
ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде	145 838	5,73	150 870	5,55
акциялар	578 336	22,71	571 526	21,01
облигациялар оның ішінде:	26 374	1,03	28 073	1,03
шетелдік валютада номинирленген	551 962	21,68	543 453	19,98
теңгемен номинирленген	176 933	6,95	233 460	8,58
Екінші деңгейдегі банктердегі салымдар	-937	-0,04	-677	-0,02
Жиынтығы	2 546 128	100	2 719 740	100

Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктеріндегі салымдар көлемі ағымдағы жылдың 1-тоқсанында 31,9%-ға азайып, 233,5 млрд. теңге болды.

Эмитенттері бағалы қағаздар шығарылымдары бойынша дефолтқа жол берген бағалы қағаздардың үлесі 2012 жылғы 1 сәуірдегі зейнетақы активтерінің жалпы көлемінен 0,6%-ды құрады, бұл абсолютті мән бойынша 16,0 млрд. теңге болды.

2012 жылғы 1 сәуірдегі жағдай бойынша меншікті активтер есебінен сатып алынған ЖЗҚ-ның жиынтық инвестициялық портфелі

Қаржы құралдары	млн. теңге	жиынтыққа, %-бен
ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары, оның ішінде:	42 169	53,35

ҚР еурооблигациялары	0	0
Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	39 486	49,96
Ұлттық Банктің ноттары	2 683	3,39
жергілікті атқарушы органдардың бағалы қағаздары	0	0
Екінші деңгейдегі банктердегі салымдар	20 427	25,85
Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары	155	0,2
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік бағалы қағаздары	423	0,53
Шетелдік инвестициялық қорлардың пайлары	0	0
ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	14 583	18,45
акциялар	425	0,54
облигациялар	14 158	17,91
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	647	0,82
акциялар	0	0,00
облигациялар	647	0,82
"Кері РЕПО" операциялары	630	0,80
Жиынтығы:	79 034	100

2012 жылғы 1 сәуірде жинақтаушы зейнетақы қорларының жиынтық меншікті портфеліндегі ең көп көлемін ҚР мемлекеттік емес бағалы қағаздары алады – 42 169 млн. теңге (53,5%). Бұл ретте меншікті активтер портфелінің 25,8%-ы екінші деңгейдегі банктердің салымдарына орналастырылған. ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздарының үлесі 18,5% құрады.

Инвестициялық қорлардың саны

	1.04.2011	1.07.2011	1.10.2011	1.01.2012	1.04.2012
Инвестициялық пай қорларының саны, оның ішінде	156	155	152	152	148
ашық	12	12	12	12	12
жабық	118	118	116	117	113
аралық	26	25	24	23	23
Акционерлік инвестициялық қорлардың саны	32	32	32	32	32

Инвестициялық пай қорлары пайшыларының саны

	1.04.2011	1.07.2011	1.10.2011	1.01.2012	1.04.2012
Инвестициялық пай қорлары пайшыларының саны, оның ішінде	2 028	2 069	1 960	1 944	1 366
Занды тұлғалар	67	64	78	61	56
Жеке тұлғалар	1 961	2 005	1 882	1 883	1 310

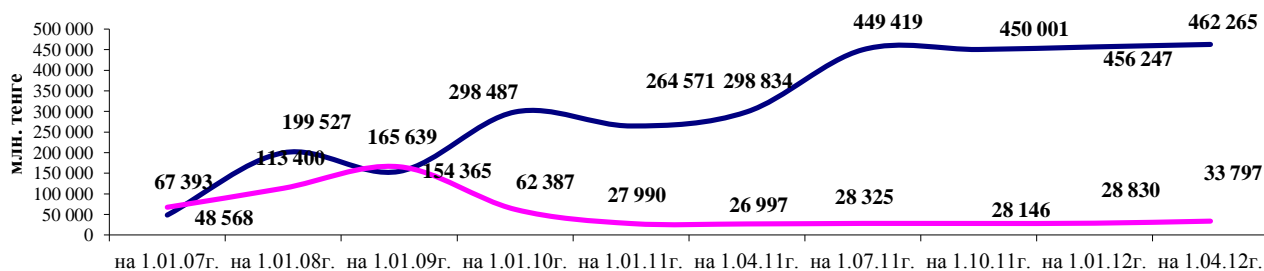
2012 жылғы 1 сәуірдегі инвестициялық қорлар активтері

2012 жылғы 1 сәуірдегі жағдай бойынша инвестициялық пай қорының және акционерлік инвестициялық қорлардың жиынтық активтері тиісінше 462 265 млн. теңге және 33 797 млн. теңге болды. 1-тоқсанда инвестициялық пай қорларының активтері 1,3%-ға ұлғайды, акционерлік инвестициялық қорлардың активтері 17,2%-ға өсті.

(млн. теңге)

	2011 жылғы 1 сәуірде	2011 жылғы 1 шілдеде	2011 жылғы 1 қазанда	2012 жылғы 1 қаңтарда	2012 жылғы 1 сәуірде
Инвестициялық пай қорларының саны, оның ішінде	298 834	449 419	450 001	456 247	462 265
ашық	296 161	446 847	447 526	453 920	460 171
жабық	793	706	624	568	590
аралық	1 880	1 866	1 851	1 759	1 504
Акционерлік инвестициялық қорлардың саны	26 997	28 325	28 146	28 830	33 797

Инвестициялық қорлар активтерінің өзгеру динамикасы



2012 жылғы 1 сәуірдегі инвестициялық қорлардың жиынтық инвестициялық портфелі

(млн. теңге)

Қаржы құралдары	Инвестициялық пай қорлары		Акционерлік инвестициялық қорлар	
	млн. теңге	жиынтыққа, %-бен	млн. теңге	жиынтыққа, %-бен
ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары, оның ішінде:	5	0	59	0,18
ҚР еурооблигациялары	0	0	0	0
Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	5	0	59	0,18
Ұлттық Банктің ноттары	0	0	0	0
жергілікті атқарушы органдардың бағалы қағаздары	0	0	0	0
Екінші деңгейдегі банктердегі салымдар	14 085	3,05	464	1,37
Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары	0	0	0	0

Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік бағалы қағаздары	185	0,04	123	0,36
Тазартылған алтын	0	0	0	0
ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	8 715	1,89	4 172	12,34
акциялар	6 457	1,40	772	2,28
облигациялар	2 258	0,49	3 400	10,06
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	1 588	0,34	154	0,46
акциялар	1 558	0,34	154	0,46
облигациялар	30	0,01	0	0
Инвестициялық қорлардың пайлары	19 333	4,18	154	0,46
Депозитарлық қолхаттар	425	0,09	330	0,98
"Кері РЕПО" операциясы	559	0,12	130	0,39
Жер учаскелері	5 118	1,11	1 265	3,74
Үйлер мен ғимараттар	1 226	0,27	11 802	34,92
Жылжымайтын мүліктің салынып жатқан және қайта құрастырылып жатқан объектілері	1 497	0,32	6 111	18,08
Жобалық-сметалық құжаттама	0	0	15	0,04
Жерді пайдалану және жер қойнауын пайдалану құқықтары	0	0	3 901	11,54
Акционерлік қоғам болып табылмайтын заңды тұлғалардың капиталындағы инвестициялық қордың инвестициялары	394 445	85,33	472	1,40
Туынды қаржы құралдары	4	0	0	0
Өзге активтер/ дебиторлық берешек	15 080	3,26	4 645	13,74
Жиынтығы:	462 265	100	33 797	100

Инвестициялық пай және акционерлік қорлардың жиынтық инвестициялық портфеліндегі негізгі үлесті өзге мүлік (инвестициялық қордың акционерлік қоғам болып табылмайтын заңды тұлғалардың капиталына инвестициялары, жер учаскелері, үйлер мен ғимараттар, жылжымайтын мүліктің салынып жатқан және қайта құрастырылып жатқан объектілері, жобалық-сметалық құжаттама, жерді пайдалану және жер қойнауын пайдалану құқықтары) иеленеді, тиісінше 87,0% (402,3 млрд.теңге) және 69,7% (23,6 млрд.теңге).

ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары инвестициялық пай қорларының инвестициялық портфелінде 1,9%, акционерлік инвестициялық қорлар портфелінде – 12,3%-ды иеленіп отыр. Шетел эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздарының ИПҚ-ның жиынтық портфеліндегі үлесі қомақты емес – 0,3% болса, АИҚ-ның портфелінде - 0,5% болды.

2012 жылғы 1 сәуірдегі екінші деңгейдегі банктердің инвестициялық портфелінің құрылымы

Қаржы құралдары	млн. теңге	жиынтығында %-бен
ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары, оның ішінде:	847 231	63,1
ҚР Ұлттық Банктің ноттары	304 719	22,7
ҚР Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	537 505	40,0
жергілікті атқарушы органдардың бағалы қағаздары	5 007	0,4
Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары	42 797	3,2
Шет мемлекеттердің бағалы қағаздары	9 532	0,7
ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	349 148	26,0
акциялар	45 755	3,4
облигациялар	303 393	22,6
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	92 506	6,9
акциялар	2 420	0,2
облигациялар	90 086	6,7
Жиынтығы:	1 513	0,1
ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары, оның ішінде:	1 342 727	100

ЕДБ портфелінің қомақты үлесін ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары құрайды – 63,1% немесе 847 231 млн. теңге. ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздарының үлесіне 26%-ы келеді. Шетел эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары жиынтық портфельдің 6,9%-ын, шет мемлекеттердің бағалы қағаздары – 0,7%-ын құрайды.

2012 жылғы 1 сәуірдегі сақтандыру ұйымдарының инвестициялық портфелінің құрылымы

Қаржы құралдары	млн. теңге	жиынтығында %-бен
ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары, оның ішінде:	56 176	18,37
- ҚР еурооблигациялары	0	0,00
- Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	49 146	16,07
- Ұлттық Банктің ноттары	4 506	1,47
- жергілікті атқарушы органдарының бағалы қағаздары	2 524	0,83
Екінші деңгейдегі банктердегі салымдар	96 193	31,46
Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары	10 467	3,42
Инвестициялық қорлардың пайлары	405	0,14
Туынды қаржы құралдары	2	0,00
Шет мемлекеттердің бағалы қағаздары	7 011	2,29
ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	115 606	37,81
- акциялар	4 132	1,35
- облигациялар	111 474	36,46
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес бағалы	14 485	4,74

қағаздары, оның ішінде:

- акциялар	2 092	0,69
- облигациялар	12 393	4,05
"Кері РЕПО" операциялары	5 393	1,77
Жиынтығы:	305 736	100,00

Есепті күнге сақтандыру ұйымдарының жиынтық инвестициялық портфелінің көлемі 305 736 млн. теңге болды. Бұл ретте екінші деңгейдегі банктердегі салымдарға - 31,46%, ҚР эмитенттерінің корпоративті бағалы қағаздарына – 37,81%, Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздарының үлесіне 18,37%-дан келеді.

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

Қаржы құралдары	млн. теңге	жиынтығында %-бен
ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары, оның ішінде:	7 869	18,5
ҚР еурооблигациялары	0	0,0
Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	4 841	11,4
Ұлттық Банктің ноттары	2 991	7,0
жергілікті атқарушы органдарының бағалы қағаздары	37	0,1
Екінші деңгейдегі банктердегі салымдар	0	0,0
Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары	108	0,3
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік бағалы қағаздары	199	0,5
ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	24 355	57,3
акциялар	11 611	27,3
облигациялар	12 744	30,0
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	7 579	17,8
акциялар	1 354	3,2
облигациялар	6 225	14,7
Инвестициялық қорлардың пайлары	1 858	4,4
Туынды қаржы құралдары	0	0,0
"Кері РЕПО" операциялары	506	1,2
Жиынтығы:	42 474	100

2012 жылғы 1 сәуірдегі жағдай бойынша бағалы қағаздар нарығына кәсіби қатысушылардың жиынтық инвестициялық портфелі 42 474 млн. теңге болды. Портфель құрылымындағы ең көп үлесті ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары иеленеді – 57,3%. ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары – 18,5% құрады, шетел эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары 17,8%-ды құрайды.