Қазақстан Республикасының бағалы қағаздар нарығының 2013 жылғы 1 сәуірдегі ағымдағы жағдайы

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

	1.04.12 жылға	1.07.12 жылға	1.10.12 жылға	1.01.13 жылға	1.04.13 жылға
Оның ішінде барлық брокерлер–дилерлер:	**72**	**66**	**65**	**62**	**60**
банктер	24	24	24	24	24
олардың І -санаттағысы	22	22	22	22	22
банктік емес ұйымдар	43	38	37	34	33
олардың І -санаттағысы	35	30	28	25	24
АӨҚО қатысушылары	5	4	4	4	3
Тіркеушілер	**10**	**10**	**10**	**7**	**-**
Кастодиандар	**10**	**10**	**10**	**10**	**11**
ЖЗҚ зейнетақы активтерін инвестициялық басқарушылар	**13**	**13**	**13**	**13**	**13**
Инвестициялық портфельді басқарушылар, оның ішінде:	**33**	**32**	**33**	**33**	**32**
ӨӨРУ	**2**	**2**	**2**	**2**	**2**
Трансфер-агенттер	**3**	**2**	**2**	**2**	**2**
Бағалы қағаздармен сауда-саттықты ұйымдастырушы	**1**	**1**	**1**	**1**	**1**
БҚН қаржы құралдарымен мәмілелер бойынша клирингтік қызмет	**0**	**0**	**1**	**1**	**1**

1 лицензия на управление инвестиционным портфелем (АО «ИФГ КОНТИНЕНТ»).

2013 жылғы бірінші тоқсанда кастодианды қызметті жүзеге асыруға 1 лицензия («Сбербанк России» АҚ ЕБ) берілді. Сонымен қатар, 3 лицензияның, оның ішінде номиналды ұстаушы ретінде клиенттер шоттарын жүргізу құқығымен бағалы қағаздар нарығында брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыруға берілген 2 лицензияның («Ренессанс Капитал Инвестментс Казахстан» АҚ және «ORKEN Invest» АҚ), инвестициялық портфельді басқаруға берілген 1 лицензияның («ИФГ КОНТИНЕНТ» АҚ) қолданылуы тоқтатылды.

«Қазақстан Республикасының кейбір заңнамалық актілеріне банк қызметін және қаржы ұйымдарын тәуекелдерді азайту тұрғысынан реттеу мәселелері бойынша өзгерістер мен толықтырулар енгізу туралы» 2011 жылғы 28 желтоқсандағы Қазақстан Республикасының Заңына (бұдан әрі – Заң) сәйкес 2013 жылғы 1 қаңтардан бастап бағалы қағаздарды ұстаушылар тізілімі жүйесін жүргізу бойынша қызметті жүзеге асыруға лицензияның қолданылуы тоқтатылды. Заңға сәйкес нарықта 1 бірыңғай тіркеуші қызмет етеді.

(млн. теңге)

	1.01.13 жылға	**1.04.13 жылға**	**2013 жылғы бірінші тоқсандағы өзгеруі, %-бен**
Жиынтық активтер[*], оның ішінде:	**104 233**	**104 079**	**-0,1**
брокерлер-дилерлер (АӨҚО қатысушылары)	3 128	2 278	-27,2
тіркеушілер	1 404	648	-53,8
ИПБ	93 330	92 953	-0,4
инвестициялық компаниялар	6 371	8 200	28,7
ЗАИБЖАҰ	**19 956**	**19 242**	**-3,6**
Міндеттемелер, оның ішінде:	530	83	-84,3
брокерлер-дилерлер (АӨҚО қатысушылары)	35	57	62,9
тіркеушілер	19 228	19 025	-1,1
ИПБ	163	77	-52,8
инвестициялық компаниялар	**84 277**	**84 837**	**0,7**
ЗАИБЖАҰ	2 598	2 195	-15,5
Капитал, оның ішінде:	1 369	591	-56,8
брокерлер-дилерлер (АӨҚО қатысушылары)	74 102	73 928	-0,2
тіркеушілер	6 208	8 123	30,8
ИПБ	**97 811**	**95 312**	**-2,6**
инвестициялық компаниялар	1 637	1 385	-15,4
ЗАИБЖАҰ	1 449	740	-48,9
Жарғылық капитал, оның ішінде:	85 290	83 752	-1,8
брокерлер-дилерлер (АӨҚО қатысушылары)	9 435	9 435	-

[*] ЕДБ қоспағанда қаржылық көрсеткіштер бойынша ақпарат

Эмитенттер және қаржы құралдары
Акциялар шығарылымы

Акциялар шығарылымы және шығарылымдарды жою туралы деректер

	2012 жылғы 1-тоқсанда	2012 жылғы 2-тоқсанда	2012 жылғы 3-тоқсанда	2012 жылғы 4-тоқсанда	2013 жылғы 1-тоқсанда
Шығарылымдар тіркелді	11	17	14	14	7
Шығарылым және орналастыру қорытындысы туралы есептер	189	214	164	203	162
Шығарылымдар жойылды	16	14	238	20	12

Есепті күнде қолданыстағы акциялар шығарылымы бар акционерлік қоғамдардың жалпы саны 1909 құрады. 2013 жылғы I тоқсанда 224 акциялар шығарылымы (оның ішінде шығарылымдар проспектілеріне енгізілген өзгерістер) тіркелді, акциялардың шығарылымы және орналастыру қорытындысы туралы 162 есеп бекітілді, сондай-ақ 12 акциялар шығарылымы жойылды.

Тіркелген мемлекеттік емес облигациялар шығарылымы туралы деректер

	2012 жылғы 1-тоқсанда	2012 жылғы 2-тоқсанда	2012 жылғы 3-тоқсанда	2012 жылғы 4-тоқсанда	2013 жылғы 1-тоқсанда
Шығарылымдар саны	1	8	0	21	4
Шығарылымдар көлемі, млн. теңгемен	5 000	76 000	0	534 876	14 000

Комитет 2013 жылғы бірінші тоқсанда жалпы көлемі 14 000 млн. теңге болатын 4 мемлекеттік емес облигациялар шығарылымы тіркеді.

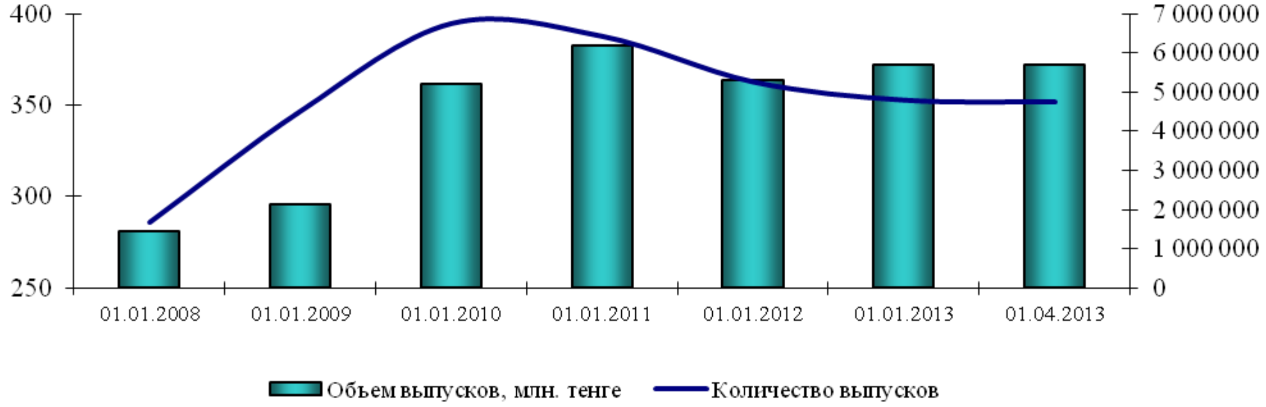
Қолданыстағы мемлекеттік емес облигациялар шығарылымы туралы деректер

	2012 жылғы 1 сәуірде	2012 жылғы 1 шілдеде	2012 жылғы 1 қазанда	2013 жылғы 1 қаңтарда	2013 жылғы 1 сәуірде

Шығарылымдар саны	348	347	339	353	352
Шығарылымдар көлемі, млн. теңгемен	5 213 423	5 266 314	5 197 277	5 709 953	5 706 403

2013 жылғы 1 сәуірдегі жағдай бойынша жиынтық номиналды құны 5 706 403 млн. теңгені құрайтын қолданыстағы облигациялар шығарылымының саны 352 болды, олардың ішінде рейтингілік бағасы бар 148 шығарылымы, 65 шығарылымы – бірінші шағын санаттың рейтингілік бағасы жоқ, 17 шығарылымы – екінші шағын санаттың рейтингтік бағасы жоқ және 4 шығарылымы – буферлік санатты KASE ресми тізіміне енгізілген.

Қолданыстағы облигациялар шығарылымдарының саны мен көлемінің өзгеру динамикасы

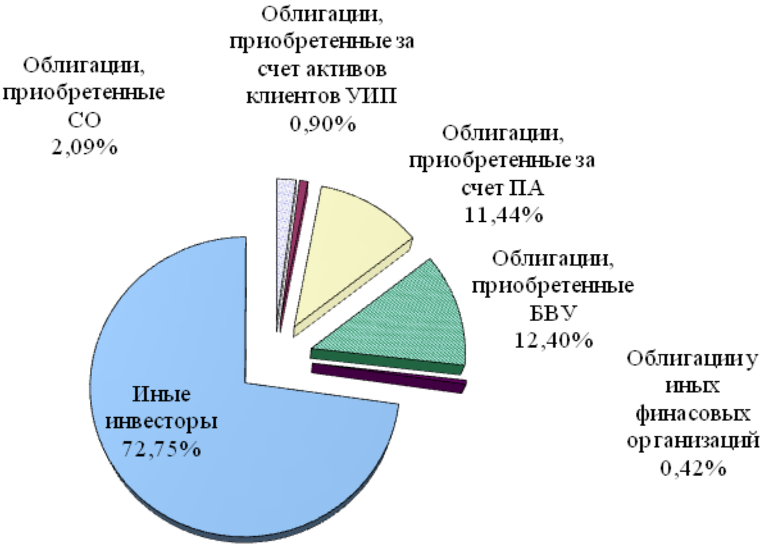


Шығарылымдар көлемі, млн. тенге
Шығарылымдар саны

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

– зейнетақы активтері есебінен сатып алынған облигациялар – 11,44%;
– екінші деңгейдегі банктер сатып алған облигациялар – 12,40%;
– инвестициялық портфельді басқарушы клиенттердің активтері есебінен сатып алынған облигациялар – 0,90%;
– сақтандыру (қайта сақтандыру) ұйымдары сатып алған облигациялар – 2,09%;
– өзге қаржы ұйымдары сатып алған облигациялар – 0,42%;
- өзге инвесторлар – 72,75%.

1.04.2013 жылғы ҚР корпоративті облигацияларының қолданыстағы шығарылымдарының жиынтық көлеміндегі инвесторлармен сатып алынған облигациялар үлесі



ҚР корпоративтік облигацияларының қолданыстағы шығарылымдарының жиынтық көлеміндегі 72,75%-ы кәсіби емес инвесторлардың үлесіне тиеді. Институционалды инвесторлар–облигацияларды ұстаушылардың (ОИП және ЗА клиенттерінің активтері) Қазақстан Республикасының аумағында шығарылған облигациялардың жалпы көлеміндегі үлес салмағы 12.34% болды.

Тіркелген пайлар шығарылымдары туралы деректер

	2012 жылғы 1-тоқсанда	**2012 жылғы 2-тоқсанда**	**2012 жылғы 3-тоқсанда**	**2012 жылғы 4-тоқсанда**	**2013 жылғы 1-тоқсанда**
Шығарылымдар тіркелді	0	0	0	3	0
Шығарылым және орналастыру қорытындысы туралы есептер	22	18	18	27	109
Шығарылымдар жойылды	148	146	127	126	113

2013 жылғы 1 сәуірде қолданыстағы пайлар шығарылымының саны 113 болды. Бұл ретте 2013 жылғы қаңтар-наурыз айларында шығарылым мен орналастыру қорытындылары туралы 109 есеп бекітілді және 13 шығарылым өтелді.

Қазақстан Республикасының аумағында айналыста болатын мемлекеттік бағалы қағаздар *

(млн. теңге)

	2012 жылғы 1 сәуірде	2012 жылғы 1 шілдеде	2012 жылғы 1 қазанда	2013 жылғы 1 қаңтарда	2013 жылғы 1 сәуірде
Айналыста барлығы, оның ішінде	**2 745 137**	**2 826 021**	**2 961 317**	**3 091 265**	**3 135 862**
Ұлттық Банктің ноттары	535 980	449 496	414 906	186 098	101 911
Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	2 209 157	2 376 525	2 546 410	2 905 167	3 033 951
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

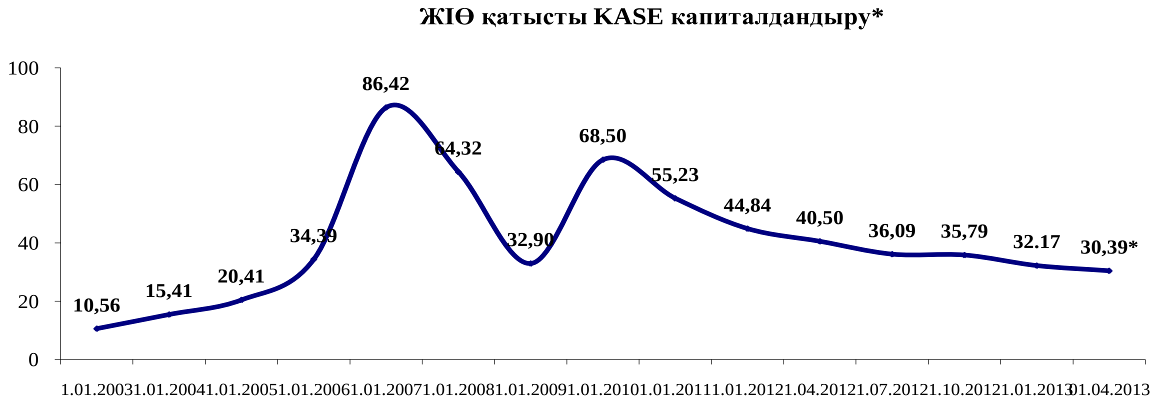
	шығарылым саны	эмитенттер саны
"Акциялар" секторы:	102	79
"Борыштық бағалы қағаздар" секторы:	234	75
"Инвестициялық қорлардың бағалы қағаздары" секторы:	1	1
"Депозитарлық қолхаттар" секторы:	0	0
"Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары" секторы:	2	1
"Мемлекеттік бағалы қағаздар" секторы:	199	3
"Туынды бағалы қағаздар" секторы:	0	0
"Баламалы алаң"	0	0
Жиынтығы:	**538**	**131**

* Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің деректері бойынша ұсынылған ақпарат

** Биржа нарығы жөніндегі ақпарат KASE деректері бойынша ұсынылған

KASE айналымына жіберілген бағалы қағаздардың негізгі үлес салмағы борыштық бағалы қағаздарға – 43,5% (234 шығарылым) келеді. Акциялар және мемлекеттік бағалы қағаздары секторы бойынша тиісінше 18,9% (102 шығарылым) және 37,0 (199 шығарылым) болып келеді. Инвестициялық қорлардың бағалы қағаздарының үлесі 0,2%-ды (1 шығарылым) құрайды. Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздарының үлесіне 0,4% (2 шығарылым) келеді.

Мемлекеттік емес бағалы қағаздар бойынша KASE жалпы капиталдандыру 10 423 768 млн. теңгені немесе ЖІӨ-ден 30,4% құрады. 2013 жылғы 1 қаңтардағы жағдай бойынша осындай көрсеткіш 10 114 516 млн. теңгені немесе ЖІӨ-ден 32,2% құрады. Осылайша, қор нарығын капиталдандырудың абсолюттік көріністегі азаюы да, сондай ЖІӨ-ге қатысты қор нарығын капиталдандыру көрсеткішінің азаюы да байқалады.



* ҚР Экономика және бюджеттік жоспарлау министрлігінің ресми сайтанан деректер (34291,0 млрд.теңге)

KASE-тегі мемлекеттік емес бағалы қағаздармен жасалған мәмілелер көлемі

(млн. теңге)

	2012 жылғы 2-тоқсанда	2012 жылғы 3-тоқсанда	2012 жылғы 4-тоқсанда	2013 жылғы 1-тоқсанда
бастапқы орналастыру:	**14 111**	**35 868**	**58 145**	**29 981**
– "Акциялар" секторы бойынша	0	0	27 886	0
– "Борыштық бағалы қағаздар" секторы бойынша	14 111	35 868	20 359	29 981
– "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	9 900	0
– "Туынды бағалы қағаздар" секторы бойынша	0	0	0	0
қайталама айналысы:	**165 024**	**76 997**	**86 012**	**31 684**
– "Акциялар" секторы бойынша	117 450	23 257	20 452	13 693
– "Борыштық бағалы қағаздар" секторы бойынша	47 432	53 680	64 801	16 640
– "Инвестициялық қорлардың бағалы қағаздары" секторы бойынша	142	60	1	590
– "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	758	761
"Листингтік емес бағалы қағаздар" секторы	**41**	**62**	**244**	**122**
"репо" мәмілелері:	**26 354**	**30 348**	**30 532**	**42 126**
– "Акциялар" секторы бойынша	22 436	20 745	16 196	36 022
– "Борыштық бағалы қағаздар" секторы бойынша	3 918	9 603	14 336	6 104
– "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 бойынша	0	0	0	0
Жиынтығы	**205 530**	**143 275**	**174 933**	**103 913**

Кестеде келтірілген деректерден көрініп отырғандай, 2013 жылдың бірінші тоқсанында мемлекеттік емес бағалы қағаздармен жасалған мәмілелер көлемі 40,6%-ға төмендеді.

KASE-тегі мемлекеттік бағалы қағаздармен жасалған мәмілелер көлемі

(млн. теңге)

	2012 жылғы 2-тоқсанда	2012 жылғы 3-тоқсанда	2012 жылғы 4-тоқсанда	2013 жылғы 1-тоқсанда
Мәмілелер көлемі, оның ішінде:	5 664 216	6 018 305	6 572 739	3 627 486
"репо" мәмілелерінің бастапқы орналастырулары	244 811	224 093	409 063	157 280
	5 337 925	5 757 833	6 122 912	3 413 015

Мемлекеттік бағалы қағаздар бойынша биржалық мәмілелер көлемі ұйымдастырылған нарықта ағымдағы жылдың 1-тоқсанында 44,8%-ға азайды. Бастапқы орналастыру көлемі 61,6%-ға төмендеді. Мемлекеттік бағалы қағаздармен жасалған мәмілелердің жалпы көлеміндегі "репо" көлемі 44,3%-ға азайды.

KASE капиталдандырудың өзгеріс динамикасы

(млн.теңге)

Ресми тізім секторы	2012 жылғы 1 сәуірде	2012 жылғы 1 шілдеде	2012 жылғы 1 қазанда	2013 жылғы 1 қаңтарда	2013 жылғы 1 сәуірде
"Акциялар" секторы:	6 837 355	5 421 602	5 260 665	5 363 455	5 452 362
"Борыштық бағалы қағаздар" секторы	5 893 801	5 927 782	5 992 978	4 748 730	4 925 301
"Инвестициялық қорлардың бағалы қағаздары" секторы	1 779	0	-	-	2 760
"Депозитарлық қолхаттар" секторы	0	0	-	-	
"Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары" секторы	0	0	-	-	
"Мемлекеттік бағалы қағаздар" секторы	2 877 773	2 840 698	2 887 268	3 098 716	3 142 825
"Туынды бағалы қағаздар" секторы	0	0	-	-	
Жиынтығы	**15 610 708**	**14 190 082**	**14 140 911**	**13 210 901**	**13 523 248**

Кестеде келтірілген деректерден көрініп отырғандай, KASE ресми тізіміне кіргізілген бағалы қағаздар бойынша нарықты жалпы капиталдандыру 2013 жылғы 1 сәуірдегі жағдай бойынша 2013 жылғы 1 қаңтардағы көрсеткішпен салыстарғанда 2,4%-ға ұлғайды.

Бағалы қағаздар нарығындағы инвесторлар

Инвестициялық басқарудағы зейнетақы активтері

2013 жылғы 1 сәуірдегі жағдай бойынша ЗАИБЖАҰ-ның инвестициялық басқаруындағы зейнетақы активтерінің жиынтық көлемі жылдың басынан бастап 124,0 млрд. теңгеге немесе 3,9%-ға өсіп, 3 312,3 млрд. теңге болды.

Зейнетақы активтерінің орташа айлық өсімі 2012 жылғы 1 сәуірден 2013 жылғы 1 сәуір аралығында 44,3 млрд. теңге болды.

Зейнетақы активтерінің жиынтық көлемін бөлу

ЗАИБЖАҰ/ ЖЗҚ	зейнетақы активтері	
	млн. теңге	%-бен
«Қазақстан Халық Банкі ЖЗҚ» АҚ, «Қазақстан Халық Банкі» АҚ ЕҰ	1 109 247	33,5
«ГНПФ» ЖЗҚ» АҚ»	665 392	20,1
«ҰларҮміт» ЖЗҚ» АҚ»	406 086	12,3
«ГРАНТУМ» ЖЗҚ» АҚ («Казкоммерцбанк» АҚ ЕҰ)	309 358	9,3
«Астана» ЖЗҚ» АҚ	232 765	7,0
«Капитал» ЖЗҚ» АҚ - «Банк ЦентрКредит» АҚ еншілес ұйымы	189 312	5,7
«НафтеГаз-Дем» ЖЗҚ» АҚ	143 644	4,3
«Нұрбанк» АҚ ЕҰ «Атамекен» ЖЗҚ» АҚ	91 653	2,8
«Отан» АЖЗҚ» АҚ	85 993	2,6
«РЕСПУБЛИКА» ЖЗҚ» АҚ	78 802	2,4
Барлық ЖЗҚ бойынша жиынтығы	**3 312 252**	**100,0**

Бірінші кварталда инвестицияланған зейнетақы активтерінің көлемі 17,3 млрд. теңгеге немесе 0,6%-ға азайып, 2013 жылғы 1 сәуірде 3 112,1 млрд. теңге болды.

Жинақтаушы зейнетақы қорларының инвестициялық портфеліндегі ҚР эмитенттерінің мемлекеттік бағалы қағаздарының үлесі инвестицияланған зейнетақы активтерінің жалпы көлемінен 48,8%-ды (1 517,8 млрд. теңге) құрайды және 1 қаңтардағы жағдай бойынша осындай көрсеткішке қатысты 61,6 млрд. теңгеге азайды. ҚР мемлекеттік емес бағалы қағаздарының үлесі 2013 жылғы 1 сәуірдегі жағдай бойынша инвестицияланған зейнетақы активтерінің жалпы көлемінен 27,1%-ды (843,4 млрд. теңге) құрады.

ЖЗҚ-ның жиынтық инвестициялық портфелі

Финансовые инструменты	на 1.01.2013г.		на 1.04.2013г.	
	млн. тенге	%	млн. тенге	%

ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары, оның ішінде	**1 579 388**	**50,5**	**1 517 764**	**48,8**
Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	1 535 409	49,1	1 491 598	47,9
Ұлттық Банктің ноттары	38 417	1,2	20 701	0,7
жергілікті атқарушы органдардың бағалы қағаздары	5 562	0,2	5 465	0,2
Шетел эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары	**160 710**	**5,1**	**133 598**	**4,3**
акциялар	21 214	0,7	17 822	0,6
облигациялар	139 496	4,4	115 776	3,7
Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары	**72 859**	**2,3**	**65 784**	**2,1**
Шетел эмитенттерінің мемлекеттік бағалы қағаздары	**66 652**	**2,1**	**65 734**	**2,1**
Тазартылған алтын	**114 457**	**3,7**	**146 908**	**4,7**
ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде	**810 548**	**25,9**	**843 430**	**27,1**
акциялар	170 407	5,4	178 403	5,7
облигациялар оның ішінде:	640 141	20,5	665 026	21,4
шетелдік валютада номинирленген	78 908	2,5	82 294	2,7
теңгемен номинирленген	561 233	18,0	582 732	18,7
Екінші деңгейдегі банктердегі салымдар	**324 821**	**10,4**	**338 830**	**10,9**
Туынды бағалы қағаздар	**-58**	**0,0**	**34**	**0**
Жиынтығы	**3 129 377**	**100**	**3 112 082**	**100**

Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктеріндегі салымдар көлемі 2013 жылы бірінші тоқсанда 4,3%-ға ұлғайып, 338,8 млрд. теңге болды.

Эмитенттері бағалы қағаздар шығарылымдары бойынша дефолтқа жол берген бағалы қағаздардың үлесі 2013 жылғы 1 қаңтардағы зейнетақы активтерінің жалпы көлемінен 0,5%-ды құрады, бұл абсолютті мән бойынша 15,6 млрд. теңге болды.

Инвестициялық қорлардың саны

	1.01.2012	1.04.2012	1.10.2012	1.01.2013	1.04.2013
Инвестициялық пай қорларының саны, оның ішінде	**152**	**148**	**127**	**126**	**112**
ашық	12	12	11	11	11
жабық	117	113	97	96	84

аралық	23	23	19	19	17
Акционерлік инвестициялық қорлардың саны	**32**	**32**	**32**	**32**	**31**

Инвестициялық пай қорлары пайшыларының саны

	1.04.2012	**1.07.2012**	**1.10.2012**	**1.01.2013**	**1.04.2013**
Инвестициялық пай қорлары пайшыларының саны, оның ішінде	**1 366**	**1 129**	**1 147**	**1 114**	**1 053**
Заңды тұлғалар	56	51	50	46	46
Жеке тұлғалар	1 310	1 078	1 097	1 068	1 007

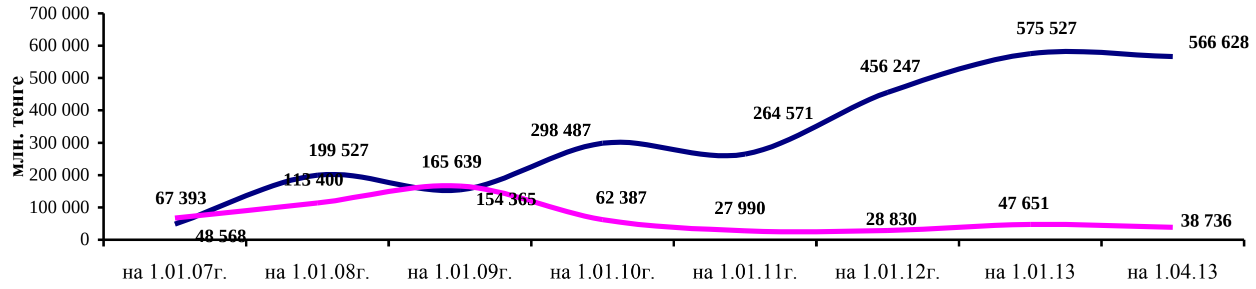
2013 жылғы 1 сәуірдегі инвестициялық қорлар активтері

2013 жылғы 1 сәуірдегі жағдай бойынша инвестициялық пай қорының және акционерлік инвестициялық қорлардың жиынтық активтері тиісінше 566,6 млрд. теңге және 387,7 млрд. теңге болды. Ағымдағы жылғы бірінші тоқсанда инвестициялық пай қорларының активтері 1,5%-ға азайды, акционерлік инвестициялық қорларының активтері 18,7%-ға төмендеді.

(млн. теңге)

	2012 жылғы 1 сәуірде	**2012 жылғы 1 шілдеде**	**2012 жылғы 1 қазанда**	**2013 жылғы 1 қаңтарда**	**2013 жылғы 1 сәуірде**
Инвестициялық пай қорларының саны, оның ішінде	**462 265**	**584 507**	**583 383**	**575 527**	**566 628**
ашық	460 171	582 628	581 453	573 727	564 828
жабық	590	577	584	467	487
аралық	1 504	1 302	1 346	1 333	1 313
Акционерлік инвестициялық қорлардың саны	**33 797**	**30 557**	**30 369**	**47 651**	**38 736**

Инвестициялық қорлар активтерінің өзгеру динамикасы



2013 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:	**4**	**0,0**	**44**	**0,1**
ҚР еурооблигациялары	0	0,0	0	0,0
Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	4	0,0	44	0,1
Ұлттық Банктің ноттары	0	0,0	0	0,0
жергілікті атқарушы органдардың бағалы қағаздары	0	0,0	0	0,0
Екінші деңгейдегі банктердегі салымдар	**3 344**	**0,6**	**135**	**0,3**
Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары	**0**	**0,0**	**0**	**0,0**
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік бағалы қағаздары	**285**	**0,1**	**0**	**0,0**
ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	**7 377**	**1,3**	**3 535**	**9,1**
акциялар	5 849	1,0	1 276	3,3
облигациялар	1 528	0,3	2 259	5,8

Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	**147 413**	**26,0**	**67**	**0,2**
акциялар	6 055	1,1	67	0,2
облигациялар	141 358	24,9	0	0,0
Инвестициялық қорлардың пайлары	**18 658**	**3,3**	**0**	**0,0**
Депозитарлық қолхаттар	**589**	**0,1**	**58**	**0,2**
"Кері РЕПО"операциясы	**560**	**0,1**	**100**	**0,3**
Жер учаскелері	**5 019**	**0,9**	**251**	**0,6**
Үйлер мен ғимараттар	**0**	**0,0**	**10 858**	**28,0**
Жылжымайтын мүліктің салынып жатқан және қайта құрастырылып жатқан объектілері	**0**	**0,0**	**0**	**0,0**
Жобалық-сметалық құжаттама	**0**	**0,0**	**0**	**0,0**
Жерді пайдалану және жер қойнауын пайдалану құқықтары	**0**	**0,0**	**0**	**0,0**
Акционерлік қоғам болып табылмайтын заңды тұлғалардың капиталындағы инвестициялық қордың инвестициялары	**367 315**	**64,8**	**8 092**	**20,9**
Туынды қаржы құралдары	**-1**	**0,0**	**0**	**0,0**
Басқа активтер/дебиторлық берешегі	**16 065**	**2,8**	**15 596**	**40,3**
Жиынтығы:	**566 628**	**100,0**	**38 736**	**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) 65,7% (372,3 млрд.теңге) иеленеді, акционерлік инвестициялық қорларының портфелінде өзге мүлігі 49,5% (19,2 млрд.теңге) иеленеді.

ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары инвестициялық пай қорларының инвестициялық портфелінде 1,3%, акционерлік инвестициялық қорлар портфелінде – 9,1%-ды иеленіп отыр. Шетел

эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздарының ИПҚ-ның жиынтық портфеліндегі үлесі қомақты емес – 26,0% болса және АИҚ-ның портфелінде - 0,2% болды.

2013 жылғы 1 сәуірдегі екінші деңгейдегі банктердің инвестициялық портфелінің құрылымы

Қаржы құралдары	млн. теңге	жиынтығында %-бен
ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары, оның ішінде:	**769 802**	**38,8**
ҚР Ұлттық Банктің ноттары	33 080	1,7
ҚР Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	731 764	36,9
жергілікті атқарушы органдардың бағалы қағаздары	4 958	0,2
Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары	**45 508**	**2,3**
Шет мемлекеттердің бағалы қағаздары	**73 758**	**3,7**
ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	**1 008 886**	**50,8**
акциялар	44 872	2,3
облигациялар	964 014	48,6
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	**87 073**	**4,4**
акциялар	3 457	0,2
облигациялар	83 616	4,2
Жиынтығы:	**1 985 027**	**100**

ЕДБ портфелінің қомақты үлесін ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары – 50,8% немесе 1 008 886 млн. теңге құрайды. ҚР мемлекеттік бағалы қағаздарының үлесіне 38,8%-ы келеді. Шетел эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары жиынтық портфельдің 4,4%-ын, шет мемлекеттердің бағалы қағаздары – 3,7%-ын құрайды.

2013 жылғы 1 сәуірдегі сақтандыру ұйымдарының инвестициялық портфелінің құрылымы

Қаржы құралдары	млн. теңге	жиынтығында %-бен
ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары, оның ішінде:	**67 941**	**18,76**
- ҚР еурооблигациялары	0	0,00

- Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	64 555	17,82
- Ұлттық Банктің ноттары	888	0,25
- жергілікті атқарушы органдарының бағалы қағаздары	2 498	0,69
Екінші деңгейдегі банктердегі салымдар	**117 585**	**32,47**
Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары	**9 403**	**2,60**
Инвестициялық қорлардың пайлары	**261**	**0,07**
Туынды қаржы құралдары	**0**	**0,00**
Шет мемлекеттердің бағалы қағаздары	**8 667**	**2,39**
ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	**140 666**	**38,85**
- акциялар	4 817	1,33
- облигациялар	135 849	37,52
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	**12 336**	**3,41**
- акциялар	1 250	0,35
- облигациялар	11 086	3,06
"Кері РЕПО"операциялары	**5 258**	**1,45**
Жиынтығы:	**362 117**	**100,00**

Есепті күнге сақтандыру ұйымдарының жиынтық инвестициялық портфелінің көлемі 362 117 млн. теңге болды. Бұл ретте екінші деңгейдегі банктердегі салымдарға - 32,47%, ҚР эмитенттерінің корпоративті бағалы қағаздарына – 38,85%, Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздарының үлесіне 18,76%-дан келеді.

2013 жылғы 1 сәуірдегі бағалы қағаздар нарығы кәсіби қатысушыларының инвестициялық портфелінің құрылымы

Қаржы құралдары	млн. теңге	жиынтығында %-бен
ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары, оның ішінде:	4 347	9,9
ҚР еурооблигациялары	0	0,0
Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	4 311	9,9
Ұлттық Банктің ноттары	0	0,0
жергілікті атқарушы органдарының бағалы қағаздары	37	0,1
Екінші деңгейдегі банктердегі салымдар	3 821	8,7
Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары	204	0,5
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік бағалы қағаздары	75	0,2

ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	26 273	60,1
акциялар	11 353	26,0
облигациялар	14 919	34,1
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	6 758	15,5
акциялар	334	0,8
облигациялар	6 424	14,7
Инвестициялық қорлардың пайлары	1 616	3,7
Туынды қаржы құралдары	0	0,0
«Кері РЕПО» операциялары	635	1,5
** Жиынтығы:**	**43 730**	**100,0**

2013 жылғы 1 сәуірдегі жағдай бойынша бағалы қағаздар нарығына кәсіби қатысушылардың жиынтық инвестициялық портфелі 43 730 млн. теңге болды. Портфель құрылымындағы ең көп үлесті ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары иеленеді – 60,1%. ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары – 9,9% құрады, шетел эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары 15,5%-ды құрайды.