



БАСПАСӨЗХАБАРЛАМАСЫ

Алматы қаласы

2018 жылдың 16 мамыры

KASE 2018 жылдың сәуір айына биржалық нарықтың жұмыс қорытындысын ұсынады

"Қазақстан қор биржасы" АҚ (KASE немесе Биржа) 2018 жылдың сәуір айындағы биржалық нарықтың негізгі жұмыс қорытындысы туралы ақпаратты ұсынады.

- 2018 жылдың сәуір айындағы KASE жұмыс қорытындысы бойынша сауда-саттық көлемі 9,9 трлн теңгені құрап, алдыңғы аймен салыстырғанда 2,1 %-ға немесе 212 млрд теңгеге азайды. Көрсеткіштің төмендеуін бағалы қағаздар нарығы (-12 %) мен ақша нарығы (-9,5 %) көрсетті, ал шетел валюталарының нарығы 89,2 %-ға артты.
- 2018 жылдың 01 мамырындағы жағдай бойынша KASE сауда-саттық тізімдерінде 108 эмитенттің 123 атаудағы акциялары болды, олардың төртеуі листингілік емес бағалы қағаздар секторында айналысқа жіберілген.
- Сәуір айында KASE ресми тізіміне "AgroFinance" ЖШС, "ARLAN WAGONS" ЖШС облигациялары және "ҚазМұнайГаз" ҰК" АҚ халықаралық облигацияларын үш шығарылымы жіберілді. Мұның нәтижесінде 2018 жылдың 01 мамырында KASE ресми тізімінде 66 эмитенттің 257 облигациялар шығарылымы болды, ал корпоративтік борыштың жалпы көлемінің айналысы 5,5 %-ға өсіп, 9,1 трлн теңгеге жетті.
- МБҚ бастапқы нарығындағы көлем 7,3 %-ға өсті. Қаржы министрлігі 39,5 млрд теңге тартып, кірістілігі жылдық 8,45-8,66 % диапазонындағы ұзақ мерзімді үш шығарылым орналастырды.

АКЦИЯЛАР НАРЫҒЫ

Биржаның сауда-саттық тізімінде наурыз айының соңында 108 эмитенттің 123 акциялары орналастырылды. Олардың ішінде листингілік емес бағалы қағаздар секторында төрт эмитенттің акцияларының төрт шығарылымы саудаланады. Есептік кезеңде KASE ресми тізімінен эмитенттердің бастамасымен "Уралкалий" КАҚ және "АСЫЛ-ИНВЕСТ" АҚ жай акциялары шығарылды.

KASE акциялар нарығының капитализациясы баға түзетілу ықпалымен сәуір айында 0,7 %-ға немесе 135,4 млрд теңгеге төмендеп, 18,4 трлн теңгеге жетті.

01 мамырдан бастап KASE Индексінің өкілетті тізімінен "Астана Банкі" АҚ жай акциялары шығарылды, олар KASE Индексінің есептеуіне 2018 жылдың 01 ақпанында енгізілген болатын.

KASE Индексі бес айлық өсуін тоқтатып, бір айда 0,02 %-ға 2 436,66 нүкте деңгейіне дейін түсті. Сәуір айындағы ықпал етудің негізгі факторы бірқатар банктердің, атап айтқанда Астана Банкінің төңірегінде туындаған жағдай, сондай-ақ, нарықтық күтілімдермен сәйкес келген дивиденділік төлемдердің анонстары болды. Индекстің өсу көшбасшысы "Қазақтелеком" АҚ акциялары болды, олардың құны 8,9 %-ға өсіп 29 300,00 теңгеге жетті. Телекоммуникациялық компанияның акциялары "Қазақтелеком" АҚ Кселл акцияларының 75 % сатып алуға қатысты Табиғи монополияларды реттеу жөніндегі комитеттің шешімінің алдында өсіп жатыр.

Түсінікті себептермен өсім көшбасшысы "Астана Банкі" АҚ болды, олар 22,3 %-ға арзандап 910,21 теңгені құрады. Капитализацияның едәуір төмендеуі сәуір айының соңында S&P агенттігінің банк рейтингтерінің төмендетуімен қосарланды. S&P пікірі бойынша, осы кезде

"Астана Банкі" АҚ клиенттерінің сенімін жоғалтумен байланысты, өтімділігі елеулі қысымға тап болып отыр.

KASE өкілеттік тізіміне кіретін акциялардың бағасының өзгеруі

Эмитент	Сауда-саттық коды	Бағасы, бір акцияға теңге		Бағаның өзгеруі, %
		01.04.2018	01.05.2018	сәуірде
"Қазақтелеком" АҚ	KZTK	26 900,00	29 300,00	+8,9%
KAZ Minerals PLC	GB_KZMS	3 903,03	4 110,00	+5,3%
"KEGOC" АҚ	KEGC	1 414,00	1 481,98	+4,8%
"Кселл" АҚ	KCEL	1 674,00	1 699,00	+1,5%
"ҚазТрансОйл" АҚ	KZTO	1 552,16	1 564,99	+0,8%
"Банк ЦентрКредит" АҚ	CCBN	303,85	286,88	-5,6%
"Халық Банк" АҚ	HSBK	113,18	102,12	-9,8%
"Астана Банкі" АҚ	ABBN	1 171,00	910,21	-22,3%

Акциялардың сауда-саттық көлемі алдыңғы аймен салыстырғанда 44,3 %-ға немесе 8,6 млрд теңгеге төмендеп, 10,8 млрд теңгені құрады. Сауда-саттықтың орташа күндік көлемі 512,4 млн теңгеден аспады, өткен аймен салыстырғанда 52,2 % азайды. Көлемнің барлығы сатып алу-сату секторында болды. Орналастырулар болған жоқ.

05 сәуірде "ҚазМұнайГаз" АҚ жай акциялары мен жаһандық депозиттік қолхаттарды (ЖДҚ) кері сатып алудың екінші кезеңі аяқталды. Кері сатып алудың осы кезеңі шегінде 15 896 жай акциялар бір акцияға 84,0 АҚШ доллары бағасымен кері сатып алынды. Барлығы 45 өтінім қанағаттандырылып, олардың жалпы сомасы 1,3 млн АҚШ долларын құрады (баламасы 427,1 млн теңге). Компания сондай-ақ 722 485 ЖДҚ 14,0 АҚШ доллары бағасымен жалпы сомасы 10,1 млн долларға (баламасы 3,2 млрд теңге) кері сатып алды. 2018 жылдың 10 мамырынан бастап аталмыш бағалы қағаздар эмитенттің бастамасымен KASE ресми тізімінен шығарылады.

Компанияның хабарламасына сәйкес осы кезде ҚМГ ҰК және ҚМГ БӨ жалпы алғанда 56 210 435 жай акция мен 82 165 972 ЖДҚ тиесілі, бұл айналыстағы жай акциялардың жалпы санынан 99,5% құрайды (соның ішінде ЖДҚ түріндегі жай акцияларды қосқанда) (<http://kase.kz/ru/news/show/1366048/>).

Инвесторлардың негізгі санаттары бойынша ең белсенді жеке тұлғалар болды, олардың шоттарына акциялар айналысының 60,4 % болды. Брокер-дилерлердің үлесі 27,6 %, екінші деңгейдегі банктердің үлесі (ЕДБ) 0,2 %, басқа институционалдық инвесторлардың үлесі – 5,4 %, өзге заңды тұлғаларға 6,3 % тиесілі. Резидент еместердің қатысуы 3,9%.

КОРПОРАТИВТІК ОБЛИГАЦИЯЛАР НАРЫҒЫ

Сәуір айының соңында KASE сауда-саттық тізімдерінде 66 эмитент шығарған 257 атаудағы облигациялар болды. Есептік айда тізімдерге "AgroFinance" ЖШС (AGFNb1), "ARLAN WAGONS" ЖШС (ARWAb2), сондай-ақ "ҚазМұнайГаз" ҰК" АҚ халықаралық облигацияларының үш шығарылымы болды (KMGZe13, KMGZe14 и KMGZe15). Айналыста болу мерзімі аяқталуына байланысты "Цеснабанк" АҚ облигациялары (TSBNb8) және "АСЫЛ-ИНВЕСТ" АҚ облигациялары (ASYLb1) шығарылды.

Сипатталған өзгерістердің нәтижесінде сәуір айында KASE нарықтарында саудаланатын корпоративтік борыштың көлемі 5,5 %-ға немесе 480,5 млрд теңгеге өсіп, номиналды көрсетілімде 9,1 трлн теңгеге жетті.

Корпоративтік облигациялардың кірістілік Индексі KASE_BMY сәуір айында 5 базистік нүктеге төмендеп, жылдық 10,19 % құрады. Индекстің кірістілігі Ұлттық Банктің базалық мөлшерлемесінің қолданыстағы коридорының үстіңгі шегіне жақын тұр (жылдық 9,25 ± 1,0 %). Корпоративтік облигациялардың сауда-саттық көлемі есептік айда 10,8 млрд теңге деңгейінде қалыптасып, алдыңғы аймен салыстырғанда 3,4 %-ға немесе 0,4 млрд теңгеге өсті. Орналастыру секторында есептік айда мәмілелер жасалған жоқ.

Инвесторлардың негізгі санаттары бойынша корпоративтік облигациялар нарығындағы брокер-дилерлердің үлесі 27,1 %, ЕДБ үлесі – 27,0 %, басқа институционалдық инвесторлардың үлесі –

13,4 %, өзге заңды тұлғаларға 29,0 % тиесілі, жеке тұлғалардың үлесі 3,5 %. Резидент еместердің қатысуы 3,3%.

МЕМЛЕКЕТТІК БАҒАЛЫ ҚАҒАЗДАР НАРЫҒЫ (МБҚ)

Қазақстан қор биржасында номиналды құны бойынша саудаланатын мемлекеттік борыш сомасы 11,0 трлн теңгені құрады, бұл наурыз айының қорытындысы бойынша 0,6 %-ға немесе 63,5 млн теңгеге артық.

Сәуір айындағы МБҚ нарығындағы жиынтық сауда-саттық көлемі 73,5 млрд теңгені құрап, наурыз айындағы 82,2 млрд теңгеден 10,6 %-ға азайды. Сауда-саттықтың орташа күндік көлемі 3 500,1 млн теңгені құрады, ал алдыңғы айда бұл көрсеткіш 4 566,5 млн теңге болған.

МБҚ бастапқы нарығында мәмлелердің көлемі 7,3 %-ға немесе 3,0 млрд теңгеге өсіп, 43,5 млрд теңгеге жетті. Есептік айда мемлекеттік бағдарламаларды іске асыру шегінде төрт облыстың әкімдіктері екі жылдық облигацияларын жылдық 0,35 % -бен 4,0 млрд теңгеге орналастырды, Қаржы министрлігі ұзақ мерзімді облигациялардың үш шығарылымын 39,5 млрд теңгеге жылдық 8,45 %, 8,46 % және 8,66 %-бен орналастырды.

Бастапқы нарықтағы инвесторлардың құрылымында ЕДБ үлесі 4,6 %, басқа институционалдық инвесторлар – 86,1 %, өзге заңды тұлғалардың үлесі – 9,3 % болды.

Қайталама нарықтағы сауда-саттық көлемі 30 млрд теңгеге немесе 28 %-ға азайды, алдыңғы айдағы осы көрсеткіш 41,6 млрд теңгені құраған. Қайталама нарықтың жалпы айналымының 89,2 % Ұлттық Банктің ноталарының үлесінде.

2018 жылдың сәуір айында инвесторлардың негізгі санаттары бойынша ЕДБ үлесі – 51,2 %, брокер-дилерлердің үлесі 1,1 %, басқа институционалдық инвесторлардың үлесі – 16,5 %, жеке тұлғалардың үлесі 0,1 % жетер-жетпес. Резидент еместер сауда-саттыққа қатысқан жоқ.

ИНВЕСТИЦИЯЛЫҚ ҚОРЛАРДЫҢ ПАЙЛАРЫ

"Инвестициялық қорлардың бағалы қағаздары" секторында есептік кезеңнің соңында бес компанияның басқаруымен 6 қаржы құралдары болды. Өткен кезеңде сауда-саттық көлемі 35,1 млн теңгені құрады, ол өткен аймен салыстырғанда 9,8 есеге артық. Инвесторлардың негізгі санаттары бойынша жеке тұлғалардың үлесі 42,0 %, брокер-дилерлердің үлесі 0,5 %, өзге заңды тұлғаларға 57,5 % тиесілі

Бағалы қағаздар нарығына жеке тұлғалардың шоттарының қатысуы

2018 жылдың сәуірінде Орталық бағалы қағаздар депозитарийінің есепке алу жүйесінде жеке тұлғалардың атынан ашылған 110 547 жеке шот болды, ол алдыңғы аймен салыстырғанда 346 шотқа артық және 2018 жылдың басына қарағанда 1 302 шотқа артты.

ШЕТ ЕЛДІК ВАЛЮТАЛАР НАРЫҒЫ

Сәуір айында шетел валюталарының нарығына 32 KASE мүшелері қатысты.

2018 жылдың сәуір айында шетел валюталары сауда-саттығының көлемі өткен айдың сәйкес кезеңімен салыстырғанда 89,2 % артып (2 есе) немесе 682,3 млрд теңгеге артты.

АҚШ тарапынан Ресейге қарсы жаңа санкциялар енгізу түріндегі сыртқы шоттар USD/RUB бағамының жоғары өтімділігінің себебі болып, рубльді теңгеге қатысты әлсіретті. Негізгі сауда-саттық серіктестің валютасының әлсізденуі теңгенің долларға қатысты әлсізденуіне белгі болды. Осылайша, 10 сәуір күні сауда-саттық көлемі 807,5 млн долларды құрап, 2014 жылдың желтоқсанынан бастап максимум болып табылды, ал 09 және 11 сәуір аралығындағы доллардың бағамы 10 теңгеден астам өсті. Сәуір айының екінші жартысында бір баррельге 70 АҚШ долларынан астам бағамен сенімді саудаланған, Brent эталонды маркасының жоғарғы баға белгілеулері, нарыққа қатысушылармен еленбеді.

Төмендегі кестеде Қазақстан қор биржасында саудаланған валюталық жұбының негізгі сипаты келтірілген (жақшаның ішінде алдыңғы аймен салыстырғанда сәуір айындағы көрсеткіштің өзгерісі көрсетілген).

Валюталар жұбы	Көлемі, валюта бірлігі, млн	Сауда-саттық көлеміндегі үлесі, %	Мәміле мәні	Мин. және макс. бағамы, валюта бірлігі, теңге	Айдың соңындағы бағам (өзг.%)
USD/KZT	4 367,3 (+84,8 %)	73,3 % (+5,3 %)	7 688 (+1 978)	319,24 – 330,88	327,25 (+2,8 %)
RUB/KZT	1 539,5 (+40,5 %)	25,9 % (-5,7 %)	170 (+83)	5,2100 – 5,5791	5,2850 (-5,1 %)
CNY/KZT	15,0 (+46,3 %)	0,3 % (-0,04 %)	32 (+5)	50,8131 – 52,6800	51,6667 (+1,7 %)
EUR/KZT	7,8 (x4)	0,1 % (+0,1 %)	21 (+15)	392,39 – 409,40	398,12 (+0,2 %)
EUR/USD	26,0	0,4 %	6	1,2073	1,2073

АҚША НАРЫҒЫ

ҚР Ұлттық Банкі 2018 жылдың 16 сәуірінен бастап базалық мөлшерлеменің 25 б.н. жылдық 9,25 % дейін төмендету туралы шешім қабылдады, бұл жыл басынан бастап ақша-несиелік саясатты жұмсарту жағына қарай үшінші рет болып табылады (2018 жылдың басынан бастап -100 б.н.).

Сәуір айының соңында TONIA индикаторы базалық мөлшерлеменен қоса 25 б.н. жылдық 8,26 %-ға дейін төмендеді, бұл айдың ең минималды мәні болып табылады. Сонымен қатар TWINA индикаторы (мерзімі жеті жұмыс күндік репо ашу мәмілелері бойынша орташа сараланған пайыздық мөлшерлеме) 10 б.н. өсіп, жылдық 8,62 % құрады.

Ақша-несиелік саясаттың трансмиссиялық механизмінің тиімділігін арттыру мақсатында, сондай-ақ туынды қаржы құралдар нарығын дамыту үшін, Ұлттық Банк Биржаның сауда-саттық алаңында мерзімі бір күндік валюталық своп операцияларын, өтімділікті ұсыну, сондай-ақ қайтып алу бойынша, жүзеге асыруға кірісу туралы шешім қабылдады. Өтімділікті қайтып алу бір күндік LIBOR мқлшерлемесін қолданумен жүзеге асырылады, ал өтімділікті ұсыну – Ұлттық Банктің базалық мөлшерлемесіне жылдық +2 % бойынша.

Бір күндік SWAP-1D (USD) долларлық своптың кірістілігі сәуір айының соңында жылдық 8,62 % құрап, бір айда 1 б.н. өсті. Екі күндік SWAP-2D (USD) своптың кірістілігі 6 б.н. өсіп, жылдық 8,76 % жетті. SWAP-1D (USD) индикаторының максималды мәні жылдық 11,25 % деңгейінде тіркелді – Ұлттық Банк валюталық своп арқылы ұлттық валютада өтімділік ұсынатын, мөлшерлеменің жоғарғы шегі.

Сәуір айында KazPrime-3M (KZT) индикаторы Ұлттық Банктің базалық мөлшерлемесінің жоғарғы шегіне қарай жылжуын жалғастырып, айды 25 б.н. жылдық 10,25 %-ға дейін төмендеумен аяқтады.

Бір жұмыс күнге ашылған, МБҚ-мен валюталық своп операциялары бойынша мәмілелер көлемі арқылы орташа сараланған кірістілік мәні болып табылатын, ақша нарығының композиттік индикаторы MM_Index, сәуір айының соңында 25 б.н. жылдық 8,26 % төмендеді.

Репо операциялары нарығы

Осы сегменттегі сауда-саттықтың көлемі 5,5 трлн теңгеге жетіп, өткен айдың көрсеткішінен 12,1 % төмен болды. Операциялардың орташа күндік көлемі сәуірде 260,7 млрд теңге болды 2018 жылыдың наурыз айымен салыстырғанда (-24,7%).

Репо ашылу мәмілелері бойынша сауда-саттықтың жалпы көлемінің 96,7 % МБҚ-мен авторепо мәмілелерінің үлесінде болды. МБҚ-мен авторепо нарығындағы ең танымал қаржы құралы мерзімі бір күндік репо операциялары болып қала береді, МБҚ-мен авторепо нарығындағы сауда-саттықтың жалпы көлеміндегі мәмілелердің үлесі 86,1 % құрайды.

2018 жылдың сәуірінде барлығы репо операцияларына 46 Биржа мүшесі қатысты. Осы сегменттегі сауда-саттықтың жалпы айналымының 86 %-дан астамы екінші деңгейдегі банктердің үлесінде. Резидент еместердің қатысу үлесі айтарлықтай болған жоқ, бар-жоғы 0,2 % құрады.

Валюталық своп нарығы

Валюталық своп нарығындағы сауда-саттық көлемі 4,1%-ға азайып, 2,9 трлн теңгені құрады. Операциялардың орташа күндік көлемі 139,0 млрд теңгені құрады, бұл наурыз айындағы осы крсеткішпен салыстырғанда 17,8%-ға төмен. Валюталық своп нарығындағы қаржы құралдар құрылымында сауда-саттықтың жалпы көлемінде 78 % астамы (2,2 трлн теңге немесе 7,1 млрд USD) екі күндік валюталық своппен (USDKZT_0_002) жасалған мәмілелердің үлесінде болды.

ДЕРИВАТИВТЕР НАРЫҒЫ

Осы кезде биржалық нарықтың осы секторында, базалық активі АҚШ доллары, KASE Индексі және акциялардың жеке атаулары болып табылатын, фьючерстер саудалауға қолжетімді. Сәуір айында фьючерстермен мәмілелер жасалған жоқ. Мамыр айының басында деривативтер нарығында сауда-саттыққа қатысушылардың ашылған жайғасымдары болған жоқ.

Анықтама үшін

"Қазақстан қор биржасы" АҚ (KASE) қаржы нарығында қызмет атқаратын, Орта Азия аймағындағы жетекші және Қазақстандағы жалғыз қор биржасы болып табылады. Бұл репо нарығы құралдары, шет елдік валюта, мемлекеттік және корпоративтік бағалы қағаздар нарығындағы, халықаралық қаржы институттары, сондай-ақ туынды құралдар облигациялары үшін әмбебап сауда-саттық құралы болып табылады.

KASE Халықаралық федерациялар биржасының (WFE), Еуро-Азиялық қор биржасы Федерациясының (FEAS) және басқа да халықаралық және отандық кәсіби бірлестіктердің мүшесі болып табылады. KASE 2015 жылы БҰҰ "Қор нарығы тұрақты даму үшін" атты бастамасына қосылды. KASE ТМД елдерінің арасында бағалы қағаздармен сауда-саттық бойынша 2 орынға ие болды, сондай-ақ FEAS биржаларының акциялар нарығын қаржыландыру бойынша бестікке кірді.

Қосымша ақпарат: +7 (727) 237 5342, pr@kase.kz