

"ҚАЗАҚСТАН ҚОР БИРЖАСЫ" АҚ

БАСПАСӨЗ – ХАБАРЛАМАСЫ

Алматы қаласы

2017 жылдың 08 қарашасы

KASE 2017 жылдың қазан айына биржалық нарықтың жұмыс қорытындысын ұсынады

"Қазақстан қор биржасы" АҚ (KASE немесе Биржа) 2017 жылдың қазан айындағы биржалық нарықтың негізгі жұмыс қорытындысы туралы ақпаратты ұсынады.

- Қазан айында Қазақстан қор биржасында сауда-саттықтың жиынтық көлемі алдыңғы аймен салыстырғанда 8 % өсіп, 10 954,0 млрд теңгені құрады. Бағалы қағаздар нарығында өсім байқалады (6 есе), ол корпоративтік облигациялар секторында (9 есе) және МБҚ секторында (3 есе), сондай-ақ қаржы нарығы (+4 %) секторында сауда-саттық көлемі едәуір өсуіне байланысты болып отыр.
- Корпоративтік облигациялар нарығында алғашқы орналастыру көлемі 14 есе өсіп, 381 млрд теңгені құрады, қайталама нарықта сауда-саттық көлемі 2 есе өсіп, 45,9 млрд теңгені құрады.
- Алғашқы МБҚ нарығында арнайы мамандандырылған сауда-саттық көлемі 24 есе өсіп, 169,1 млрд теңгені құрады
- Листингілеу рәсімінен бес шығарылым облигациялары мен бір акциялар шығарылымы өтті.

БАҒАЛЫ ҚАҒАЗДАР НАРЫҒЫ

Қазан айында бағалы қағаздармен жүргізілген сауда-саттықтың жалпы көлемі 642,5 млрд теңгеге жетті, ол алдыңғы айдың қорытындысына қарағанда 527,6 млрд теңгеге немесе 6 есе артық. Көрсеткіштің өсуі Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкі жүзеге асырып жатқан, банк секторының қаржылық тұрақтылығын арттыру бағдарламасы аясында, жалпы сомасы 350 млрд теңге, субординацияланған облигацияларды үш банктің ("АТФБанк" АҚ, "Еуразиялық банк" АҚ, "Цеснабанк" АҚ) орналастырумен байланысты.

Акциялар нарығы

2017 жылдың 01 қарашасында Биржаның сауда-саттық тізімінде 111 эмитенттің 129 атаулы акциялары орналасқан. Есеп берген айда "Exploration Production АЛМЭКС" АҚ жай акциялары листингілеу рәсімінен өтті, оның негізгі қызметі көмірқышқыл шикізатына геологиялық барлау және зерттеу жүргізумен байланысты.

KASE Индекс

Қазан айының қорытындысы бойынша KASE Индексінің мәні 0,3 % төмендеп, 2 043,1 нүктеге жетті. KASE Индексінің қоржынына кіретін акциялар әр түрлі бағыттағы динамиканы көрсетті.

KASE өкілеттік тізіміне кіретін, акциялардың бағасының өзгеруі

Эмитент	Сауда-саттық коды	Бағасы, бір акцияға теңге			баға өзгеруі, теңге	
		01.01.17	01.10.17	01.11.17	қазанда	2017 жылы
"Қазақтелеком" АҚ	KZTK	14 522,97	19 099,98	19 860,00	+4,0	+36,7
"KEGOC" АҚ	KEGC	1 192,15	1 380,00	1 431,99	+3,8	+20,1
KAZ Minerals PLC	GB_KZMS	1 511,00	3 481,00	3 603,01	+3,5	+138,5
"Банк ЦентрКредит" АҚ	CCBN	168,41	158,50	162,53	+2,5	-3,5
"КазТрансОйл" АҚ	KZTO	1 231,00	1 325,00	1 320,35	-0,4	+7,3
"ҚазМұнайГаз" Барлау Өндіру АҚ	RDGZ	15 270,00	20 480,00	20 388,35	-0,4	+33,5
"Қазақстанның Халық Жинақ Банкі" АҚ	HSBK	50,34	81,07	77,43	-4,5	+53,8
"Кселл" АҚ	KCEL	1 102,01	1 920,00	1 817,00	-5,4	+64,9

"Қазақтелеком" АҚ акциялары өсім бойынша алдыңғы қатарда болды, оның бағасы Standard & Poor's агенттігінің рейтингілік бағасын жақсарту жағдайында 4,0 %-ға дейін өсіп, 19 860 теңгені құрады. Бағаның өсу себебі 2017 жылдың 9 айына компанияның қаржылық есептілігін жариялауы, сондай-ақ Standard & Poor's агенттігінің "Қазақтелеком" АҚ несие рейтингін BB деңгейінен BB+ деңгейіне, ал болжамды "Позитивті" деңгейінен "Тұрақты" деңгейіне өзгертуі болып табылады.

Қазан айында "Кселл" АҚ акцияларының бағалары төмендей түсті, құны – 5,4 % төмендеп, 1 817,0 теңгені құрады. Акция бағасы қыркүйек айында компанияны түрік телекоммуникациялық алыбы Turkcell компаниясы қазіргі иесі – TeliaSonera-дан сатып алады екен деген инвесторлардың әңгімесі кеңінен таралған соң, өсіп барып тоқтады.

Акциялар нарығын қаржыландыру қазан айында 0,8 %, немесе 138,3 млрд теңгеден 16 748,1 млрд теңгеге дейін өсті. Өсім көрсеткішін "Қаржы" (+168,7 млрд теңге немесе 8,8 %) компаниясы секторлары қамтамасыз етті, ол "Казкоммерцбанк" АҚ жай акцияларын артықшылықты сатып алу құқығы бойыша 1,3 млрд, "Материалдар" (+9,1 млрд теңге или 0,5 %) және "Денсаулық сақтау" (6,2 млрд теңге или 44,2 %).

Қазан айында акциялармен сауда-саттық көлемі 15,2 млрд теңгені құрап, қыркүйек айымен салыстырғанда 3,8 млрд теңгеге немесе 32,7 % артты. Сауда-саттықтың орташа күндік көлемі 0,8 млрд теңгеге тең, алдыңғы айда 0,6 млрд теңге болған. Барлық мәмілелер қайталама нарықта орындалды.

Инвесторлардың негізгі санатында қазан айында акциялар секторында неғұрлым белсенділері жеке тұлғалар болып табылады, олардың шоттарына 46,6 % акциялар айналымынан келеді. Брокер-дилерлердің үлесі 23,1 %, екінші деңгейдегі банктердің үлесі (ЕДБ) 0,02 %, өзгеинституционалдық инвесторларға – 1,6 %, өзге заңды тұлғалардың үлесі – 28,7 %. Бейрезиденттердің қатысуы 16 % бағаланады, олардың 12,2% заңды тұлғаларға келді, институционалдық инвестор болып табылмайтындарға – 3,1 %, жеке тұлғаларға брокерлерге – 0,6 % айналды.

Корпоративтік облигациялар нарығы

Қазан айының соңында KASE сауда-саттық тізімінде 68 эмитенттің 269 облигациялары атауы болды. Есептік кезеңде "АТФБанк" АҚ, "Еуразиялық банк", "Банк ЦентрКредит" АҚ, "Цеснабанк" АҚ және "Қазақстан темір жолы" Ұлттық компаниясы" АҚ борыштық бағалы қағаздарының бес шығарылымы листингілеуден өтті.

Қазан айында саудаланған корпоративтік борыш көлемі 1 % өсіп, 8 846,9 млрд теңгеге жетті.

Есептік кезеңде корпоративтік облигациялармен сауда-саттықтың жиынтық көлемі 426,9 млрд теңгені көрсетті және алдыңғы айға қарағанда 379,7 млрд теңгеге немесе 9 есе артқанын байқаймыз. Сауда-саттықтың орташа көлемі 19 405,1 млн теңгені құрады, қыркүйек айына қарағанда 8 есе өсті.

Корпоративтік облигациялардың алғашқы нарығы көлемі 381,0 млрд теңгеге жетті, ол 353 млрд теңгеге немесе 13,6 есе артты. Корпоративтік облигациялардың алғашқы нарығында арнайы мамандандырылған сауда-саттық аясында келесі шығарылымдар орналастырылды:

- Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкі жүзеге асырып жатқан, банк секторының қаржылық тұрақтылығын арттыру бағдарламасы аясында, жалпы сомасы 350 млрд теңге, өтеу кірістілігі жылдық 4,00 %, субординацияланған 15 жылдық облигацияларды "АТФБанк" АҚ, "Еуразиялық банк" АҚ, "Цеснабанк" АҚ орналастырды;
- "Компания Фазтон" ЖШС өтеу кірістілігі жылдық 13,49 % жеті жылдық облигацияларды орналастырып, 1,1 млрд теңге тартты;
- "Хоум Кредит энд Финанс Банк" Еншілес Банкі АҚ екі жылдық облигацияларды жылдық 13 % орналастырып, 5,0 млрд теңгені тартты.

"Қазақстан темір жолы" Ұлттық компаниясы" АҚ өзінің облигацияларын оларға жазылым жүргізу арқылы жылдық 11,0 % орналастыра отырып, 25,0 млрд теңгені тартты.

Корпоративтік облигациялардың қайталама нарықтағы сауда-саттық көлемі 2,4 есе немесе 26,7 млрд теңгеден 45,9 млрд теңгеге дейін артты. Бұл көлемнің 60 %-дан астамын сатып алынған "Қазақтелеком" АҚ облигациялары құрады. Осыған дейін компания Директорлар кеңесінің 12 136 865 екінші шығарылым облигацияларын мерзімінен бұрын сатып алғаны жөніндегі шешімі туралы хабарлаған.

KASE_BMY және KASE_BAY индикаторларының кірістілігі мәні бір айда 9 б.н төмендеп, жылдық 10,17 % және сәйкесінше 1 б.н. жылдық 11,13 % дейін төмендеді. Корпоративтік облигациялардың кірістілігінің төмендеу үрдісі тәуекелсіз қысқ кірістіліктің базалық мөлшерлемесі бойынша дәліздің төменгі шекарасына жетуімен байланысты болды. Қыркүйек айының соңында Ұлттық банкінің жеті күндік ноттарының кірістілігі мәні 9,2509 % құрады, ол қазан айындағы корпоративтік облигациялардың кірістілігі деңгейіне ықпал етті.

Инвесторлардың негізгі санатында корпоративтік облигациялар секторының 24,5 % брокерлік-дилерлік компанияларға, 1,7 % – ЕДБ, 13,3 % – өзге институционалды инвесторларға, 56,8 % – өзге заңды тұлғаларға, 3,8 % – жеке тұлғаларға келді. Бейрезиденттердің үлесі жалпы корпоративтік облигациялармен сауда-саттықтың жалпы көлемінен 3,3 % құрады.

Мемлекеттік бағалы қағаздар нарығы (МБҚ)

Қазан айында МБҚ нарығындағы сауда-саттық көлемі 3 есе артып, 180,3 млрд теңгені құрауы қыркүйек айындағы алғашқы орналастыруды арттыру себебіне тікелей қатысты болды. Алғашқы нарық көлемі 169,1 млрд теңгені құрады, ол қыркүйек айындағы көрсеткішке қарағанда 24 есе көп. Қазан айында мемлекеттік және үкіметтік бағдарламаларды жүзеге асыру аясында тұрған үйлерді қаржыландыру мақсатында сегіз облыстың және Астана қаласының әкімдіктері өздерінің сомасы 30,7 млрд теңгеге муниципалдық облигацияларын жылдық 0,35 % орналастырды.

Қаржы министрлігінің қазынашылық облигацияларының үш шығарылымын орналастыруға 138,5 млрд теңгеден келді.

Инвесторлар құрылымында МБҚ ЕБД орналастыру кезінде 8 %-дан келді, өзге институционалды инвесторларға – 56,3 %, 35,7 % өзге заңды тұлғалар сатып алды.

Қайталама нарықта сауда-саттық көлемі 77,1 %-ға, 48,9 млрд теңгеден 11,2 млрд теңгеге дейін төмендеді. Ұлттық Банктің ноттарымен мәмілеге 9,4 млрд теңгеден немесе қайталама нарықтың жалпы көлемінен 83,8 % келді.

Қазан айында қайталама нарықта инвесторлар құрылымында неғұрлым белсенді қатысушылар ЕДБ болды, олардың үлесі - 74,9 %, өзге институционалдық инвесторларға – 23,9 %, брокерлік-дилерлік компанияларға – 1,2 %. Өзге заңды, жеке тұлғалар мемлекеттік бағалы қағаздармен сауда-саттыққа қатысқан жоқ.

ХҚҰ облигациялары

Есептік кезеңнің соңына қарай Биржаның сауда-саттық тізімінде екі халықаралық қаржы ұйымдары – Еуразиялық даму банкі мен Еуропалық қайта құру және даму банкі облигацияларының тоғыз шығарылымы болды. Есептік кезеңде Еуразиялық даму банкі өтеу кірістілігі жылдық 9,40 %, үш жылдық облигацияларын орналастырып, 20,0 млрд теңге тартты.

Бағалы қағаздар нарығындағы жеке тұлғалардың шоты

Қазан айының соңында Бағалы қағаздардың орталық депозитарийінің есепке алу шоты жүйесінде жеке тұлғалардың ашқан 108 644 жеке шоттары тіркелген, ол алдыңғы айға қарағанда 222 шотқа аз, ал 2017 жылдың басымен салыстырғанда 3 325 шотқа артық.

Шет елдік валюталар нарығы

Қазан айында шет елдік валюталармен сауда-саттығы көлемі 1,22 трлн теңгені құрады, ол алдыңғы айдың қорытындысымен салыстырғанда 4,4 % немесе 56,7 млрд теңгеге аз.

Төмендегі кестеде есептік кезеңде KASE сатылатын валюталық жұптардың негізгі сипаттамасы келтірілген (жақшаның шінінде көрсеткіштердің алдыңғы айға қарағанда өзгеруі көрсетілген, бағамның өзгеруі шет елдік валютаның теңгеге орташа сараланған биржалық бағамының номиналдық өзгеруін көрсетеді).

Жұп	Көлемі, млн валюта бірлігі	Сауда-саттық көлеміндегі үлесі, %	Мәміле саны	Мин. және макс. бағамы, валюта бірлігіне теңге	Айдың соңындағы бағамы (өзг. %)
USD/KZT	3 599,34 (+5,7 %)	71,6 % (+57,4 %)	11 104 (+3 823)	319,00–342,14	334,48 (-2,0 %)
EUR/KZT	2,4 (+4,4 %)	0,05 % (+4 б.п.)	15 (-1)	365,55–406,50	388,55 (-3,4 %)
RUB/KZT	1 423,9 (-93,1 %)	28,3 % (-57,7 %)	238 (-86)	5,3910–5,9600	5,7684 (-2,0 %)
CNY/KZT	4,1 (-53,2 %)	0,08 % (+4 б.п.)	33 (-39)	47,4600–52,3400	50,3000 (-1,7 %)

Қаржы нарығы (репо операциялары мен валюталық своп)

Қазан айының ішінде қаржы нарығының мөлшерлемесі бұрынғы деңгейінде қалды, яғни Ұлттық банктің 10 қазанда сақтаған базалық мөлшерлеме дәлізінің төменгі шекарасында 10,25 (+/-1%) деңгейінде сақталды. Бір айдың ішінде MM_Index және TONIA индикаторының мәні аз ғана төмендеді, 7 базистік нүктеден 6 базистік нүктеге дейін, сәйкесінше жылдық 9,26 %. TWINA Индикаторы керісінше 3 б.н. өскенін байқаймыз, 9,24 жылдық 9,27 % дейін. Қаржы нарығында бұрынғы дәлізде мөлшерлемені сақтауды қаржының МБҚ және шет елдік валюта кепілдігімен қарызға алуда әділ құны нарығында орналасуы деп бағалауға болады. Ұлттық банктің қазан айында қарыз беру көлемі 5 379 млрд теңгені құрады, сонымен қатар тарту мөлшерлемесі жылдық 8,72 -дан 9,33 % -ға дейін түрленді.

Бір күндік долларлық своп кірістілігі қазан айының соңында 9,27 % деңгейінде қалды, екі күндік долларлық своп кірістілігі 7 б.н. өсіп, жылдық 9,35 % құрады. Соңғы 30 күннің ішінде валюталық своп нарығындағы мөлшерлеме жылдық 8,75 – 9,6 % дәлізінде өзгерді.

Осы индикаторды қалыптастыру туралы Келісімге қатысушы банктер арасында банкаралық нарық депозиттеріне орналастыру кезінде ақша құнының көрсеткіштерін белгілейтін KazPrime-3М Индикаторы (KZT) бір айдың ішінде өзгеріссіз болды.

Қазан айында қаржы нарығындағы сауда-саттықтың жиынтық көлемі 4 % өсіп, 9,1 трлн теңгені құрады. Repo операциялары нарығының үлесіне 70 %-дан келді.

Сауда-саттық көлемі қыркүйек айының деңгейінде – 6,5 трлн теңгені құрады, ол алдыңғы аймен салыстырғанда -0,4 %. Операциялардың орташа күнді деңгейі 324,9 млрд теңгеге тең (-0,4 %).

Repo ашудың жалпы көлемінен 90 % -дан астамы МБҚ авторепоға келеді. Бір күндік мерзімдегі репо неғұрлым танымал құрал ретінде қалады, МБҚ авторепо нарығындағы сауда-саттықтың жалпы көлемі 96,7 % құрады.

Барлығы репо нарығындағы мәмілеге Бираның 43 мүшесі қатысты. Осы сегменттегі сауда-саттықтың жалпы айналымының 50 % -дан астамы екінші деңгейдегі банктердің үлесіне тиісілі. Осы секторға қатысатын бейрезиденттердің үлесі аз ғана, 0,02 % тең.

Валюталық своп нарығындағы сауда-саттық көлемі 17 % өсіп, 2,6 трлн теңгені құрады. Валюталық своп операциясының заты тек қана АҚШ доллары болып табылады. Жалпы сауда-саттық көлемінің 90 % USDKZT_0_002 құралымен жасалатын мәміле құрайды. Операциялардың орташа күндік көлемі – 129,6 млрд теңге, ол алдыңғы аймен салыстырғанда 17 % артық.

Фьючерстер

Қазіргі уақытта биржалық нарықтың осы секторында сауда-саттыққа фьючерстер жүреді, базалық активі АҚШ доллары, KASE Индексі, өзге акциялар атауы болып табылады. Барлығы – 17 құрал. Қазан айында аталмыш сегментте мәміле жасалған жоқ. Қараша айының басында KASE ашылған позициялар сомасы 8,6 млрд теңгелік, 25 000 шартты құрады.

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