

"ҚАЗАҚСТАН ҚОР БИРЖАСЫ" АҚ

Б А С П А С Ө З М Ә Л І М Д Е М Е С І

Алматы қ.

11 мамыр 2017 жыл

KASE 2017 жылдың сәуіріндегі қорытындыларды жариялады

"Қазақстан қор биржасы" АҚ (KASE) 2017 жылдың сәуір айындағы қызметінің негізгі қорытындылары туралы ақпараттандырады.

Сәуірдің қорытындылары бойынша KASE сауда-саттықтарының жалпы көлемі 14 395,6 млрд теңгеге жетті. Алдыңғы жылмен салыстырғанда өсім 4,1 % немесе 571,3 млрд теңгені құрады. Негізгі өсімді ақша нарығы (+520,8 млрд теңге) мен бағалы қағаздар нарығы (+95,7 млрд теңге) қамтамасыз етті.

Бағалы қағаздар нарығы

Биржалық нарықтың осы секторында сәуір айы бойы 49 KASE мүшесі жұмыс жасады. Бағалы қағаздар сауда-саттықтарының жалпы көлемі 120,4 млрд теңгеге жетіп, алдыңғы айдан 387,5 %-ға немесе 95,7 млрд теңге артты.

Акциялар

Айдың соңында Биржаның сауда-саттық тізімдерінде 102 эмитенттің 120 атаудағы акциялары болды, соның ішінде листингтік емес сауда алаңында – төрт компанияның төрт атаудағы акциялары.

KASE Индексі үш айы бойы қатарынан қапталдағы трендте болып, оның мәні бір айда 0,5 % төмендеді. Сәуірдегі ықпал еткен факторлар дивиденділік төлемдердің анонсы болды, олар нарықтың күтімінен төмен болып шықты. Индекстің өсімінің көшбасшысы KAZ Minerals PLC акциялары болды, олардың құны 11,8 %-ға 2 015 теңгеге дейін өсті. Компания үстіміздегі жылдың бірінші тоқсанына мықты нәтижелер жариялады, бұл акциялардың баға белгілеуіне қолдау көрсетті. Құлаудың көшбасшысы "Қазақтелеком" АҚ акциялары болды, олар 9,2 %-ға арзандап, 15 615 теңгеге дейін түсті. Акциялар құнының төмендеуі АЖЖЖ шешімінің жобасын жариялау аясында болып отыр. Дивиденд көлемі акционерлердің күтімінен елеулі төмен болды, себебі тоқтаған қызметінен түскен кірісті есептеусіз қалыптастырылған болатын.

Бағалардың өзгеруі ықпалымен KASE акциялар нарығының капитализациясы сәуір айында 0,9 %-ға немесе 129,9 млрд теңгеге төмендеп, 14,6 трлн теңгегені құрады.

Акциялардың сауда-саттық көлемі алдыңғы жылмен салыстырғанда 59,4 %-ға немесе 6,8 млрд теңгеге өсіп, 18,3 млрд теңгені құрады. Сауда-саттықтың орташа күндік көлемі 232,1 млн теңгеге жетіп, алдыңғы аймен салыстырғанда 19 % өсті. Көлемнің барлығы сатып алу-сату секторында болды. Сәуірде орналастырулар мен жазылымдар болған жоқ.

Инвесторлардың негізгі санаттары бойынша ең белсенді жеке тұлғалар болды, олардың шоттарының акциялар айналысындағы үлесі 49,7 % құрады. Брокерлер-дилерлердің үлесі 21,4 % құрады, екінші деңгейдегі банктердің (ЕДБ) шоттарының үлесі 0,7 %, басқа институционалдық инвесторлардың шоттары – 1,0 %, өзге заңды тұлғалардың шоттарының үлесі 27,2 % жетті.

Корпоративтік облигациялар

Сәуірдің соңында KASE сауда-саттық тізімдерінде 67 эмитент шығарған 262 атаудағы облигациялар болды. Есептік айда "ҚазМұнайГаз" ҰК" АҚ халықаралық облигацияларының үш шығарылымы, сондай-ақ, "Компания Фазтон" АҚ облигациялары енгізілді. Айналыста болу мерзімі аяқталуына байланысты "Қазақстандық Ипотекалық Компаниясы" ИҰ" АҚ, "Алматинские электрические станции" АҚ, "Цеснабанк" АҚ және "Банк ЦентрКредит" АҚ бір-бір облигациялары шығарылды. Сипатталған өзгерістердің нәтижесі сәуір айында Биржада саудаланатын корпоративтік борыш көлемінің 0,8 %-ға немесе 60 млрд теңгеге, номиналды мәні 7,7 трлн теңгеге дейін төмендеуі болды.

Корпоративтік облигациялардың кірістілік индексі KASE_BY сәуір айында 40 базистік нүктеге өсіп, жылдық 10,28 % құрады, осылайша Ұлттық Банктің базалық мөлшерлемесінің қолданыстағы шектеріне қайта оралды (жылдық $11,0 \pm 1,0$ %). Осы деңгейге индекс ағымдағы жыл бойы төменнен жоғары қарай бірте-бірте жылжып, сәуірдің соңында жылдық максимумға жетті. KASE_BY мәні мен индекстелмеген үш жылдық МЕКАМ дағдарыссыз кірістілік мөлшерлемесі арасындағы спрэд (KASE_BY өкілетті тізіміне енгізілген, облигациялардың орташа сараланған дюрациясы 1182 күнді құрайды) алдыңғы айдың соңынан 64-тен есептік айдың соңында +88 базистік нүктеге жетті.

Корпоративтік облигациялар сауда-саттықтарының көлемі есептік айда 10,0 млрд теңге деңгейінде қалыптасып, алдыңғы аймен салыстырғанда 4,74 есеге немесе 7,9 млрд теңгеге өсті. Сауда-саттықтардың орташа күндік көлемі 499,2 млн теңгені құрап, 4,5 есеге өсті.

Облигациялар сауда-саттықтарының осыншама елеулі өсімі негізінен 03 сәуірде "Қазақстандық Ипотекалық Компания" ИҰ" АҚ үш жылдық облигацияларын 5,9 млрд теңге сомасына орналастырылуы есебінен болды. Орналастыру кезіндегі кірістілік жылдық 10,75 % құрады, сауда-саттыққа 6 қатысушы қатысып, сұраным ұсынымнан 2,35 есеге артты.

Қайталама нарықтағы сауда-саттықтың көлемі 4,1 млрд теңгені құрады, бұл алдыңғы айдағы нәтижеден 94,5 % немесе 2,0 млрд теңгеге артық.

Корпоративтік облигациялар нарығындағы инвесторлардың негізгі санаттары бойынша брокерлер-дилерлердің үлесі – 40,7 %, ЕДБ – 12,1 %, өзге институционалдық инвесторлар – 8,6 %, өзге заңды тұлғалар – 24,0 %, жеке тұлғалардың үлесі 14,5 % құрады.

Мемлекеттік бағалы қағаздар (МБҚ)

Биржалық нарықтың осы секторында индекстелмеген МБҚ тәуекелсіз кірістіліктің қисық сызығының конфигурациясына ықпал еткен, уақиғалар орын алды. Сәуір айы бойы бастапқы және қайталама нарықта мәмілелер жасасу, сондай-ақ, Биржа аталмыш қисық сызықты құру үшін қолданатын, өкілетті іріктелімнен ескі мәмілелердің шығуы өтеуге дейін нөлден бес жылға дейін мерзімінде қисық сызықтың 50-170 базистік нүктеге төмендеуіне әкеп соқтырды. Кірістілікті ең көп төмендеуі өтеуге дейін мерзімі 1-3 жыл бағалы қағаздар үшін болды, ал өтеуге дейін 5-15и жыл қалған облигациялар үшін нарықтық бағалау өзгерген жоқ.

Биржадағы МБҚ сауда-саттықтарының жиынтық көлемі сәуір айында 91,8 млрд теңгеге жетті, бұл алдыңғы айдың нәтижесінен 8,3 есеге немесе 80,8 млрд теңгеге артық.

Бастапқы нарықтағы сауда-саттықтардың көлемі 22 есеге дейін өсіп, 69,9 млрд теңге деңгейіне жетті. Олардың 56,1 млрд теңгесі – Қазақстан Республикасының Қаржы министрлігінің екі-төрт жылдық МЕКАМ жылдық 9,1–9,6 %-бен орналастырулары арқылы тартқан қаржысы. Қалған 13,7 млрд теңгені 10 облыстың әкімдіктерінің тұрғын үй құрылысын қаржыландыру бойынша мемлекеттік бағдарлама шегінде тартқан қаржысы.

МБҚ бастапқы нарығындағы сатып алушылардың құрылымында 56,1 % ЕДБ еншісінде, брокерлер-дилерлер бір пайызға жуығын сатып алды, 8,3 % өзге институционалдық инвесторлардың еншісінде болды. Қалған 35,6 % – өзге заңды тұлғалардың үлесі, бұл корпоративтік инвесторлардың МБҚ секторына қызығушылығын анық көрсетеді.

МБҚ қайталама нарығының көлемі 14,1 млрд теңгеге немесе 2,7 есеге өсіп, 22 млрд теңгеге жетті. Сауда-саттықтардың орташа күндік көлемі 144,9 млн теңгеге өсіп, алдыңғы айдың нәтижесін 2 есе артып, 278,1 млн теңгеге жетті.

Қайталама нарықтың сауда-саттық айналысының 100 % жуығы Ұлттық Банктің ноталарының еншісінде болды.

МБҚ қайталама нарығындағы инвесторлардың негізгі санаттарының құрылымы бойынша брутто-айналымның 62,1 % ЕДБ еншісінде, 0,3 % –брокерлер-дилерлер, 22,4 % – өзге институционалдық инвесторлар және 15,2 % өзге заңды тұлғалар болды. Жеке тұлғалар МБҚ нарығында мәмілелер жасасқан жоқ.

Инвестициялық қорлардың бағалы қағаздары

Былтыр белсендірілген осы секторда әлі төрт атаудағы бағалы қағаздар саудаланады. Сауда-саттықтардың жиынтық көлемі сәуір айында 228,6 млн теңгені құрады, ал наурыз айында мәмілелер жасалған жоқ. Сауда-саттықтың ең үлкен көлемі – 176,4 млн теңге немесе сектор айналымының 77,2 % – "Сентрас Секьюритиз" АҚ басқаруындағы "Фонд еврооблигаций" инвестициялық қордың еншісінде болды.

Шетел валюталарының нарығы

Сәуір айында шетел валюталарымен жұмыс жасауға 34 KASE мүшелері құқылы болды.

Осы сектордағы спот нарығының сауда-саттық көлемі 852,3 млрд теңге баламасы деңгейінде болды, бұл алдыңғы айдың нәтижесінен 5,0 % немесе 45,2 млрд теңгеге кем.

Төмендегі кестеде Биржада саудаланатын валюталық жұптардың негізгі сипаттамалары көрсетілген (жақшада алдыңғы аймен салыстырғандағы өзгерістер көрсетілген, бағамның өзгеруі шетел валютасының теңгеге бағамының өзгеруін белгілейді).

Жұп	Көлемі, млн валюта бірлігі	Сауда-саттық көлеміндегі үлесі, %	Мәмілелер саны	Қатысушылар саны	Бағамның өзгеруі	Жұп
USD/K ZT	2 709,0 (-4,0 %)	99,3 % (-0,14 п.п.)	5 677 (-539)	33 (0)	310,66–314,40	314,40 (+0,2 %)
RUB/K ZT	722,5 (+5,7 %)	0,5 % (+0,05 п.п.)	144 (-10)	14 (-1)	5,4503–5,5885	5,5194 (+1,0 %)
EUR/K ZT	5,6 (+70,8 %)	0,2 % (+0,09 п.п.)	26 (+9)	6 (+2)	330,00–342,40	342,30 (-1,5 %)
CNY/K ZT	10,5 (-20,5 %)	0,1 % (-0,01 п.п.)	94 (-38)	5 (-3)	45,1863–45,6500	45,6500 (+0,1 %)

Ақша нарығы (репо және своп)

Сәуір айындағы ақшалардың биржалық нарығының бағалық көрсеткіштері өзгерген жоқ десе болады. KazPrime-3M (KZT) жылдық 12 % деңгейінде қалды. MM_Index мәні 10 базистік нүктеге түсіп жылдық 10,12 % құрады. TONIA да сондай-ақ өзгеріп, айдың соңында осы индикатордың мәні жылдық 10,14 % құрады, TWINA 50 базистік нүктеге төмендеп жылдық 10,31 % құрады. Долларлық своп нарығында ғана ең қысқа теңгенің құны жағына қарай өзгеріп, айдың соңында 200 базистік нүктеге жоғарылап –жылдық 9,50 % құрады.

Ақша нарығындағы жиынтық сауда-саттық көлемі 13 422,9 млрд теңге деңгейіне жетіп, алдыңғы аймен салыстырғанда 4,0 % немесе 520,8 млрд теңгеге өсті.

Репо операциялары

KASE ақша нарығының осы сегментіндегі сауда-саттық көлемі сәуір айында 5 730,4 млрд теңгеден аспады, наурыз айының көрсеткішінен 4,8 % немесе 291 млрд теңгеге азайды. Осы

көлемнің 86,7 % отМБҚ-мен авторепо, 31,1 % – ББҚ-мен авторепо, ал қалғаны – ББҚ-мен тікелей авторепо болды. Айналым құрылымы наурыз айымен салыстырғанда айтарлықтай өзгеріске ұшыраған жоқ.

Репо операцияларының орташа күндік көлемі 293,7 млрд теңгені құрады, бұл өткен айдың көрсеткішінен 7,3 % немесе 23,2 млрд теңгеге төмен.

Биржадағы репо операцияларын Биржаның 46 мүшесі өткізді. Бұл ретте МБҚ-мен авторепо секторында айналымның 82,5 % ЕДБ еншісінде, ББҚ-мен авторепо секторында 46,6 % брокерлердің, 53,4 % – олардың клиенттерінің шоттарының еншісінде.

Валюталық своп операциялары

Алдыңғы айдағыдай, сәуір айында осы тұрпаттағы операциялар Биржада бір күндік және екі күндік теңгеге АҚШ долларымен своптармен сипатталды, бұл ретте біріншілердің айналымдағы үлесі 0,99 % болса, екіншілердің үлесі – 99,01 % құрады. Наурыз айындағы тиісінше көрсеткіштер – 10,2 және 89,8 % болды. Яғни, үстіміздегі жылдың басында көрініс тапқағ қысқа свопты ұзын своппен ауыстыру тенденциясы әрі қарай дамып келе жатыр.

Валюталық своп операциялары бойынша сауда-саттық көлемі сәуір айында 7 692,5 млрд теңге жетіп, алдыңғы айдағы осы көрсеткіштен 11,8 % немесе 811,8 млрд теңгеге артты.

Операциялардың орташа күндік көлемі 384,6 млрд теңгені құрады, бұл өткен айдың көрсеткішінен 6,2 % немесе 22,5 млрд теңгеге артық.

Биржадағы валюталық своп операциялары сәуір айында 22 KASE мүшесі өткізді.

Мерзімдік келісімшарттар нарығы

Биржалық нарықтың осы секторында тыныштық орнаған. Күнделікті Биржа теңгеге АҚШ долларының бағамына, KASE Индексінің мәніне және оның өкілетті тізімінің акцияларының бағасына 15 түрлі фьючерстер ұсынады. Алайда осы қаржы құралдарымен сәуір айында мәмілелер жасалған жоқ.

Анықтама үшін

"Қазақстан қор биржасы" АҚ (KASE) Орталық-Азия өңіріндегі жетекші және өз қызметін Қазақстанның қаржылық нарығында жүзеге асыратын жалғыз қор биржасы болып табылады. Бұл репо нарығының құралдары, мемлекеттік және корпоративтік бағалы қағаздардың, халықаралық қаржы институттарының облигацияларының, сондай-ақ туынды қаржы құралдарының әмбебап сауда-саттық алаңы.

KASE Дүниежүзілік биржалар федерациясының (WFE), Еуро-Азиялық қор биржалардың федерациясының (FEAS) және басқа да халықаралық отандық кәсіби бірлестіктердің мүшесі болып табылады.

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