

"ҚАЗАҚСТАН ҚОР БИРЖАСЫ" АҚ

БАСПАСӨЗ МӘЛІМДЕМЕСІ

Алматы қ.

18 сәуір 2017 жыл

"Қазақстан қор биржасы" АҚ (KASE немесе Биржа) 2017 жылдың бірінші тоқсанындағы негізгі қызметінің қорытындылары туралы ақпараттандырады.

- *FTSE Қазақстанның нарықтардың елдік классификациясында "Клиринг және есе айырысулар" критерийі бойынша жайғасымын жақсартты және Frontier market мәртебесіне KASE нарығының сәйкестігі туралы аралық есеп берушілікте белгіледі. Ресми түрде нарық осы мәртебені 2017 жылдың қыркүйегінде алады.*
- *KASE бағалы қағаздар нарығындағы сауда-саттыққа қатысушылардың мәмілелерін қамтамасыз етуін есептегенде бірыңғай шектелім жүйесін іске қосты.*
- *KASE мүшелігіне алғашқы шетелдік брокер – ресейлік "УНИВЕР Капитал" КАҚ қабылданды.*
- *KASE Индексінің өкілетті тізіміне акцияларды іріктеу критерийлерін өзгертіп, эмитенттердің капиталға айналу мен қаржылық тұрақтылығының мөлшері бойынша шарттарды қойды, бұл критерий 1 мамырдан бастап қолданысқа енгізіледі.*
- *28 наурызда "Биржалық симулятор" атты KASE жобасы шегінде кезекті оқу сауда-саттықтары басталып, осы іс-шараға қатысқан 70-тен астам ДОО студенттердің рекордтық санға жетті.*
- *KASE сауда-саттықтарының жиынтық көлемі 2016 жылдың бірінші тоқсанымен салыстырғанда 57,6 %-ға өсіп, 38,5 трлн. теңгеге жетті. Акциялар нарығының капитализациясы 3,1 %-ға өсіп 14,7 трлн теңгені құрады, ал KASE Индексінің өсімі 14 %-дан асты.*
- *02–03 наурызда Биржада "БАСТ" АҚ SPO өтіп, осының шегінде эмитент жоспарлаған акцияларының толық көлемін сатып, 1 125,0 млн теңге тартты.*
- *Орталық депозитарийінің есепке алу жүйесінде жеке тұлғаларға ашылған есп-шоттардың саны 01 сәуірде тағы рекордтық мәнге жетіп – 106 744 жеке есеп-шотты құрады.*

Өзекті жобалар мен іс-шаралар

2016-2018 жылдарға KASE дамуының стратегиясындакелесідей өзекті бағыттар анықталды: биржалық нарықты дамыту, Биржаның және оның қызметтерінің клиенттерге бейімделуі, биржалық бизнестің тиімділігі мен бәсекеге қабілеттілігін арттыру.

2017 жылдың бірінші тоқсанында Биржалық нарықты дамыту шегінде мынадай іс-шараларды жүзеге асырды:

- 09 ақпанда Биржа бағалы қағаздар нарығында берілетін өтімідер мен жасалатын мәмілелер бойынша маржалау үшін бірыңғай шектелім жүйесін енгізді. Жаңа механизм сауда-саттыққа қатысушының жиынтық портфелін бағалауға және оның T+2 ашылған жайғасымдар үшін қамтамасыз ету ретінде ескеруге мүмкіндік береді. Ақшадан басқа, қамту ретінде осы сызба бойынша саудаланатын қағаздар да қолданылуы мүмкін;
- 02 ақпанда Биржа алғашқы шетелдік брокерді "УНИВЕР Капитал" КАҚ (Мәскеу, Ресей Федерациясы) "қор" және "деривативтер" санаттары бойынша мүшелікке қабылданды. Бұдан бұрын шетелдік мүшелер тек банктер болатын. Осы жайт шетелдік капиталдың қазақстандық нарыққа деген қызығушылығының сақталатынын, және онда жұмыс жасауға еш кедергі жоқтығын көрсетеді. Осыға байланысты KASE инвесторлық базаны, атап айтқанда биржалық нарыққа қашықтан қатысушыларды, ең басты ЕАЭО елдерінен, тарту арқылы әрі қарай кеңейтуді көздеп отыр;

- 06 сәуірде KASE, Мәскеу биржасы ұйымдастырған, Сегізінші Биржалық Форумға орай, ресейлік брокерлермен кездесу өткізді. Осы кездесуге 12 компанияның 23 өкілі қатысты;
- KASE "ИРБИС" ҚНАА" еншілес компаниясымен бірлесе отырып, 2008 жылдан бастап "Биржалық симулятор" оқыту жобасын жыл сайын өткізеді, осы жоба жастардық қаржылық сауаттылығын арттыруға, бөлшек инвесторлардың базасын кеңейтуге және оларды биржалық сауда-саттыққа тартуға бағытталған. Бүгінгі таңда байқауға қатысу үшін 80 түрлі оқу орындарының 1 479 студенті тіркелді. Байқаудың екі аптасында сауда-саттық көлемі 1,5 млрд теңгеден асты. Осы жылы жобаның басталуы Global Money Week балалар мен жастардың қаржылық сауаттылығын арттыру бойынша халықаралық кампаниясына орайластырылған;
- 01 мамырда KASE Индексінің өкілетті тізіміне акцияларды енгізу критерийлеріне енгізілген өзгертулер өз күшіне енеді. Тізімді қалыптастыру концепциясын өзгерту Биржаның өз стратегиясын іске асыру шегінде альтернативті сауда-саттық алаңын ұйымдастыру ниетімен ұштасқан, оның тізіміне кіші және орта капитализациясы бар, соның ішінде Биржада IPO өткен, ірі компанияларға қарағанда қызметтері жоғарғы тәуекелдерге бас ұратын, компаниялардың акциялары енгізілетін болады. Биржа альтернативті сауда-саттық алаңын өз индексімен сипаттауға ұмталады, ал KASE Индексі ірі және қаржылық тұрақты, "Бағалы қағаздар нарығы туралы" заңымен анықталғандай, Қазақстан Республикасының резиденті болып табылатын, компаниялардың ең өтімді акцияларының бағалары бойынша негізгі сауда алаңы үшін есептелінеді;
- қор нарығында T+2 есеп айырысуларды енгізу бойынша соңғы жылдардың KASE табысын мойындау ретінде FTSE елдік классификациясы шегінде Қазақстанның "Клиринг және есептесулер" және "Есептесулер – орындалмаған мәмілелердің сирек оқиғалары" критерийлері бойынша жайғасымдарының жоғарылауы болып табылады, осыға байланысты Қазақстан үстіміздегі жылдың қыркүйек айында Frontier market мәртебесін алады. Жайғасымдардың жақсаруы, KASE 2016 жылдың тамыз айында іске асырған, брокердің комиссиясының T+2 есептесу сызбасымен жасалған мәмілені сомасына кіру мүмкіндігін FTSE растауы көмегімен болды, бұл сызба жұмысқа толық қабілетті, және осы сызба бойынша жұмыс істеуде орындалмаған мәмілелер тіркелген жоқ.

Биржалық нарықтың негізгі көрсеткіштері Основные показатели биржевого рынка

2017 жылдың үш айында биржалық сауда-саттықтардың көлемі 38,5 трлн теңгені құрады, бұл өткен жылдық тиісті көрсеткішімен салыстырғанда 14,1 трлн теңгеге немесе 57,6 % жоғары. Өсім репо нарығындағы сауда-саттық көлемінің 5,0 трлн теңгеге немесе 40,2 %-ға және валюталық своп нарығында 9,5 трлн теңгеге немесе 2,05 есеге өсуімен шартталған.

Қазақстандық МБҚ нарығы да 37,1 млрд теңгеге немесе 19,2 %, акциялар 10,4 млрд теңгеге немесе 55,2 % және инвестициялық қорлардың бағалы қағаздары 4,0 млн теңгеге немесе 4,9 % өсім көрсетті. Корпоративтік облигациялар нарығында сауда-саттық көлемі – 6,1 млрд теңгеге немесе 39,0 % күрт төмендеді. Сауда-саттық көлемінің дәстүрлі ең үлкен үлесі ақша нарығының еншісінде – валюталық своп операциялары мен репо – тиісінше 48,0 % және 45,4 %. Сауда-саттықтың орташа күндік көлемі 652,5 млрд теңгені, ал орташа күндік мәмілелер саны – 1 637 болды.

Акциялар нарығы

Акциялар нарығының капитализациясы жылдың басынан бастап 443,0 млрд теңгеге немесе 3,1 % өсіп, 14,7 трлн теңгеге (46,9 млрд USD) жетті. Нарық капитализациясының өсімі көбіне акциялардың құны өсуімен байланысты болды.

Акциялар сауда-саттығының жиынтық көлемі 29,3 млрд теңгені құрап, 2016 жылмен салыстырғанда 55,2 % өсті.

Орналастырулар нарығы, Қазақстан қор биржасында 02-03 наурызында болып жазылым арқылы өткен, "БАСТ" АҚ (Шығыс-Қазақстан обл.) SPO белгіленді. Орналастыру қорытындысы бойынша сатушы жоспарланған акциялар көлемін түгел, жалпы сомасы 1 125,0 млн теңгеге, бір акцияға 30 500 теңгеден орналастырды. Сұраным ұсынымнан 3,1 % артты. Бір жарым айдан соң 14 сәуірде акцияның қайталама нарығындағы бағасы 40 000 теңгеге жетті.

Сатып алу/сату секторында айналымның ең үлкен үлесі "ҚазТрансОйл" АҚ акцияларының – 26,5 %, "Қаражыра" АҚ – 14,6 % және "БАСТ" АҚ – 9,0 % еншісінде болды.

2017 жылдың бірінші тоқсанында KASE Индексінің мәні 196,1 нүктені немесе 14,4 % құрады.

Жылдың басында көтерілу трендіне болып, 13 ақпанда максималды мәніне 1 619,2 нүктеге

жетіп, содан кейін 1 554 нүктеге дейін коррекцияланды. KASE Индексі алдыңғы жылмен салыстырғанда ең жоғары деңгейінде орналасқан, бұл ұлттық валютаның АҚШ долларына қатысты нығаюы аясында теңгелік активтердің жоғарғы тартымдылығымен шартталған. 2017 жылдың бірінші тоқсанында Төменде KASE Индексінің өкілетті тізіміне енгізілген, акциялардың құнының өзгеруі көрсетілген:

| Эмитенттің атауы | 01.04.17 жылға бағасы | жыл басынан бастап тренді, % |
|----------------------------------|-----------------------|------------------------------|
| "ҚазМұнайГаз" Барлау Өндіру" АҚ | 19 000,0 | +24,4 |
| "Қазақтелеком" АҚ | 17 201,0 | +19,3 |
| KAZ Minerals PLC | 1 803,0 | +19,2 |
| "БАСТ" АҚ | 42 217,9 | +18,2 |
| "KEGOC" АҚ | 1 355,0 | +15,5 |
| "Қазақстан Халық жинақ банкі" АҚ | 57,0 | +13,2 |
| "ҚазТрансОйл" АҚ | 1 295,0 | +5,6 |
| "Кселл" АҚ | 1 150,0 | +4,5 |
| "Банк ЦентрКредит" АҚ | 168,9 | +0,8 |

Инвесторлардың негізгі санаттары бойынша, жазылым мен ірі мәмілелерді есептегенде, акциялар нарығында ең белсенді болған жеке тұлғалар, оларды жеке шоттарының үлесі айналымның 45,1 % құрады. Брокерлер-дилерлердің үлесі 30,9 % құрады. Брокерлер-дилерлердің клиенттің шоттарының үлесі акциялар нарығының жалпы айналымынан 24,0 % (оның ішінде ЕБД – 1,0 %). Акциялар нарығындағы резидент еместердің үлесі 10,7 %. Акциялар нарығындағы Биржа мүшелерінің ең белсендісі "Фридом Финанс" АҚ, содан кейін "АСЫЛ-ИНВЕСТ" АҚ және "Қазпошта" АҚ болып табылады.

Наурыз айының соңында Биржаның сауда-саттық тізімдерінде, 102 эмитент шығарған, 120 атаудағы акциялар болды. Олардың "Бейлистингілік бағалы қағаздар" секторында төрт эмитенттің акциялары саудаланады.

Бірінші тоқсан әдетте листингтің аздаған санымен сипатталатынын еске саламыз, себебі компаниялар аяқталған қаржылық жылдың қорытындысы бойынша қаржылық есеп берушілігіне аудит жүргізеді. Сондықтан аяқталған кезеңде KASE листингілік акциялар санына тек "ЗА-БэстГрупп" АҚ және "АЛАТАУ-ҚҰС" АҚ акциялары ғана қосылды.

Корпоративтік облигациялардың нарығы

Биржаға айналысқа жіберілген корпоративтік борыштың көлемі бірінші тоқсанда 6,3 % азайып, 7,7 трлн теңгені құрады (24,7 млрд USD). Нарық капитализациясының төмендеуі айналыс мерзімі аяқталған облигациялардың делистингі есебінен болып отыр.

Корпоративтік облигациялар сауда-саттығының жалпы көлемі 9,5 млрд теңгені құрап, 2016 жылдың бірінші тоқсанымен салыстырғанда 39,0 % азайып отыр. Бастапқы нарықта "Қазақстандық коммуналдың жүйелер" АҚ облигациялары ғана орналастырылды. Қайталама нарықтағы сауда-саттық көлемі 6,8 млрд теңгеге немесе 44,1 % төмендеп 8,6 млрд теңгені құрады. Қайталама нарықтағы ең үлкен үлес "Фридом Финанс" АҚ (FFINb1) – 35,7 %, "ҚазМұнайГаз" АҚ (KMGZb4) – 21,9 % және "ARLAN WAGONS" ЖШС (ARWAb1) – 7,8 % купондық облигацияларының еншісінде болды.

Корпоративтік облигациялардың кірістілік Индексі KASE_BY жыл басынан бастап 0,2 % п.п. төмендеп, жылдық 9,9 % құрады.

Инвесторлардың негізгі санаттары бойынша корпоративтік облигациялар нарығында 49,9 % брокерлік және дилерлік компаниялар клиенттерінің (соның ішінде ЕДБ – 4,0 %), 22,1 % жеке тұлғалардың, 17,4 % брокерлер-дилерлердің жеке шоттарының, 10,6 % – ЕДБ шоттарының еншісінде. Биржалық нарықтың осы секторындағы резидент еместердің үлесі – 8,8 % құрайды.

Облигациялар нарығындағы ең белсенді қатысушылардың үштігінің көшбасшысы "Фридом Финанс" АҚ, содан кейін "Сентрас Секьюритиз" АҚ және "BCC Inevst" болып табылады.

Бірінші тоқсанның соңында KASE сауда-саттық тізімдерінде, 66 эмитент шығарған, 260 корпоративтік облигациялар бар.

Аяқталған жылда KASE ресми тізіміне "Амангелді Газ" ЖШС облигациялары енгізілген. Өтелуіне байланысты "Казкоммерцбанк" халықаралық облигациялары, сондай-ақ "Қазақстандық Ипотекалық Компаниясы" АҚ, "Delta Bank" АҚ және "Алматинские электрические станции" АҚ купондық облигациялары шығарылды.

МБҚ нарығы

Бастапқы нарықтың көлемі 172,2 млрд теңгеге бағаланады, олардың 171,5 млрд Қаржы министрлігімен сегіз аукцион шегінде алынған, осы аукциондар арқылы төрт облигациялалық бағдарламалар орналастырылды. Екі орта мерзімді қазынашылық міндеттемелердің аукциондық кірістілігі жылдық 9,5–10,2 % аралығында, ұзақ мерзімді қазынашылық міндеттемелердің екі шығарылымы бойынша – жылдық 9–9,5 % аралығында белгіленді. Қалған 680 млн теңгені Павлодар облысының Әкімдігі тартты.

Ұлттық Банктің қысқа мерзімді ноталары нарығында орналастырулар белсендірілді. Ағымдағы жылда қысқа мерзімді ноталар шығарылымының көлемі 15,0 трлн теңгені құрады, олардың 79,8 % немесе 12 трлн теңгесі (жылдық 10,5–12 % годовых) апталық ноталардың үлесінде болды. Бір айлық ноталардың көлемі 2 трлн теңгені (жылдық 10,4–11,7 %), үш айлық – 0,6 трлн (жылдық 10,1–11,2 %), жарты жылдық – 0,3 трлн (жылдық 10,0–11,2 %), бір жылдық – 0,2 трлн (жылдық 9,6–10,8 %) құрады. KASE қайталама нарығынағы МБҚ сауда-саттығының көлемі 2016 жылдың бірінші тоқсанындағы 13,4 млрд теңгеден үстіміздегі жылдың бірінші тоқсанында 58,4 млрд теңгеге өсті. Бұл ретте қайталама нарық түгел Ұлттық Банктің ноталарының сауда-саттығымен сипатталды.

Шетел валюталарының нарығы

Валюталық спот-нарықтағы жиынтық көлем 2 297,3 млрд теңгені құрап, 2016 жылдың тиісті кезеңімен (2 748,9 млрд теңге) салыстырғанда 451,6 млрд теңгеге немесе 16,4 % азайды. Негізгі себеп нарыққа қатысушылардың американдық долларға деген қызығушылықтың әрі қарай төмендеуі, ал теңге кезең қорытындысы бойынша 5,8 %-ға күшейіп, бір долларға 313,76 теңгені құрады.

KASE валюталық сауда алаңында ең көп саудаланатын қаржы құралы АҚШ доллары болып табылады, оның көлемі 2 267,0 млрд теңгеге немесе жиынтық сауда-саттық көлемінен 98,7 % құрады. Ресей рублінің теңгеге саудасының көлемі 20,1 млрд теңгені құрады немесе жалпы көлемнен 0,9 %, еуроның теңгеге саудасы – 8,6 млрд теңге немесе 0,4 %, қытай юанінің теңгеге саудасы – 1,7 млрд теңге немесе жалпы сауда-саттық көлемінен 0,1 % құрады.

Шетел валюталарының нарығында жаңа қаржы құралы – есептесуі теңгемен T+1 ресейлік рублінің (RUBKZT_TOM) және есептесуі теңгемен T+1 Қытай Халық Республикасының юанінің (CNYKZT_TOM) сауда-саттықтары іске қосылды. Сауда-саттықтар іске қосылған күннен бастап CNYKZT_TOM көлемі юаньнің жалпы сауда-саттығынан 13% құрады, RUBKZT_TOM бойынша мәмілелер жасалған жоқ.

Ақша нарығы (репо және валюталық своп операциялары)

Своп-нарықтағы сауда-саттықтың көлемі әрі қарай өсіп, есептік кезеңде 18,5 трлн теңгеге (+9,5 трлн теңге немесе 105,2 %) жетті. Валюталық своптар бойынша мөлшерлемелер орта есеппен 0,6 п.п. өсіп, айдың соңында 7,6 % деңгейінде болды.

Репо операциялары сауда-саттығының көлемі, өткен жылдың ұқсас кезеңімен салыстырғанда, 5 трлн теңгеге немесе 40,2 % өсіп, 17,5 трлн теңгені құрады.

Жылдың басынан бастап TONIA (repo overnight) мөлшерлемесі 1,9 п.п. төмендеп, 10,2 % құрады. Ақша нарығының мөлшерлемелері Ұлттық Банктің базалық мөлшерлеменімен қоса төмендеп, осы кезде жылдық 11 % ± 1 % құрайды.

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. 2015 жылы KASE БҰҰ "Қор биржалар тұрақты даму үшін" бастамасына қосылды. KASE ТМД биржалары арасында бағалы қағаздар сауда-саттығының көлемі бойынша 2-ші орынға иеленіп, FEAS биржаларының акциялар нарығының капитализациясы бойынша топ-5 кіреді.

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