



БАСПАСӨЗ ХАБАРЛАМАСЫ

Алматы қаласы

2018 жылдың 12 маусымы

KASE 2018 жылдың мамыр айына биржалық нарықтың жұмыс қорытындысын ұсынады

- 2018 жылдың мамыр айындағы KASE жұмыс қорытындысы бойынша сауда-саттық жиынтық көлемі 10 934,8 млрд теңгені құрап, алдыңғы аймен салыстырғанда 10 % немесе 994,1 млрд теңге теңгеге өсті. Бағалы қағаздар нарығы (3,9) және ақша нарығы (+13,3 %) оң динамикасын көрсетті, ал шетел валюталарының нарығы (-28 %) төмендегені байқалды.
- 2018 жылдың мамырындағы жағдай бойынша KASE индексі 10 жылдық максимумды жаңғыртып, 2,7 % өсіп, 2 503,22 нүктені құрады.
- KASE ресми тізімінің "Қаржы ұйымдарының халықаралық бағалы қағаздар" секторына Еуразиялық даму банкінің үш шығарылым облигациялары енгізілді.
- 2018 жылдың 01 маусымында KASE сауда-саттық алаңында 111 эмитенттің 126 акциялары саудаланды, олардың бес атау акциялары және 66 эмитенттің 253 облигациялар шығарылымы бейлистингілік бағалы қағаздар секторында айналымға жіберілді.
- МБҚ бастапқы нарығындағы көлем 2,2 есе өсіп, 97,7 млрд теңгені құрады. Мамыр айында атқарушы органдар 7,7 млрд теңгеге және Қаржы министрлігі орналастыру жасап, осы айда жылдық 8,44–8,47%-бен 89,9 млрд теңге тартты.

АКЦИЯЛАР НАРЫҒЫ

Биржаның сауда-саттық тізімінде наурыз айының соңында 111 эмитенттің 126 акциялары орналастырылды. Олардың ішінде листингілік емес бағалы қағаздар секторында бес компанияның бес атаулы акциялары бар.

KASE акцияларының нарығын қаржыландыру мамыр айында 7,6 % немесе 1 401,3 млрд теңгеге төмендеп, до 17 трлн теңгені құрады. Аталмыш көрсеткіштің негізгі себебі "ҚазМұнайГаз" Барлау Өндіру" АҚ жай акцияларын шығару болып табылады. Делистинг күніне компанияны қаржыландыру 1 534,63 млрд теңгеге бағаланды.

KASE Индексі сәуір айындағы аз түзетуден кейін мамыр айында шарықтай бастады. Есептік кезеңнің қорытындысы бойынша KASE Индексі 2,7 %, 2 503,22 дейін өсті. 18 мамырда көгілдір фишкалар индексі өзінің 10 жылдық максимум деңгейін жаңғыртып, 2 532,67 нүктені құрады. Нарықтағы негізгі анықтаушы оқиғалар эмитенттердің 2018 жылдың бірінші тоқсанына эмитенттердің қаржылық есебін жариялау, сондай-ақ акционерлердің жылдық жалпы жиналысынан кейінгі дивидендтік тарихы болып табылады.

KASE өкілеттік тізіміне кіретін акциялардың бағасының өзгеруі

Эмитент	Сауда-саттық коды	Бағасы, бір акцияға теңге		Бағаның өзгеруі, %
		01.05.2018	01.06.2018	мамырда
"Қазақтелеком" АҚ	KZTK	29 300,0	33 800,0	+15,4 %
KAZ Minerals PLC	GB_KZMS	4 110,0	4 362,1	+6,1 %
"Банк ЦентрКредит" АҚ	CCBN	286,9	294,3	+2,6 %
"Халық Банк" АҚ	HSBK	102,1	104,0	+1,8 %
"ҚазТрансОйл" АҚ	KZTO	1 565,0	1 538,0	-1,7 %
"KEGOC" АҚ	KEGC	1 482,0	1 449,0	-2,2 %
"Кселл" АҚ	KCEL	1 699,0	1 650,0	-2,9 %

KASE Индексінің өсіміне тікелей ықпал еткен "Қазақтелеком" АҚ акциялары болды, олардың бағасы 15,4 % өсіп, 33 800 теңгені құрады. Телекоммуникациялық компаниялардың қағаздары сегізінші ай қатарынан өсуде, сонымен қатар жылдам өсімі байқалып, ал мәміле көлемі екі еседен астам төмендеді.

KAZ Minerals PLC акциялары 6,1 % көлемінде өскені байқалады, олардың бағасы айдың аяғында 4 362,1 теңгеге жетті. Сәуір айының соңында компания 2018 жылдың бірінші тоқсанына жұмыс қорытындысын ұсынды, олар 2017 жылдың сәйкес кезеңіне қарағанда едәуір жақсы көрсеткіштер екендігі көрінді. Мыс өндірісінің өсімі Ақтоғай сульфидті фабрикасында байқалады, олардың өндірістік қабілеті наурыз айында 76% жетті.

"Кселл" АҚ акциялары құлдырап, олардың бағасы 2,9 % арзандап, 1 650 теңгені құрады. Акцияларға қысымды компанияның 2018 жылдың бірінші тоқсанындағы есептілігі көрсетеді, оны 2017 жылдың сәйкес кезеңіндегі нәтижелерінің әлсіздігінен байқаймыз.

Сондай-ақ "KEGOC" АҚ акциялары (-2,2%) төмендеп, 1 449 теңгені құрады. Компания акциялары акционерлердің жылдық жалпы жиналысынан кейін тіркелген өсімді толығымен жойды. Айдың соңында несие рейтингінің жақсаруына қатысты компания қағаздары 2 % көрсетті. S&P Global Ratings халықаралық рейтингтік агенттігі KEGOC АҚ ұзақ мерзімді несие рейтингін қаржы көрсеткіштерінің жақсаруына байланысты "BB" деңгейінен "BB+" деңгейіне дейін көтерді. Рейтинг бойынша болжам – "Тұрақты".

Акциялардың сауда-саттық көлемі алдыңғы аймен салыстырғанда 2,2 %-ға немесе 12,4 млрд теңгеден 23,1 млрд теңгеге өсті. Сауда-саттықтың орташа күндік көлемі 1 157 млн теңгеге жетіп, алдыңғы айға қарағанда 2.3 есе артты. Барлық көлем сатып алу-сату секторында өтті. Мамыр айында орналастырулар болған жоқ.

Инвесторлардың негізгі санаттары бойынша ең белсенді жеке тұлғалар болды, олардың шоттарына акциялар айналысының жалпы көлемі 64,9 % болды. Екінші деңгейдегі банктер сауда-саттыққа қатыспады, брокер-дилерлердің үлесі 27,6 %, үлесі (ЕДБ) 0,2 %, басқа институционалдық инвесторлардың үлесі – 23,2 %, өзге заңды тұлғаларға 11,5 % тиесілі. Резидент еместердің қатысуы 11,1%.

КОРПОРАТИВТІК ОБЛИГАЦИЯЛАР НАРЫҒЫ

Сәуір айының соңында KASE сауда-саттық тізімдерінде 66 эмитент шығарған 253 атаудағы облигациялар болды. Есептік айда ресми тізімдерге "Қазақстан Даму банкі" АҚ (BRKZe9) және "Фридом Финанс" АҚ (FFINb3) енгізілді. Айналым мерзімі өтуіне байланысты "Казкоммерцбанк" АҚ (KKGBe23) және "Нұрбанк" АҚ(NRBNb11) облигациялары шығарылды. Мерзімінен бұрын өтеуге байланысты "ҚазМұнайГаз" Ұлттық компаниясы АҚ төрт халықаралық шығарылым облигациялары шығарылды.

Сипатталған өзгерістердің нәтижесінде мамыр айында KASE нарықтарында саудаланатын корпоративтік борыштың көлемі 12,1 %-ға немесе 1 102,6 млрд теңгеге өсіп, номиналды көрсетілімде 8 трлн теңгеге жетті.

Корпоративтік облигациялардың кірістілік Индексі KASE_BMY сәуір айында 11 базистік нүктеге төмендеп, жылдық 10,3 % 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 195,1 млрд теңге деңгейінде қалыптасып, алдыңғы аймен салыстырғанда 18 есеге артты. Сауда-саттықтың орташа күндік көлемі 9 753,5 млн теңгені құрады, ол сәуір айының көрсеткішінен 19 есе көп.

Мамырда биржада бір орналастыру болды: "Компания Фаэтон" ЖШС жеті жылға жылдық 13,49 % -бен 536,4 млн теңгені тартты.

Аталмыш сегменттегі сауда-саттықтың негізгі көлемі қайталама нарыққа келді. Сауда-саттық көлемі 183,7 млрд теңгеге немесе 18 есе артып, 194,5 млрд теңгені құрады.

Инвесторлардың негізгі санаттары бойынша корпоративтік облигациялар нарығындағы брокер-дилерлердің үлесі 1,4 %, ЕДБ үлесі – 26,2 %, басқа институционалдық инвесторлардың үлесі – 3,7 %, өзге заңды тұлғаларға 68,6 % тиесілі, жеке тұлғалардың үлесі 0,1 % асқан жоқ. Резидент еместердің қатысуы 0,01%.

МЕМЛЕКЕТТІК БАҒАЛЫ ҚАҒАЗДАРДЫҢ НАРЫҒЫ (МБҚ)

Қазақстан қор биржасында номиналды құны бойынша саудаланатын мемлекеттік борыш сомасы 10,8 трлн теңгені құрады, бұл сәуір айының қорытындысы бойынша 1,3 %-ға немесе 148 млрд теңгеге артық.

Мамыр айындағы МБҚ нарығындағы жиынтық сауда-саттық көлемі 2,2 есеге (+120,8 %) өсіп, 162,3 млрд теңгені құрады. Сауда-саттықтың орташа күндік көлемі 8 114,2 млн теңгені (сәуір айына қарағанда 2,3 есе өсті) құрады.

МБҚ бастапқы нарығында мәмлелердің көлемі 72,2 есе (+124,3 %) немесе 54,1 млрд теңгеден 97,7 млрд теңгеге дейін өсті. Жалпы орналастыру көлемінің 92 % Қаржы министрлігінің қазынашылық облигацияларының бес шығарылымын орналастыруға алып келді, одан жылдық 8,44–8,47% 89,9 млрд теңге тартты.

Есептік кезеңде мемлекеттік бағдарламаны жүзеге асыру аясында алты облыстың әкімдіктері өзінің екі жылдық облигацияларын жылдық 0,35 % 7,7 млрд теңгеге тартты.

Бастапқы нарықтағы инвесторлардың құрылымында заңды тұлғалардың үлесі – 7,9 %, басқа институционалдық инвесторлар – 92,1 % құрады.

Қайталама нарықтағы сауда-саттық көлемі 2,2 есе өсіп (+115,7 %), 64,6 млрд теңгені құрады. Қайталама нарықта ЕДБ үлесіне инвесторлар құрылымында ЕДБ үлесі – 62,9 %, брокер-дилерлердің үлесі 1,7 %, басқа институционалдық инвесторлардың үлесі – 14,8 %, басқа да заңды тұлғалардың үлесі 20,6 %, жеке тұлғалардың үлесіне 0,1 % жетер-жетпес. Резидент еместер үлесі 0,1%.

ИНВЕСТИЦИЯЛЫҚ ҚОРЛАРДЫҢ ПАЙЛАРЫ

"Инвестициялық қорлардың бағалы қағаздары" секторында есептік кезеңнің соңында бес компанияның басқаруымен 6 қаржы құралдары болды. Өткен кезеңде сауда-саттық көлемі 39,8 млн теңгені құрады, ол өткен аймен салыстырғанда 13,1 есеге артық. Инвесторлардың негізгі санаттары бойынша жеке тұлғалардың үлесі 59 %, брокер-дилерлердің үлесі 23,3 %, өзге заңды тұлғаларға 17,7 % тиесілі.

БАҒАЛЫ ҚАҒАЗДАР НАРЫҒЫНА ЖЕКЕ ТҰЛҒАЛАРДЫҢ ШОТТАРЫНЫҢ ҚАТЫСУЫ

2018 жылдың мамырында Орталық бағалы қағаздар депозитарийінің есепке алу жүйесінде жеке тұлғалардың атынан ашылған 110 947 жеке шот болды, ол алдыңғы аймен салыстырғанда 427 шотқа артық және 2018 жылдың басына қарағанда 1 729 шотқа артты.

ШЕТ ЕЛДІК ВАЛЮТАЛАР НАРЫҒЫ

Мамыр айында шетел валюталарының нарығына 31 KASE мүшелері қатысты.

2018 жылдың мамыр айында шетел валюталары сауда-саттығының көлемі өткен айдың сәйкес кезеңімен салыстырғанда 1 040,1 млрд теңгені құрап, алдыңғы айдың қорытындысына қарағанда 28,12 % төмендеп, 407,4 млрд теңгені құрады.

Ресейге қарсы санкцияларды енгізудің жағымсыз жағы өзінің ықпалын мамыр айы бойы сақтады – теңге мен рубль өз қозғалысын сәуір айында бекітілген деңгейде жалғастырды. Айдың аяғында уақытша қолдау факторы ретінде салық кезеңінің туындауы болды, ол кезде

сарапшылар бюджетке төлемді ағымдағы жылдың бірінші тоқсанының қорытындысы бойынша жасады. Сонымен қатар, Brent эталондық маркасы бір баррельге сенімді түрде 75 АҚШ долларынан жоғары саудаланды, ал айдың ортасында 80 АҚШ долларына жақындады.

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	3 124,1 (-28,5 %)	76,2 % (+2,8 %)	6 330 (-1 358)	325,75 – 330,72	329,35 (+0,6 %)
RUB/KZT	943,1 (-38,7 %)	23,0 % (-2,9 %)	145 (-25)	5,2013 – 5,3311	5,3077 (+0,4 %)
CNY/KZT	9,1 (-39,7 %)	0,2 % (-0,03 %)	25 (-7)	50,9790 – 51,9800	51,5300 (-0,3 %)
EUR/KZT	10,2 (+31,6 %)	0,2 % (+0,1 %)	23 (+2)	381,64 – 396,55	386,12 (-3,0 %)
EUR/USD	15,0 (-42,3 %)	0,4 % (-0,1 %)	3 (-3)	1,1868	1,1868 (-1,7 %)

АҚША НАРЫҒЫ

Мамыр айының соңында TONIA индикаторы өзгеріссіз, жылдық 8,26 % деңгейінде қалды. Сонымен қатар TWINA индикаторы (мерзімі жеті жұмыс күндік репо ашу мәмілелері бойынша орташа сараланған пайыздық мөлшерлеме) 33 б.н. өсіп, жылдық 8,29 % құрады.

Бір күндік SWAP-1D (USD) долларлық своптың кірістілігі мамыр айының соңында жылдық 9,06 % құрап, бір айда 44 б.н. өсті. Екі күндік SWAP-2D (USD) своптың кірістілігі 6 б.н. өсіп, жылдық 8,82% жетті. SWAP-1D (USD) индикаторының максималды мәні жылдық 6,44 % деңгейінде тіркелді – Ұлттық Банк валюталық своп арқылы ұлттық валютада өтімділік ұсынатын, мөлшерлеменің жоғарғы шегі.

Сәуір айында KazPrime-3M (KZT) индикаторы бір ай бойы жылдық 10,25 %-ға дейінде болды.

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, мамыр айының соңында 3 б.н. жылдық 8,29 % өсті.

Репо

Осы сегменттегі сауда-саттықтың көлемі 7,1 трлн теңгеге жетіп, өткен айдың көрсеткішінен 29,6 % немесе 1,6 трлн теңге жоғары болды. Операциялардың орташа күндік көлемі мамырда 354,7 млрд теңге болды, 2018 жылдың өткен айымен салыстырғанда (+36 %).

Репо ашылу мәмілелері бойынша сауда-саттықтың жалпы көлемінің 97,2 % 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 87,2 % құрайды.

2018 жылдың мамырында 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 0,1 % құрады.

Своп

Валюталық своп нарығындағы сауда-саттық көлемі 17,1%-ға азайып, 2,4 трлн теңгені құрады. Операциялардың орташа күндік көлемі 121,0 млрд теңгені құрады, бұл сәуір айындағы осы көрсеткішпен салыстырғанда 13 %-ға төмен. Валюталық своп нарығындағы қаржы құралдар құрылымында сауда-саттықтың жалпы көлемінде 76 % астамы (1,9 трлн теңге немесе 5,6 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 екінші орынға ие болды, сондай-ақ FEAS биржаларының акциялар нарығын қаржыландыру бойынша алтыншы орында.

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