



## БАСПАСӨЗ МӘЛІМДЕМЕСІ

Алматы қ.

12 желтоқсан 2018 жыл

### **KASE биржалық нарықтың 2018 жылдың қараша айындағы жұмыс қорытындыларын жариялады**

"Қазақстан қор биржасы" АҚ (KASE, Биржа) 2018 жылдың қараша айындағы биржалық нарықтың жұмыс нәтижелерін хабарлайды.

- KASE сауда-саттықтарының жиынтық көлемі 11,7 трлн теңгені құрап, алдыңғы аймен салыстырғанда 14,8 % немесе 1,5 трлн теңгеге артты. KASE барлық нарықтары өсім көрсетті: бағалы қағаздар нарығы 2,7 есеге, ақша нарығы 11,3 %-ға, шетел валюталарының нарығы 6,9 %-ға.
- Қараша айының қорытындысы бойынша KASE ИНдексінің мәні 2 % 2 249,61 нүктеге дейін өсті.
- Акциялар нарығының капитализациясы 0,6 % немесе 95 млрд теңгеге өсіп, 15,4 трлн теңгені құрады.
- Айналыстағы корпоративтік борыштың көлемі 4,9 % немесе 487,7 млрд теңгеге өсіп, 10,4 трлн теңгеге жетті.
- 2018 жылдың 01 желтоқсанындағы жағдай бойынша Биржадағы сауда-саттықта 156 эмитенттің 392 атаудағы бағалы қағаздар қолжетімді болды. Қарашада KASE ресми тізіміне бес атаудағы акциялар мен корпоративтік облигациялардың жеті шығарылымы енгізілді.
- Корпоративтік облигациялардың бастапқы нарығынжа облигациялардың жеті шығарылымының орналастырылуы жүзеге асырылып, орналастырудың жиынтық көлемі 490,5 млрд теңгені құрады.
- Еуразиялық даму банкі, төрт жылдық облигацияларын жылдық 9,7 % орналастырып, 20 млрд теңге тартты.

### **АКЦИЯЛАР НАРЫҒЫ**

Жылдың соңында Биржаның сауда-саттық тізімдерінде 111 эмитенттің 128 атаудағы акциялары болды, соның ішінде листингілік емес сауда алаңында төрт компанияның төрт атаудағы акциялары.

Есептік айда ресми тізімге төрт эмитенттің бес атаудағы акциялары енгізілді: "Әскер Мұнай Эксплорэйшн" АҚ (AMXP), "Банк ЦентрКредит" АҚ (CCBNP), "Шұбаркөл көмір" АҚ (SHUK және SHUKP), "Қазатомөнеркәсіп" ұлттық атом компаниясы" АҚ (KZAP).

Биржадағы акциялар нарығының капитализациясы қараша айында айтарлықтай өзгерген жоқ. Теңгелік көрсетілімде өсім 0,6 % құрады немесе 95 млрд теңгені құрап, 15,4 трлн теңгеге жетті, долларлық көрсетілімде ұлттық валютаның әлсіздеуі салдарынан капитализацияның 0,1 %-ға немесе 49,6 млн долларға 41,5 млрд долларға дейін төмендеуі байқалды.

KASE Индексі бірте-бірте қалпына келіп, қараша айында 2 %-ға немесе 44,8 нүктеге өсіп, 2 249,61 нүктеде тіркелді.

## KASE өкілетті тізіміне кіретін, акциялар бағаларының өзгеруі

Эмитент	Сауда-саттық коды			Бағаның өзгеруі
		01.11.2018	01.12.2018	қараша айында
KAZ Minerals PLC	GB_KZMS	2 399,0	2 625,0	9,4%
"Қазақтелеком" АҚ	KZTK	29 100,0	30 050,0	3,3%
"Банк ЦентрКредит" АҚ	CCBN	241,5	248,0	2,7%
"KEGOC" АҚ	KEGC	1 548,0	1 564,8	1,1%
"Кселл" АҚ	KCEL	1 689,0	1 685,0	-0,2%
"ҚазТрансОйл" АҚ	KZTO	1 300,0	1 292,1	-0,6%
"Қазақстан Халық жинақ банкі" АҚ	HSBK	105,1	103,9	-1,2%

Индекстік акциялардың арасында ең лкен өсімді көрсеткен Kaz Minerals PLC үлестік құралдары болды, олардың бағасы 9,4 % немесе 226 теңге өсіп, бір акцияға 2 625 теңгені құрады. Қараша айында өндірістік компанияның акциясының бағасы қазан айындағы құлауды толық қайтарып алды, бұл жайт мыстың бағасының өсуімен байланысты болды. Қараша айында түсті металлдың бағасы 5,12 %-ға өсіп, бір тоннаға 6 145,41 долларды құрады.

Индекстік қағаздардың ең көп арзандағаны "Қазақстан Халық жинақ банкі" АҚ акциялары болды, олардың бағасы 1,2 %-ға немесе 1,2 теңге арзандап, 103,86 теңгеге түсті. Акциялар бағасының төмендеуі тренділік қозғалыспен емес жұмыс волатильділігіне байланысты болды.. 2018 жылдың 20 қарашасында банктің 2018 жылдың өткен тоғыз айына қызметінің нәтижелері жарияланды, банктің активтері шоғырлану негізінде 5,3 %-ға 8,4 трлн теңгеге дейін азайды, негізінен бұл "Altyn Bank" АҚ сатумен және оның топ теңгерімімен шоғырланудан шығарылуы себеп болды. Топтың шоғырландырылған кірісі 163 млрд теңгеге артып, өткен жылдың тоғыз айындағы көрсеткіштен 21 % артық.

Акциялар сауда-саттығының көлемі алдыңғы аймен салыстырғанда 77,4 % немесе 34,3 млрд теңгеге азайып, 10 млрд теңгеге жетті, бұл осы жылдың ең минималды көрсеткіші болып табылды., дегенімен, ағымдағы жлыдың қаңтар және сәуір айларының көрсеткіштеріне жақын. Сауда-саттықтардың орташа күндік көлемі 455 млн теңгеге жетті, орташа күндік мәмілелер саны – 532, бір мәміленің орташа көлемі – 0,9 млн теңге. Барлық көлем сатып алу-сату секторында болды. Қараша айында орналастырулар болған жоқ.

Инвесторлардың негізгі санаттары бойынша ең белсенді жеке тұлғалар болды, олардың шоттарына акциялардың жалпы айналымының 48,3 % тиесілі болды. Екінші деңгейдегі банктер (ЕДБ) есептік айда мәмілелер жасасқан жоқ, брокер-дилерлердің үлесі 16,3 %, басқа институционалдық инвесторлардың шоттарына 1,1 % тиесілі, өзге заңды тұлғалардың үлесі 34,3 %. Резидент еместердің қатысуы 32,9 % болды.

### КОРПОРАТИВТІК ОБЛИГАЦИЯЛАР НАРЫҒЫ

Қараша айының соңында KASE сауда-саттық тізімдерінде 61 эмитент шығарған 244 облигациялар шығарылымы болды.

Есептік айда ресми тізімге жеті шығарылым облигациялар енгізілді: "AMF Group" АҚ (AKFIb4), "Альфа-Банк" Еншілес Банкі АҚ (ALBNb4), "Баспана" Ипотекалық ұйымы" АҚ (BASPb2), "Фазтон Компаниясы" ЖШС (FATNb3), "ҚазАгро" Ұлттықбасқарушы холдинг" АҚ (KZAGb7), "PartnerInterFreight" ЖШС (PIFRb1), "Самұрық-Энерго" АҚ (SNRGb4). Айналыс мерзімі аяқталуына байланысты ресми тізімнен "Альфа-Банк" АҚ Еншілес Банкі АҚ (ALBNb3), "Қазақстан Халық жинақ банкі" АҚ (KKGVB7) облигациялары шығарылды.

Биржада саудаланатын клорпоративтік борыштың көлемі қараша айында 4,9 % немесе 487,7 млрд теңгеге өсіп, номиналды көрсетілімде 10,4 трлн теңгеге жетті, долларлық көрсетілімде өсім 4,1 % немесе 1 115 млн долларға артып, 28,1 млрд долларға жетті.

KASE\_BMY корпоративтік облигациялар кірісітілігінің индексінің мәні қараша айында 22 базистік нүктеге өсіп, жылдық 10,92 % құрады, бұл теңгенің құлдырауы тұсында долларлық активтерге қызығушылықпен байланысты болды.

Биржадағы корпоративтік облигациялардың сауда-саттығының көлемі қарашада 584,9 млрд теңгені құрап, қазан айымен салыстырғанда 10,6 есеге өсті. Сауда-саттықтың орташа күндік көлемі 26,6 млрд теңгені құрады, орташа күндік мәмілелер саны – 13, бір мәміленің орташа көлемі – 2,1 млрд теңге. Сауда-саттық көлемінің өсуі бастапқы нарықта жда (10,2 есе), сондай-ақ қайталама нарықта да байқалды (13,5 есе).

Қараша айында Биржада жеті шығарылымның орналастырылуы жүзеге асырылды, олардың жиынтық сомасы 490,5 млрд теңгені құрады:

- "Фаэтон Компаниясы" ЖШС, өз облигацияларын (FATNb2) жылдық 10,99 % орналастырып, өтеуге дейін қалған мерзімі 6,7 жыл, 200,7 млн теңге тартты;
- "ҚазАгроҚаржы" АҚ, бес жылдық облигацияларын (KAFIb7) орналастырып, орташа сараланған өтеуге кірістілігі жылдық 12 % годовых, 3,9 млрд теңге тартты;
- "Альфа-Банк" Еншілес Банкі АҚ жылдық облигацияларын (ALBNb4) жылдық 9,5 % орналастырып, 800,0 млн теңге тартты;
- "Kaspi Bank" АҚ өзінің облигацияларын (CSBNb17) жылдық 11,5 %, өтеуге дейін қалған мерзімі 4,2 жыл, орналастырып, 9,7 млрд теңге тартты;
- "Сбербанк России" АҚ Еншілес Банкі үш жылдық облигацияларын (SBERb10) жылдық 11 % орналастырып, 4,2 млрд теңге тартты;
- "ҚазАгро" ұлттық басқарушы холдинг" АҚ 15-жылдық облигацияларын (KZAGb7) жылдық 10 % орналастырып, 450 млрд теңге тартты;
- "Самұрық-Энерго" АҚ жеті жылдық облигацияларын (SNRGb4) жылдық 11,2 % орналастырып, 21,7 млрд теңге тартты.

Инвесторлардың негізгі санаттары бойынша екінші деңгейдегі банктердің (ЕДБ) үлесі есептік айда 5,4 % құрады, брокер-дилерлердің үлесі – 0,2 %, басқа институционалдық инвесторлар – 94,2 % (негізінен ЖЗҚ, сақтандыру компаниялар мен инвестқорлар), өзге заңды тұлғалардың үлесі – 0,2 %.

Облигациялардың қайталама нарығындағы сауда-саттық көлемі 87,4 млрд теңгеге немесе 13,5 есеге өсіп, 94,4 млрд теңгеге жетті. Қараша айында мәмілелер саны 7,5 % азайып, 259 болды.

Қайталама нарықтағы инвесторлардың негізгі санаттары бойынша ЕДБ үлесі – 48,1 % құрады, брокер-дилерлердің үлесі – 30,4 %, басқа институционалдық инвесторлар – 3,6 %, жеке тұлғалар – 0,9 %. Резидент еместердің үлесі – 1,3 % болды.

### **МЕМЛЕКЕТТІК БАҒАЛЫ ҚАҒАЗДАР (МБҚ) НАРЫҒЫ**

Биржада саудаланатын мемлекеттік борыштық номиналды құны қараша айында тарихи минимумдардан шегініп, 11 116,7 млрд теңгені құрады, бұл қазан айының көрсеткішінен 1,9 % немесе 214 млрд теңгеге кем.

Қараша айында МБҚ нарығында сауда-саттықтың көлемі 63 млрд теңгені құрап, алдыңғы аймен салыстырғанда 51,5 % немесе 67 млрд теңгеге азайды, бұл негізінен Қаржы министрлігінің МЕКАМ-дарын орналастыруларының болмағанымен шартталды. Орташа күндік сауда-саттық көлемі 2,9 млрд теңге деңгейінде болды, орташа күндік мәмілелер саны – 4, бір мәміленің орташа көлемі – 0,7 млрд теңгені құрады.

МБҚ бастапқы нарығындағы сауда-саттық көлемі 12,4 % немесе 1,5 млрд теңгеге азайып, 11 млрд теңгеге жетті. Есептік айда мемлекеттік бағдарламаларды жүзеге асыру шегінде Батыс-Қазақстан, Ақтөбе, Жамбыл, Солтүстік-Қазақстан және Шымкент қ. Жергілікті атқарушы органдары жоспарлаған көлемдерін жылдық 0,35% тартты.

Қайталама нарықтағы сауда-саттықтың көлемі 55,7 % төмендеп, 52,1 млрд теңгені құрады. Қайталама нарықтың жалпы айналымының 94 % Ұлттық Банктің ноталарының үлесінде.

Қайталама нарықтағы инвесторлардың негізгі санаттары бойынша ЕДБ үлесі – 45,3 % құрады, брокер-дилерлердің үлесі – 7,7 %, басқа институционалдық инвесторлар – 15,3 %, өзге заңды тұлғалардың үлесі – 31,7 %, жеке тұлғалардың үлесі – 0,1 % жетер-жетпес.

## ХҚҰ облигациялары

Есептік кезеңнің соңында KASE сауда-саттық тізімдерінде үш халықаралық қаржы ұйымы облигацияларының 14 шығарылымы болды: Еуразиялық даму банкі, Еуропалық қайта құру және даму банкі және Халықаралық қаржы корпорациясы.

Қараша айында Еуразиялық даму банкі жылдық 9,7 %-бен төрт жылдық облигацияларын орналастырып, 20 млрд теңге тартты. Инвесторлардың негізгі санаттары бойынша ЕДБ үлесі 25 % құрады, брокер-дилерлердің үлесі – 0,3 %, басқа институционалдық инвесторлар – 74,8 % болды.

## Инвестициялық қорлардың үлеспұлдары

01 желтоқсандағы жағдай бойынша «Инвестициялық қорлардың бағалы қағаздары» секторында бес компанияның басқаруындағы алты қаржы құралы болды. Сауда-саттық көлемі 40 млн теңгені құрап, 49 % артты. Инвесторлардың негізгі санаттары бойынша жеке тұлғалардың үлесі 34,3 % құрады, брокер-дилерлердің үлесі – 0,9 %, өзге заңды тұлғалардың үлесі – 64,9 % болды.

## Бағалы қағаздар нарығындағы жеке тұлғалардың есеп-шоттары

2018 жылдың 01 желтоқсанындағы жағдай бойынша Орталық бағалы қағаздар депозитарийінің есепке алу жүйесінде 116 264 жеке есеп-шоттар тіркелген, бұл алдыңғы айдағы көрсеткішпен салыстырғанда 2 585 шотқа, ал жылдың басындағы санымен салыстырғанда 7 019 артық.

## ШЕТЕЛ ВАЛЮТАЛАРЫНЫ НАРЫҒЫ

Шетел валюталары нарығындағы сауда-саттықтың көлемі 1 014,6 млрд теңгеге жетті, бұл өткен айдың көрсеткішінен 6,9 % немесе 65,7 млрд теңгеге артық. Орташа күндік сауда-саттық көлемі 46,1 млрд теңге, орташа күндік мәмілелер саны – 283, бір мәміленің орташа көлемі – 163,1 млн теңгені құрады.

Эталонды Brent марканың баға белгілеулерінің бір айда 22 % құлауы, сондай-ақ геополитикалық шиеленісушілік Биржадағы валюталық жұптардың бағамына тиісті ықпалын тигізбеді. Таразының екінші жағынжа экспорттердердің салықтың кезеңі болып, сыртқы факторлардың болжамды жағымсыз ықпалынан сақтап қалды. Салық төлеудің бір аптасы аралығында қараша айындағы теңгенің ең нығаюына тұспа-тұс болды. Алайды, салықтық кезеңнің уақытша жағымды әсері, ол аяқталғаннан кейінгі бірінші сауда-саттық күнінде-ақ жоққа ұшырады – доллар/теңге жұбының бағамы 26 қараша күні 4,98 теңгеге өсіп, 371,03 теңгеге жетті. Есептік кезеңнің аяғына қарай Биржадағы бір долларға орташа сараланған бағасы 2,61 теңгеге өсіп, 371,56 теңгені құрады.

Төмендегі кестеде Биржада саудаланатын валюталық жұптардың негізгі сипаттамалары берілген (жақшада бағамның алдыңғы аймен салыстырғандағы өзгеруі, бағамның өзгеруі номиналды көрсетілімдегі шетел валютасының теңгеге қатысты биржалық орташа сараланған бағамының өзгеруін көрсетеді).

Жұп	Көлемі, валютаның млн бірлігі	Сауда-саттық көлеміндегі үлесі, %	Мәмілелер саны	Мин. және макс. бағамдары, бағасы белгіленетін валютаға базалық валютаның саны	Айдың соңындағы бағамы (% өзг.)
USD/KZT	2 732,6 (+6,5 %)	99,6 % (+0,35 %)	6 056 (+785)	364,95 – 375,90	371,56 (+0,7 %)
RUB/KZT	479,2 (-45,7 %)	0,3 % (-0,25 %)	101 (-54)	5,5242 – 5,6647	5,6013 (-0,4 %)
CNY/KZT	17,4 (+3,0 %)	0,1 % (-0,003 %)	53 (+4)	52,5750 – 54,0979	53,3000 (+0,9 %)
EUR/KZT	1,9 (-50,0 %)	0,1 % (-0,09 %)	10 (-9)	417,85 – 425,15	420,60 (+0,5 %)

## **АҚША НАРЫҒЫ**

Қараша айының соңында TONIA индикаторы 8 б.н. өсіп жылдық 8,33 % құрады. Сол кезде TWINA индикаторының мәні (мерзімі жеті жұмыс күнді құрайтын, репо ашылу мәмілелерінің орташа сараланған пайыздық мөлшерлемесі) өзгермей жылдық 8,27 % деңгейінде қалды.

Бір күндік SWAP-1D (USD) долларлық своптың кірістілігі қараша айының соңында жылдық 8,02 % жетіп, бір айда 3 б.н. көтерілді. Сондай-ақ екі күндік SWAP-2D (USD) своптың кірістілігі 44 б.н. өсіп, жылдық 8,25 % құрады.

Қараша айында KazPrime-3M (KZT) индикаторы Ұлттық Банктің базалық мөлшерлемесінің жоғарғы шегіне қарай жылжуын жалғастырып, жылдық 10,25 % деңгейінде тоқтады.

USD/KZT валюталық своп операциялары мен, бір жұмыс күнге ашылған, МБҚ-мен автоматты репо операциялары бойынша мәмілелердің көлеміне қатысты орташа сараланған мән болып табылатын, ақша нарығының композиттік индикаторы MM\_Index қараша айының соңында 6 б.н. өсіп, жылдық 8,31 % құрады.

## **Репо операцияларының нарығы**

Осы сегменттегі сауда-саттық көлемі 7,2 трлн теңгені құрады, бұл өткен айдың көрсеткішінен 20,1 % жоғары. Операциялардың орташа күндік көлемі қараша айында 328 млрд теңгені құрады, орташа күндік мәмілелер саны – 410, бір мәміленің орташа көлемі – 0,8 млрд теңге болды.

Репо ашылу операцияларының жалпы көлемінен 98,2 % МБҚ себетімен авторепо мәмілелерінің үлесінде болды. МБҚ себетімен авторепо нарығындағы ең танымал қаржы құралы бір күндік репо операциялары болып қалды, олармен жасалған мәмілелердің МБҚ себетімен авторепо нарығының жалпы көлеміндегі үлесі 85,7 % құрады.

Жалпы қараша айында репо нарығындағы мәмілелер жасасуға Биржаның 43 мүшесі қатысты. Осы сегменттегі сауда-саттықтың жалпы айналымының 85 % астамы банктерге тиесілі. Резидент еместердің есептік айда қатысу үлесі 0,3 % құрады.

## **Валюталық своп нарығы**

Валюталық своп нарығындағы сауда-саттық көлемі 6,2 % азайып, 2,8 трлн теңгені құрады. Операциялардың орташа күндік көлемі 128,9 млрд теңгені құрады, орташа күндік мәмілелер саны – 43, бір мәміленің орташа көлемі – 3 млрд теңге болды. Валюталық своп нарығындағы құралдық құрылымы сауда-саттықтың жалпы көлеміндегі 76 % (2,2 трлн теңге немесе 5,8 млрд USD) екі күндік валюталық своп (USDKZT\_0\_002) мәмілелерінің үлесінде болды.

## **ДЕРИВАТИВТЕР НАРЫҒЫ**

Осы кезде биржалық нарықтың осы секторында, базалық активтері АҚШ доллары, KASE индексі және акциялардың кейбір атаулары болып табылатын, фьючерстер саудалауға қолжетімді. Қараша айында фьючерстермен мәмілелер жасалған жоқ. Желтоқсан айының басына қарай деривативтер нарығында сауда-саттыққа қатысушылардың ашылған жайғасымдары болған жоқ.

## **Анықтама үшін**

«Қазақстан қор биржасы» АҚ (KASE) Орталық Азия аймағындағы жетекші қор биржасы және қаржы нарығында жұмыс істейтін Қазақстандағы жалғыз қор биржа болып табылады. Бұл - репо нарығының құралдары, шетел валюталары, мемлекеттік және корпоративтік бағалы қағаздар, халықаралық қаржы институттарының облигациялары, сондай-ақ туынды қаржы құралдар үшін әмбебап сауда-саттық алаңы болып табылады.

KASE Биржа федерациясының (WFE), Еуро-Азиялық қор биржалар федерациясының (FEAS) және басқа да халықаралық және отандық кәсіби қауымдастықтарының мүшесі болып табылады. 2015 жылы биржа БҰҰ-ның «Қор биржасы тұрақты даму үшін» бастамасына қосылды. KASE бағалы қағаздармен сауда-саттық көлемі бойынша ТМДң қор биржаларының

арасында екiншi орын, ал FEAS қор биржаларының арасында нарықтық капиталдандыру деңгейiнде алтыншы орын алады.

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