

"ҚАЗАҚСТАН ҚОР БИРЖАСЫ" АҚ

Б А С П А С Ө З – Х А Б А Р Л А М А С Ы

Алматы қаласы

2017 жылдың 08 қаңтары

KASE 2018 жылдың қаңтар айына биржалық нарықтың жұмыс қорытындысын ұсынады

"Қазақстан қор биржасы" АҚ (KASE немесе Биржа) 2018 жылдың қаңтары айындағы биржалық нарықтың негізгі жұмыс қорытындысы туралы ақпаратты ұсынады.

- Ағымдағы жылдың қаңтар айындағы сауда-саттықтың жиынтық көлемі 12,4 трлн теңгеге жетіп, алдыңғы айға қарағанда 9,8 % артып, 1,1 трлн теңгені құрады .
- Акциялар нарығын қаржыландыру жыл басынан бері 8 % өсіп, 18,5 трлн теңгеге жетті.
- KASE Индексі 2 329,23 нүктеге дейін жетті, ол жыл басынан бергі көрсеткішке қарағанда 8 % артты.
- Алғашқы нарықта бір орналастыру болды – "Кселл" АҚ, үш жылда жылдық 11,50 % 4,95 млрд теңге тартты (облигация).
- 2018 жылдың 01 ақпанындағы жағдай бойынша Орталық депозитарийде жеке тұлғалардың атынан ашылған шоттардың саны 2017 жылдың басынан 366 шотқа артып, 109 611 жетті.

БАҒАЛЫ ҚАҒАЗДАР НАРЫҒЫ

Бағалы қағаздармен сауда-саттықтың жалпы көлемі 34,6 млрд теңгені құрады. Акциялар секторы және инвестициялық қорлардың БҚ нарығы 25 % және тиісінше 69 % өсті. МБҚ және корпоративтік облигациялар секторында 78,4 % және тиісінше 92,1 % төмендеді. ХҚО облигациялар секторында мәміле жасалған жоқ.

Акциялар нарығы

2017 жылдың соңында Биржаның сауда-саттық тізімдерінде 111 эмитенттің 127 атаудағы акциялары болды, соның ішінде листингілік емес алаңда – төрт компанияның төрт атаудағы акциясы.

Бір айдың ішінде ресми тізімге бес эмитенттің жай акциялары енгізілді: "КАЗАҚАЛТЫН" тау-кен концерні" АҚ, "Kazakhmys Copper" АҚ, "Кристалл Менеджмент" АҚ, "Fincraft" Инвестициялық Үйі " АҚ және "Joint Resources" АҚ. Страховая компания "Қазахмыс" Сақтандыру компаниясы" АҚ және "АСЫЛ-ИНВЕСТ" АҚ артықшылықты акциялары, сондай-ақ "Листингілік бағалы қағаздар" секторында айналымға жіберілген, бағалы қағаздар санынан үш шығарылымы тізімнен шығарылды: "КазТрансГаз" АҚ, "L-CAPITAL" АҚ, "Алматы қаласының аймақтық қаржы орталығының рейтингілік агенттігі" АҚ.

KASE акциялар нарығын қаржыландыру қаңтар айында 8,05 % өсіп, немесе 1 378,8 млрд теңгеден 18,5 трлн теңгеге дейін артты.

KASE Индекс

KASE Индексі акциялары ұсынған жеті атаулары үшінші ай қатарынан өсіп, 9 жылдан астам максималды мәнін жаңғыртты. Қаңтар айының қорытындысы бойынша KASE Индексі 7,7 % өсіп, 2 329,23 нүктені құрады.

| Эмитент | Сауда-саттық коды | Бағасы, бір акцияға KZT | | Бағаның өзгеруі, % (бір айға) |
|----------------------------|-------------------|-------------------------|-----------|-------------------------------|
| | | 01.01.18 | 01.02.18 | |
| "Қазақстан Халық Банкі" АҚ | HSBK | 82,59 | 104,53 | +26,6 |
| "Қазақтелеком" АҚ | KZTK | 20 505,00 | 23 700,00 | +15,6 |
| "КазТрансОйл" АҚ | KZTO | 1 337,00 | 1 477,93 | +10,5 |
| KAZ Minerals PLC | GB_KZMS | 3 800,00 | 3 937,92 | +3,6 |
| "ҚазМұнайГаз" БӨ" АҚ | RDGZ | 25 800,00 | 26 250,00 | +1,7 |
| "KEGOC" АҚ | KEGC | 1 389,00 | 1 407,03 | +1,3 |
| "Кселл" АҚ | KCEL | 1 784,00 | 1 660,00 | -7,0 |

Индекстің бағалы қағаздары арасында өсім көшбасшысы ретінде "Қазақстан Халық Банкі" АҚ акциялары болды, құны 26,6 % өсіп, 104,53 теңгені құрады. Акциялардың айтарлықтай өсімі Sberbank CIB сарапшылары Халық банкінің ЖДҚ мақсаттық бағасын \$16 арттырғаннан кейін орын алды, ол 2018 жылдың 31 қаңтарында жабылу бағамы бойынша бір акцияға 129,2 теңгені құрады. Сәл кейінірек "Фридом Финанс" АҚ сарапшылары акцияның мақсатты бағасын 115 теңгеге арттырды.

"Кселл" акциялары құлдыраудан алдыңғы қатардан орын алып, 7,0 % арзандап, 1 660,00 теңгені құрады. Өткен жылдың соңғы сауда күні (29 желтоқсанда) жоғары белсенділік байқалды, аталмыш эмитенттің акциялары бойынша бағасы өсуге әкеп соққан 6,4 % құрады. Жалпы, ұялы оператордың бағалы қағаздары арнада саудаланады, оның төмендеуі қандай да бір іргелі факторлармен бекітілмеген, сұраным артқан жағдайдан кейін алғашқы мәніне бағаның қайта оралуымен түсіндіріледі.

2018 жылдың қаңтарында акциялармен сауда-саттық көлемі алдыңғы айға қарағанда 25,4 % немесе 2,1 млрд теңгеден 10,5 млрд теңгеге дейін артты. Сауда-саттықтың орташа күндік көлемі 501,3 млн теңгені құрады, ол желтоқсандағы көрсеткішке қарағанда 7,5 % жоғары.

Инвесторлардың негізгі санаты арасында ең белсенділері жеке тұлғалар болып табылады, олардың шотына акциялармен мәмілелердің жиынтық көлеміне 58,5 % келді. Екінші деңгейдегі банктердің үлесі (ЕДБ) 1 % құрады, брокерлік-дилерлік үлесі – 22,0 %, өзге заңды тұлғалардың үлесі – 13,5 %, өзге институционалдық инвесторларға – 5,0 % келді. Бейразиденттердің үлесі – 7,7 %.

Корпоративтік облигациялар нарығы

Қаңтар айының соңында KASE сауда-саттық тізімдерінде 67 эмитентпен шығарылған 256 атаудағы облигациялары тұрды. Есептік кезеңнің үш облигациялар шығарылымы енгізілді – "Қазақстан Халық банкінің еншілес ұйымы "Haluk Finance" АҚ, "Кселл" АҚ және "Қазақстан Даму банкі" АҚ.

Айналымдағы корпоративтік борыш көлемі 157,6 млрд теңгеге немесе 2 % артып, 8,7 трлн дейін құрады, ол Банк ВТБ еншілес ұйымы АҚ (Қазақстан) және "ОРДА кредит" несие серіктестігі" ЖШС облигацияларын өтеуге байланысты KASE ресми тізімінен шығаруға байланысты, сондай-ақ "Алматы электр станциялары" АҚ алты шығарылымын жоюға байланысты орын алды.

KASE_BMY негізгі сауда-саттық алаңының корпоративтік облигациялардың кірістілігі индексі қаңтар айында өзгерген жоқ және жылдық 10,35 % құрады. Өкілеттік таңдау болмауына байланысты, 26 қаңтардан бастап балама сауда-саттық алаңында (KASE_BA* сериясы) индикаторларын есептеу тоқтатылды.

Корпоративтік облигациялардың сауда-саттық көлемі есептік кезеңде 8,3 млрд теңгеге дейін қалыптасып, алдыңғы айға қарағанда 92,1 % немесе 96,4 млрд теңгеге төмендеді. Орташа күндік сауда-саттық көлемі 394,5 млн теңгені құрады, яғни 90 % төмендеді. Облигациялармен сауда-саттық көлемі төмендеуі алғашқы нарықта да, қайталама нарықта да тіркелген. Бір айдың ішінде тек қана "Кселл" АҚ акциялары орналастырылып, 4,95 млрд теңге тартты, өтеу кірістілігі жылдық 11,50 % үш жылдық облигациялар орналастырылды. Сауда-саттыққа төрт қатысушы қатысты, сұраным ұсынымның 16,5 % құрады. Корпоративтік борыш нарығындағы белсенділік төмендеуі нарықтағы жыл басына тән сипатты белгісі ретінде көрініс тапты.

Корпоративтік облигациялардың алғашқы нарығындағы негізгі инвесторлар санаты арасында ЕБД үлесі 20,2 % құрады, өзге институционалдық инвесторлар – 75,8 %, өзге заңды тұлғалар – 4,0 %.

Қайталама нарықтағы сауда-саттық көлемі 3,3 млрд теңгені құрады, ол алдыңғы айға қарағанда 86 % немесе 20,5 млрд теңгеге төмен.

Қайталама нарығындағы инвесторлардың негізгі санаты арасында корпоративтік облигациялардың ЕДБ үлесі 13,6 % құрады, брокер-дилерлер – 18,0 %, өзге институционалдық инвесторлар – 39,4 %, өзге заңды тұлғалар – 19,3 %, жеке тұлғалардың үлесі – 9,8 %. Бейрезиденттер үлесі – 1,8 %.

Мемлекеттік бағалы қағаздар нарығы (МБҚ)

Биржада саудаланатын мемлекеттік борыштық номиналды құны 10,7 трлн теңгені құрады, бұл 2017 жылдың қорытындысымен салыстырғанда 7,7 %-ға немесе 770,3 млн теңгеге артық.

Биржадағы МБҚ сауда-саттығының көлемі 78,4 % төмендеп, 15,8 млрд теңгені құрады. Алғашқы нарықта сауда-саттық көлемі 89 % дейін құлдырап, 5,2 млрд теңгені құрады. Қаңтар айында Қазақстан Республикасының Қаржы министрлігі өтеу кірістілігі жылдық 8,55 %, 10-жылдық облигацияларды (МЕУКАМ-120) орналастырды.

ЕДБ орналастыру кезінде сатып алушылар құрылымында 35,7 %, өзге институционалдық инвесторларға – 46,4 %, өзге заңды тұлғаларға – 17,9 %. Бейрезиденттер орналастыруға қатысқан жоқ.

МБҚ қайталама нарығы көлемі 59,3 % төмендеп, немесе 15,4 млрд теңгеден 10,5 млрд теңгеге дейін құрады. Сауда-саттықтың орташа күндік көлемі 65,1 % төмендеп, 501,4 млн теңгені құрады. Қайталама нарықтың сауда-саттық айналымының 80,5 % Ұлттық Банк ноттарына, Қаржы министрлігінің еурооблигациялары мен облигациялары үлесіне 16,1 % және тиісінше 3,4 % құрады.

МБҚ қайталама нарығында негізгі инвесторлар санаты бойынша ЕДБ үлесіне 44,7 %, брокер-дилерлердің үлесіне – 8,2 %, өзге институционалдық инвесторларға – 21,8 % және өзге заңды тұлғаларға – 15,3 %. Қаңтар айында жеке тұлғалар мен бейрезиденттер Қазақстан қор биржасында МБҚ мәміле жасаған жоқ.

Инвестициялық қордың пайлары

Өткен кезеңде сауда-саттық көлемі 19 млн теңгені құрады, ол 2017 жылдың нәтижесіне қарағанда 68,7 % артық. Негізгі инвесторлар санатында жеке тұлғалардың үлесі 37,5 %, брокер-дилерлер – 36,6 %, өзге заңды тұлғалар – 25,9 % құрады.

Шет елдік валюталар нарығы

Шет елдік валюталар нарығындағы сауда-саттықтың жиынтық көлемі 1 244,8 млрд теңгені құрады, бұл өткен айдағы нәтижеден 1,5 % немесе 60,4 млрд теңгеге артық.

Төменде берілген кестеде Қазақстан қор биржасында саудаланатын валюталық жұптардың негізгі сипаттамасы берілген (жақшаның ішінде алдыңғы жылға қатысты өзгеруі көрсетілген).

| Жұп | Көлемі, млн валюта бірлігі | Сауда-саттық көлеміндегі үлесі, % | Мәмілелер саны | Мин. және макс. бағам, валютта бірлігіне KZT | Жылдың соңындағы бағам (өзг.%) |
|---------|-------------------------------|--------------------------------------|----------------|--|--------------------------------------|
| USD/KZT | 3 798,9 (+7,4%) | 86,1% (-0,9%) | 7 438 (+812) | 319,83–333,29 | 322,90 (-2,8 %) |
| RUB/KZT | 586,8 (+13,8%) | 13,3% (+0,6%) | 93 (-20) | 5,6944–5,8466 | 5,7459 (-0,7%) |
| CNY/KZT | 26,4 (+100,0%) | 0,6% (+0,3%) | 47 (+5) | 50,2850–51,2820 | 51,0000 (+0,2 %) |
| EUR/KZT | 2,9 (-24,7%) | 0,1% (+0,0%) | 21 (+2) | 395,50–402,50 | 402,00 (+1,4 %) |

Қаржы нарығы (репо операциялары мен валюталық своп)

Қаржы нарығындағы жыл басынан бері айтарлықтай оқиға 16 қаңтарда Қлттық Банктің базалық мөлшерлемесі 50 б.н. төмендеуі, жылдық 9,75 %, ол жағдай оны бұрынғы деңгейінде сақталады деп болжам жасаған нарыққа қатысушылар үшін де күтпеген жағдай болды. Соңғы рет базалық мөлшерлемені 2017 жылдың 22 тамызында 25 б.н. дейін төмендеткен болатын, жылдық 10,25 %. Айдың аяғында MM_Index қаржы нарығының композитті индикаторының мәні жылдық 8,81% (-0,59 %) құрады. TONIA (8,75%, -0,58 %) және TWINA (8,76%, -1,09 %) индикаторлары базалық мөлшерлеме дәлізінің соңғы шекарасында жалғастырды, ол теңге өтімділігі профицитінің сақталуына куә болып табылады.

Бір күндік долларлық своп кірістілігі қаңтар айының аяғында жылдық 9,17 % құрады және бір айда 72 б.н. төмендеді, екі күндік своп кірістілігі 210 б.н. төмендеп, жылдық 8,94 % құрады. Бір күндік долларлық своп кірістілігі айдың аяғында жылдық 7,24 % төмендеуі ескеретін жағдай болып табылады, ол теңгенің АҚШ долларына қатысты нығаюына байланысты болды. KazPrime-3M (KZT) индикаторы базалық мөлшерлемеге ұқсас 50 б.н. төмендеп, айдың соңында мәні жылдық 10,75 % құрады. Қаңтар айында қаржы нарығында сауда-саттықтың жиынтық көлемі 12,1 % құрап, 11,1 трлн теңгеге жетті. Repo операциялары нарығының үлесіне 62,5 % келді.

Repo операциялары сауда-саттығының көлемі алдыңғы аймен салыстырғанда 7,0 трлн теңгеге немесе 3,5 % өсіп, операциялардың орташа күндік көлемі 331,5 млрд теңгені құрады.

Repo операциялары мәмілелерін бойынша жалпы көлемінің 98 % астамы МБҚ авторепо мәмілелеріне келеді. Ең танымал құрал бір күндік репо болып табылады, МБҚ авторепо нарығындағы жалпы сауда-саттық көлеміндегі онымен мәміле үлесі 92,1 % құрады.

Repo нарығында мәмілелерге барлығы 43 Биржа мүшесі қатысты. Осы сегментте жалпы сауда-саттық айналымының 50 % астамы екінші деңгейдегі банктер болып келеді. Осы секторға қатысатын бейрезиденттердің үлесі аз ғана, 0,4 % құрайды.

Валюталық своп нарығындағы сауда-саттық көлемі 30,0 % өсіп, 4,2 трлн теңгені құрады. Валюталық своп операциялары мәні тек АҚШ доллары болып табылады. Сауда-саттықтың жалпы көлемінен 70 % USDKZT_0_002 құралымен жсалған мәміле құрайды. Орташа күндік операция – 199,0 млрд теңге.

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