



## БАСПАСӨЗ ХАБАРЛАМАСЫ

Алматы қаласы

2018 жылдың 10 қыркүйегі

### Қазақстан қор биржасы 2018 жылдың тамыз айына биржалық нарықтың жұмыс қорытындысын ұсынады

Қазақстан қор биржасы (KASE, Биржа) 2018 жылдың тамыз айына биржалық нарықтың жұмыс қорытындысын ұсынады.

- 2018 жылдың тамыз айындағы KASE сауда-саттық жиынтық көлемі 9,6 трлн теңгені құрап, алдыңғы аймен салыстырғанда 0,5 % немесе 48,8 млрд теңге теңгеге төмендеді.
- Бағалы қағаздар нарығында акциялар секторында өсім 13 %, МБҚ –15,2 % артты.
- Корпоративтік қарыз көлемі айналымда 14 % өсіп, 9 трлн теңгеге жетті.
- 01 тамызда KASE сауда-саттығына 153 эмитенттің 380 атаулы бағалы қағаздары қол жетімді болды. Тамыз айында KASE ресми тізіміне үй жаңа эмитенттің бағалы қағаздары енгізілді – "Казхром" "Трансұлттық компаниясы", "Азия Life" өмірді сақтандыру компаниясы" және "Лизинг Групп" АҚ.
- Алғашқы нарықта МБҚ көлемі 13 есе өсіп, 9,1 млрд теңгеге жетті, МБҚ нарығында 7,8 % және 178,8 млрд теңгені құрады.
- 01 қыркүйекте Орталық депозитарийде жеке тұлғалар ашқан 110 603 жеке шоттар тіркелді, ол алдыңғы айға қарағанда 610 шотқа және жыл басына қарағанда 1 358 шотқа артқан.

### АКЦИЯЛАР НАРЫҒЫ

Биржаның сауда-саттық тізімінде айдың соңында 109 эмитенттің 124 акциялары орналастырылды. Олардың ішінде листингілік емес бағалы қағаздар секторында төрт эмитенттің акциялары бар.

KASE акцияларының нарығын қаржыландыру тамыз айында 4,8 % немесе 846,2 млрд теңгеге төмендеп, 16,7 трлн теңгені құрады. Аталмыш көрсеткіштің төмендеуінің негізгі себебі – Kaz Minerals PLC акцияларының 35,8 %-ға төмендеуі, сондай-ақ "Казкоммерцбанк" АҚ және "Эксимбанк Казахстан" АҚ жай акцияларының ресми тізімнен шығарылуы болып табылады.

KASE Индексі жаздың үш ай қатарынан құлдырады. Соңғы рет аталмыш көрсеткіш үш ай қатарынан 2015 жылы құлдыраған. Тамыз айының қорытындысы бойынша KASE Индексі 130,6 нүкте жоғалтты немесе 5,5 % жетті. Үш айдың қорытындысы бойынша құлдырау 271,4 нүктеге немесе 10,8 % жетті.

Нарықтағы негізгі анықтаушы оқиғалар ретінде 2018 жылдың бірінші жартыжылдығына қаржылық есебін жариялау, сондай-ақ бірнеше корпоративтік оқиғалардың орын алуы болып табылады.

## КASE өкілеттік тізіміне кіретін акциялардың бағасының өзгеруі

Эмитент	Сауда-саттық коды	Бағасы, бір акцияға теңге		Бағаның өзгеруі, %
		01.08.2018	01.08.2018	мамырда
"KEGOC" АҚ	KEGC	1 431,0	1 491,6	4,2%
"Кселл" АҚ	KCEL	1 626,0	1 635,0	0,6%
"КазТрансОйл" АҚ	KZTO	1 360,0	1 355,0	-0,4%
"Банк ЦентрКредит" АҚ	CCBN	274,0	272,0	-0,7%
"Халық Банкі" АҚ	HSBK	100,7	98,6	-2,1%
"Қазақтелеком" АҚ	KZTK	33 000,0	32 000,00	-3,0%
KAZ Minerals PLC АҚ	GB_KZMS	3 792,0	2 440,0	-35,7%

KAZ Minerals PLC акциялары төмендеуде басты драйверге айналды. Шілде айында өндірістік компания акциялары мыс бағасының арзандауынан төмендесе, осы айда төмендеу Баимское мыс жобасын сатып алуды көздеу туралы хабарламасынан кейін болды. Тамыз айында KAZ Minerals PLC акциялары 35,7 % төмендеді немесе 1 352 теңгеден 2 440 теңгеге дейін.

"KEGOC" АҚ үлестік құралдары индекстік акцияларының біршама өсімін көрсетті, бағасы, 4,2 % немесе 60,6 теңгеге өсіп, бір акцияға 1 491,6 теңгені құрады. 27 сәуірде компания ақша ағымы үшін қомақты дивиденд төледі – бір акцияға 40,1 теңге. Нәтижесінде акция бағалары құлдырап, тамыз айының соңына қарай қалпына келе бастады. Тамыз айының ортасында компания Moody's рейтингілік агенттігінің эмитенттің ұзақ мерзімді рейтингін "Ваа3" деңгейінде, "Тұрақты" болжаммен растағаны туралы хабарлады. Компания 2018 жылдың бірінші жартыжылдығына шоғырландырылған аудиторлық қаржылық есебін ұсынды, онда табыстың 45,6 % артқаны туралы есеп берді.

Акциялармен сауда-саттық алдыңғы айға қарағанда 13 % немесе 18,7 млрд теңгеге артып, 162,4 млрд теңгені құрады. Орташа күндік сауда-саттық көлемі 7,7 млрд теңгеге жетті, барлық көлемі сатып алу-сату секторында өтті. Тамыз айында орналастыру болған жоқ.

Көлемін айтарлықтай ұлғайту тұрақты емес сипаттағы мәмілелерді жасауға байланысты артты. Тамыз айында сауда-саттық көлеміне айтарлықтай әсерін тигізген Kaspі.kz (KSPI) жай акцияларын 14,3 млрд теңгеге сатып алу және "Қазмұнайгаз" Барлау Өндіру" АҚ 3,8 млрд теңгеге сатып алу болды.

Инвесторлардың негізгі санатында неғұрлым белсенділері жеке тұлғалар болып табылады, олардың шоттарына акциялардың жалпы айналымының 63,5 айналды. Екінші деңгейдегі банктер (ЕДБ) сауда-саттыққа қатысқан жоқ, брокер-дилерлер үлесі 20,4 % құрады, өзге институционалдық инвесторлардың үлесіне 4,3 % келді, өзге заңды тұлғалардың үлесі 11,8 % құрады. Бейрезиденттердің қатысу үлесі 7,6 %.

### КОРПОРАТИВТІК ОБЛИГАЦИЯЛАР НАРЫҒЫ

Тамыз айының соңында KASE сауда-саттық тізімдерінде 61 эмитент шығарған 239 атаудағы облигациялар болды. Есептік айда ресми тізімдерге облигациялар қосылған жоқ. Айналым мерзімі өтуіне байланысты облигациялары айналымнан шығарылды – "Атамекен-Агро" АҚ (KATRb2), "Ақтөбе мұнай өңдеу" ЖШС (AKNPb1) – "Банк "Bank RBK" АҚ (INBNb6) шығарылым облигациялары жойылуына байланысты және "Эксимбанк Қазақстан" АҚ (EXBNb4 және EXBNb5) KZP02Y05E986 (KZ2C00003929, EXBNb5) екі шығарылым облигациялары бойынша сыйақы төлемеуге байланысты.

Тамыз айында бағалы борыштық қағаздардың тізімнен шығарылуына қарамастан, KASE нарықтарында саудаланатын корпоративтік борыштың көлемі 14 %-ға немесе 1,1 трлн теңгеге төмендеп, номиналды көрсетілімде 9 трлн теңгеге жетті. Көрсетілген өсім "ҚазМұнайГаз" Ұлттық компаниясы" АҚ халықаралық үш шығарылым облигацияларының саудаланатын борыштық көлемі өсіуі есебінен, сондай-ақ доллар бағамы өсуі АҚШ долларымен көрсетілген халықаралық облигациялардың көлеміне әсер етті.

Корпоративтік облигациялардың кірістілік Индексі KASE\_BMY тамыз айында 14 базистік нүктеге төмендеп, жылдық 10,21 % құрады. Индекстің кірістілігі Ұлттық Банктің айдың аяғына дейін

жарамды базалық мөлшерлемесінің қолданыстағы коридорының үстіңгі шегіне жақын тұр (жылдық  $9 \pm 1$  %).

Корпоративтік облигациялардың сауда-саттық көлемі есептік айда 18,9 млрд теңге деңгейінде қалыптасып, алдыңғы аймен салыстырғанда 45,2 % төмендеді. Сауда-саттықтың орташа күндік көлемі 901,9 млн теңгені құрады.

Шілдеде биржада үш орналастыру болды, жалпы сомасы 9,1 млрд теңгеге орналастырды:

- "Банк ЦентрКредит" АҚ 7 жылдық облигацияларды (CCBNb26) жылдық 12 % орналастыра отырып, 3,1 млрд теңге тартты;
- "Компания Фазтон" ЖШС 7 жылдық облигацияларды (FATNb2) жылдық 11 % орналастыра отырып, 603,9 млн теңге тартты;
- "Қазақстан Ипотекалық Компаниясы" Ипотекалық ұйымы" АҚ 10 жылдық облигацияларды (KZIKb27) өтеу кірістілігі жылдық 9,65 % орналастыра отырып, 5,4 млрд теңге тартты.

Инвесторлардың негізгі санатында корпоративтік облигациялардың алғашқы нарығында институционалдық инвесторлардың үлесі – 34,4 %, өзге заңды тұлғалар – 65,6 % құрады.

Қайталама нарықта сауда-саттық көлемі 24,1 млрд теңгеге төмендеп немесе 71,0% және 9,8 млрд теңге көлемінде қалыптасты. Тамыз айында мәміле саны 20 % қысқарып, 136 құрады.

Негізгі инвесторлар санатында қайталама нарықта ЕДБ үлесі 42,6 %, брокер-дилер – 6,6 %, өзге институционалдық инвесторлар – 39,1 %, өзге заңды тұлғалар – 8,2 %, жеке тұлғалардың үлесіне 3,5 %. Бейрезиденттердің қатысуы – 3,5 %.

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

Қазақстан қор биржасында номиналды құны бойынша саудаланатын мемлекеттік борыш сомасы 10 449,4 трлн теңгені құрады, бұл шілде айының қорытындысы бойынша 0,3 %-ға немесе 33,6 млрд теңгеге артық.

Тамыз айындағы МБҚ нарығындағы сауда-саттық көлемі 15,2 % өсіп, 269,6 млрд теңгені құрады. Есептік кезеңде мемлекеттік бағдарламаны жүзеге асыру аясында тоғыз облыстың, Астаны және Алматы қалаларының жергілікті атқарушы органдары жылдық 0,35 % 17,7 млрд теңге тартты. Қаржы министрлігі жылдық 8,43–8,47 % ұзақ мерзімді облигациялардың шығарылымын орналастыра отырып, 161,1 млрд теңге тартты.

МБҚ алғашқы нарығындағы инвесторлар құрылымында заңды тұлғалардың үлесіне – 9,9 %, институционалдық инвесторлардың үлесіне – 90,1 %.

Қайталама нарықтағы сауда-саттық көлемі 33 % төмендеп, 90,8 млрд теңгені құрады. Қайталама нарықтың жалпы айналымынан 95,2 % Ұлттық Банктің ноттары құрады.

Инвесторлар құрылымындағы қайталама нарықта ЕДБ үлесі - 67,8 %, брокер-дилерлер үлесіне – 0,3 %, институционалдық инвесторлардың үлесіне – 11,4 %, өзге заңды тұлғалар 20,4 % құрады, жеке тұлғалардың үлесіне 0,1 %. Бейрезиденттер есептік айда МБҚ мәмілеліріне қатысқан жоқ.

### **Инвестициялық қорлардың пайлары**

"Инвестициялық қорлардың бағалы қағаздары" секторында 01 қыркүйегінде бес компанияның басқаруымен 6 қаржы құралдары болды. Өткен кезеңде сауда-саттық көлемі 13,9 млн теңгені құрады, ол өткен аймен салыстырғанда 81,4 % жоғары. Инвесторлардың негізгі санаттары бойынша жеке тұлғалардың үлесі 11,5 %, брокер-дилерлердің үлесі 8,5 %, өзге заңды тұлғаларға 80 % тиесілі.

### **Бағалы қағаздар нарығындағы жеке тұлғалардың шоттары**

2018 жылдың тамызында Орталық бағалы қағаздар депозитарийінің есепке алу жүйесінде жеке тұлғалардың атынан ашылған 110 603 жеке шот болды, ол алдыңғы аймен салыстырғанда 610 шотқа артық және 2018 жылдың басына қарағанда 1 358 шотқа артты.

## ШЕТ ЕЛДІК ВАЛЮТАЛАР НАРЫҒЫ

Тамыз айында шетел валюталарының нарығына 29 KASE мүшелері қатысты.

2018 жылдың тамыз айында шетел валюталары сауда-саттығының көлемі өткен айдың сәйкес кезеңімен салыстырғанда 1 407,9 млрд теңгені құрап, алдыңғы айдың қорытындысына қарағанда 40,5 % немесе 406,2 млрд теңгеге төмендеді. Орташа күндік сауда-саттық көлемі 67 млрд теңге, орташа күндік мәміле саны – 345, бір мәміленің орташа көлемі – 194,2 млн теңге.

Тамыз айында теңге негізгі әлемдік валютаға қатысты әлсірегенін байқаймыз. Ұлттық Банктің мәліметтері бойынша тамызда СДР1 доллар бағамы 4,9 %-дан 509,75 теңгеге дейін өсті. Сонымен, ағымдағы жылдың екінші тоқсанының басынан басталған дамушы елдердің валютасының жалпы төмендеу динамикасының соңынан теңге өзінің қозғалысын бастады. 08 тамыздан 13 тамызға дейінгі кезең арасында доллар / теңге жұбының бағамы 14,63 теңгеге өсіп, 348,59 теңгеден 363,22 теңгеге жетті. Теңгеге қолдау көрсету факторы ретінде салықтық кезеңнің басталуы болды, ол аяқталған соң теңге әлсіреуін жалғастырды. Сонымен, USD/KZT, CNY/KZT және EUR/KZT бағамы осы айда максималды мәніне жетіп, аяқталды.

Төмендегі кестеде Қазақстан қор биржасында саудаланған валюталық жұбының негізгі сипаты келтірілген (жақшаның ішінде алдыңғы аймен салыстырғанда шет елдік валютаның теңгеге орташа сараланған биржа бағамының шілде 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	3 908,7 (+35,5 %)	99,3% (+0,02 %)	7 012 (+1 580)	348,21 – 363,43	363,43 (+4,8 %)
RUB/KZT	962,6 (+12,0 %)	0,4% (-0,10 %)	163 (+29)	5,2936 – 5,5706	5,3590 (-3,8 %)
CNY/KZT	21,6 (-27,6 %)	0,1% (-0,07 %)	46 (-20)	50,7500 – 53,4200	53,4200 (+5,3 %)
EUR/KZT	7,8 (x2)	0,2% (+0,08 %)	23 (+11)	402,90 – 424,55	424,55 (+4,6 %)
EUR/USD	2,4	0,1%	7	1,1330 – 1,1375	1,1375

## АҚША НАРЫҒЫ

Тамыз айының соңында TONIA индикаторы 1,21 б.н өсіп, жылдық 9,28 % құрады. Сонымен қатар TWINA индикаторы (мерзімі жеті жұмыс күндік репо ашу мәмілелері бойынша орташа сараланған пайыздық мөлшерлеме) 54 б.н. өсіп, жылдық 8,81 % құрады.

Шет елдік валюталар нарығында теңгенің бағамының құбылмалылығының артуы тиісті жағдайда АҚШ долларымен валюталық своп кірістілігі көрсеткіштерінде байқалды. Бір күндік долларлық своп кірістілігі SWAP-1D (USD) тамыз айының соңында ағымдағы жылдың маусым айының басынан бастап максималды мәніне жетті және жылдық 10,81 % құрады, бір айда 218 б.н. қосып алды. Екі күндік своп кірістілігі SWAP-2D (USD) 5,13 б.н. дейін жылдық 14,05 % құрады. Соңғы рет теңгенің доллармен кепілдігінің ұқсас құны соңғы 2 күні 2016 жылдың мамыр айында байқалды. Тамыз айының соңында екі күндік валюталық своп кірістілігінің бірден өсуі сауда-саттыққа қатысушылар алдын ала валюталық тәуекелді сауда-саттық күнінде мереке күндеріне орай алдағы төрт күндік үзіліске байланысты своп-құралдың бағасына салуына байланысты екендігін екеру қажет.

Тамыз айында KazPrime-3M (KZT) индикаторы Ұлттық банктің базалық мөлшерлемесінің жоғары шекарасында қозғалысын жалғастырып, жылдық 10 % 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, тамыз айының соңында 114 б.н. өсіп, жылдық 9,28 % құрады.

<sup>1</sup> Курс СДР публикуется ежедневно и определяется на основе долларовой стоимости корзины из пяти ведущих валют: доллар США, евро, китайский юань, иена и фунт стерлингов.

## Репо операциялар нарығы

Осы сегменттегі сауда-саттықтың көлемі 5,5 трлн теңгеге жетіп, өткен айдың көрсеткішінен 13,4 % жоғары болды. Операциялардың орташа күндік көлемі тамызда 263 млрд теңге болды, орташа күндік мәміле саны – 440, бір мәміленің орташа көлемі – 597,4 млн теңге.

Репо ашылу мәмілелері бойынша сауда-саттықтың жалпы көлемінің 98,6 % 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 83,4 % құрайды.

2018 жылдың шілдесінде барлығы репо операцияларына 43 Биржа мүшесі қатысты. Осы сегменттегі сауда-саттықтың жалпы айналымының 83 %-дан астамы банктердің үлесінде. Резидент еместердің қатысу үлесі айтарлықтай болған жоқ, бар-жоғы 0,1 % құрады.

## Валюталық своп нарығы

Валюталық своп нарығындағы сауда-саттық көлемі 19,5%-ға азайып, 2,3 трлн теңгені құрады. Операциялардың орташа күндік көлемі 107,9 млрд теңгені құрады, мәмілелердің орташа күндік саны – 45, бір мәміленің орташа көлемі – 2,4 млрд теңге. Валюталық своп нарығындағы қаржы құралдар құрылымында сауда-саттықтың жалпы көлемінде 62,3 % астамы (1,4 трлн теңге немесе 3,9 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. Тамыз айында фьючерстермен мәмілелер жасалған жоқ. Қыркүйек 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](mailto:pr@kase.kz)