

БАСПАСӨЗ МӘЛІМДЕМЕСІ

Алматы қ.

14 сәуір 2021 жыл

KASE биржалық нарықтың 2021 жылдың бірінші тоқсанындағы жұмысының қорытындысын ұсынады

"Қазақстан қор биржасы" АҚ (KASE, Биржа) 2021 жылдың бірінші тоқсанындағы қызметінің негізгі қорытындылары туралы хабарлайды.

- KASE сауда-саттығының жиынтық көлемі 2021 жылдың үш айында 35,6 трлн теңгені құрады және 2020 жылдың сәйкес кезеңімен салыстырғанда 11,1 % - ға немесе 3,6 трлн теңгеге өсті.
- KASE Индексінің мәні бірінші тоқсанда кезекті тарихи максимумды белгілеп, 3 112,32 нүктеге дейін 16,3 %-ға өсті.
- Акциялар нарығының капиталға айналуы 12,2 % - ға немесе 2,3 трлн теңгеге 21,4 трлн теңгеге дейін өсті.
- Жыл басынан бері KASE ресми тізіміне он эмитенттің 15 атаудағы бағалы қағаздары енгізілді, олардың екеуі алғаш рет листинг процедурасынан өтті.
- 2021 жылдың 01 сәуіріндегі жағдай бойынша KASE сауда-саттық тізімдерінде 186 эмитенттің 466 атаудағы мемлекеттік емес бағалы қағаздары болды.
- 2021 жылдың 01 сәуіріндегі жағдай бойынша Орталық депозитарийде жеке тұлғаларға ашылған 150 180 жеке шот болды, бұл 2021 жылдың басына қарағанда 17 319 шотқа артық.

НЕГІЗГІ ЖОБАЛАР МЕН ІС-ШАРАЛАР

KASE 2019-2021 жылдарға арналған даму стратегиясын іске асыру шеңберінде 2021 жылдың бірінші тоқсанында Биржа келесі жобаларды жүзеге асырып, мынадай іс-шараларды өткізді:

- 2021 жылдың қаңтарында KASE пайдаланушылардың кең ауқымына "KASE Mobile" мобильді қосымшасын ұсынды. Қосымша Биржаның ақпараттық өнімдерінің тізімін толықтырады және ең алдымен бөлшек және кәсіби инвесторлар үшін биржалық ақпаратқа қол жетімділікті жеңілдетуге арналған. Қосымшада сондай-ақ KASE оқу сауда-саттығына қатысу функциясы қолжетімді.
- Биржа эмитенттермен және Биржа мүшелерімен құжаттармен алмасу жүйесінің "Issuers to investors" (is2in жүйесі) жаңа нұсқасын іске қосты, онда бағалы қағаздар листингі, аудиторлық ұйымдарды аккредитациясы, нарықтың кәсіби қатысушыларына Биржада мүшелік ету бойынша қызметтерді ұсынудың электрондық форматы іске асырылды.
- KASE бағалы қағаздар кепілімен қаржыландыруды тарту құралдарының болуын қамтамасыз ету мақсатында, автоматты әдіспен жүзеге асырылатын репо операцияларының мерзімін 30 күннен 90 күнге дейін ұзартты.
- Оқыту іс-шаралары

KASE биржалық нарығының қызметі туралы, сондай-ақ қазақстандық қор нарығында капиталды тарту мүмкіндіктері туралы хабардарлықты арттыру мақсатында Биржа "Business FM" радиосында "KASE-мен қор нарығы" оқыту бағдарламасын және "KASE биржалық жаңалықтары" жаңалықтар бағдарламасын шығаруды жалғастырды.

Биржа оқушылар мен студенттердің қаржылық сауаттылығын арттыруға бағытталған Global Money Week жаһандық жобасы аясында "Қор нарығының негіздері" вебинарын өткізді. Вебинарға KIMEP университетінің, Алматы технологиялық университетінің, "Тұран" университетінің, Қазақстан-Британ техникалық университетінің, Әл-Фараби атындағы Қазақ ұлттық университетінің, Халықаралық ақпараттық технологиялар университетінің, Л. Н. Гумилев атындағы Еуразия ұлттық университетінің, Қазақстан-Неміс университетінің, Алматы Менеджмент Университетінің студенттері қатысты.

2021 жылдың 01 сәуірі мен 31 мамыры аралығында Биржа "Биржалық симулятор" конкурсының бірінші кезеңін өткізеді, онда бірінші аптада 40-тан астам ЖОО-дан 1 669 студент тіркелді және тіркеу жалғасуда. "Биржалық симулятор" жобасы 2008 жылдан бастап іске асырылуда. 12 жыл ішінде оған Қазақстанның, сондай-ақ жақын және алыс шетелдердің 80 ЖОО-нан 8,5 мыңнан астам студент қатысты.

Нұрдәулет Айдосов пен Сергей Лукьяновтың қатысуымен "KASE Talks" жобасы аясында ашық дәрістер өткізілді.

– Бизнеске арналған іс-шаралар

"Эмитент күні" жобасы аясында Биржада Шымкент қаласының әкімдігі, Азия Даму Банкі басшылығының инвесторлармен, бағалы қағаздар нарығының кәсіби қатысушыларымен және БАҚ өкілдерімен бағалы қағаздарды шығаруға арналған онлайн кездесулері ұйымдастырылды.

KASE StartUp алаңын дамыту мақсатында осы алаңға рұқсат алған "1FIT" ЖШС-пен кездесу өткізілді.

2020 жылдың қорытындысы бойынша KASE Биржаның биржалық нарықтарында ең үздік нәтижелерді көрсеткен Биржа мүшелерін, листингтік компанияларды – айқындыққа ұмтылғаны үшін, сондай – ақ БАҚ өкілдерін қор нарығын баспасөз басылымдарында және интернет-ресурстарда белсенді жария еткені үшін марапаттау өткізді.

– Халықаралық ынтымақтастық

БҰҰ-ның "Тұрақты қор биржалары" (Sustainable Stock Exchanges Initiative) бастамасын іске асыру шеңберінде биыл төртінші рет Биржа Gender Equality үшін Ring The Bell for сауда-саттығының ашылу рәсімін, сондай-ақ "Инклюзивті көшбасшылық: бизнестегі жаңа шындық" онлайн-іс-шарасын өткізді.

АКЦИЯЛАР НАРЫҒЫ

Акциялар нарығын капиталдандыру жыл басынан бері 12,2 %-ға немесе 2,3 трлн теңгеге өсті және кейбір атаудағы акциялардың, атап айтқанда "Қазатомөнеркәсіп" ҰК" АҚ акцияларының бағасы 41 %-ға және KAZ Minerals PLC акцияларының бағасы 41 %-ға айтарлықтай өсуі есебінен, 21,4 трлн теңгені (50,4 млрд USD) құрады

2021 жылдың наурыз айының соңында KASE сауда-саттық тізімдерінде 122 эмитенттің 138 акциялары болды, оның ішінде листингтік емес сауда-саттық алаңында – үш компанияның акциялары болды.

2021 жылы KASE ресми тізіміне "Жалтырбұлақ" АҚ жаңа эмитентінің жай акциялары енгізілді. Бұл ретте Биржаның сауда-саттық тізімінен бес атаудағы жай акциялар алып тасталды: ресми тізімнен – LVMH MOET HENNESSY компаниясы аталмыш акциялардың эмитентін сіңіру себебі бойынша Tiffany & Co жай акцияларының ерікті делистинг туралы рұқсаттама бастамашысының өтініші бойынша; эмитентінің бастамасы бойынша "Fincraft Capital" АҚ жай акциялары; банктік және өзге де операцияларды жүргізуге және бағалы қағаздар нарығында қызметті жүзеге асыруға арналған лицензиядан айыру себебі бойынша "AsiaCredit Bank (АзияКредит Банк) АҚ жай акциялары; "Листингтік емес бағалы қағаздар" секторынан – "Қазақстан Мақтасы" АҚ және, акциялармен мәмілелердің болмауына байланысты, "Азық-түліктік келісімшарт корпорациясы" Ұлттық компаниясы" АҚ жай акциялары.

2021 жылдың үш айындағы акциялармен сауда-саттықтың көлемі 46,4 млрд теңгені құрады және 2020 жылдың бірінші тоқсанына қатысты 82,9 %-ға немесе 21 млрд теңгеге өсті. Сауда-саттықтың орташа күндік көлемі 814,5 млн теңгені құрады, мәмілелердің орташа күндік саны – 1 381, бір мәміленің орташа көлемі – 589,8 мың теңге болды.

Бастапқы нарықтың көлемі 852 млн теңгеге бағаланады. Инвесторлар бөлігінде сауда-саттық көлемінің 87,1 % – заңды тұлғаларға және 12,9 % – жеке тұлғаларға тиесілі. Бейрезиденттердің қатысуы 14,9 % бағаланады.

Акциялардың қайталама нарығындағы сауда-саттық көлемі өткен жылдың сәйкес кезеңімен салыстырғанда 79,5 %-ға артып, 45,6 млрд теңгені құрады.

Қайталама нарықтағы инвесторлардың негізгі санаттарының арасында жеке тұлғалардың үлесі акциялармен жасалатын мәмілелердің жалпы айналымының 48,3 % құрады. Брокер-дилерлердің үлесі 14,6 % құрады, басқа институционалдық инвесторлардың үлесі – 5 % құрады, өзге заңды тұлғалардың үлесі 32,1 % жетті. Екінші деңгейдегі банктер (ЕДБ) акциялардың қайталама нарығының мәмілелеріне қатыспады. Бейрезиденттердің қатысуы 3 % бағаланады.

KASE ИНДЕКСІ

Жыл басынан бері KASE Индексі 16,3 % немесе 436,74 нүктеден 3 112,32 нүктеге дейін өсті, өзінің қолданыста болу уақытында алғаш рет 3 000 нүкте деңгейінен асып, абсолюттік тарихи максимумды жаңартты. KASE Индексінің алдыңғы ең жоғарғы мәндері 2007 жылдың тамыз айында және 2008 жылдың наурызында 2 800-2 900 нүкте деңгейінде тіркелді.

Индекстік акциялардың сауда-саттықтарың жалпы көлемі 14 млрд теңгені немесе сауда-саттықтың жалпы көлемінің 31 % құрады.

KASE Индексінің өкілетті тізіміне кіретін акциялар бағасының өзгеруі

Эмитент	Сауда-саттық коды	Бағаның өзгеруі		
		01.01.2021	01.04.2021	жылдың басынан
"Қазатомөнеркәсіп" АҚ	KZAP	7 150,00	10 599,91	+48,3 %
KAZ Minerals PLC	GB_KZMS	3 502,00	4 940,00	+41,1 %
"Қазақстан Халық жинақ банкі" АҚ	HSBK	123,99	150,24	+21,2 %
"КазТрансОйл" АҚ	KZTO	970,00	1 117,00	+15,2 %
"Банк ЦентрКредит" АҚ	CCBN	215,64	235,60	+9,3 %
"Қазақтелеком" АҚ	KZTK	26 700,00	27 040,00	+1,3 %
"KEGOC" АҚ	KEGC	1 697,00	1 677,11	-1,2 %
"Kcell" АҚ	KCEL	2 760,00	2 398,00	-13,1 %

Есептік кезеңде индекстік қоржынының өкілдері арасында **"Қазатомөнеркәсіп" АҚ** бір акцияға 48,3 %-ға 10 599,91 теңгеге дейін өскен жай акциялары өсу көшбасшылары болды. Атом компаниясының үлестік қағаздары компанияның оң корпоративті жаңалықтары аясында талданған кезең ішінде дәйекті түрде өсті. Наурыз айында "Қазатомөнеркәсіп" АҚ 2020 жылға қаржылық нәтижелерін ұсынды, оған сәйкес 2020 жылға ҚЕХС бойынша компанияның таза пайдасы 3,6 % артып, 221,4 млрд теңгені құрады. Топтың шоғырландырылған түсімі 2019 жылмен салыстырғанда 17 %-ға ұлғайып, негізінен U3O8 споттық бағасының өсуіне байланысты сатудың орташа бағасының өсуі есебінен 587,5 млрд теңгені құрады. 2020 жылдың қорытындысы бойынша операциялық пайда сатудың орташа бағасының өсуіне және компанияның шоғырландырылған еншілес кәсіпорындары мен бірлескен операциялары өндірген меншікті уран үлесінің артуына байланысты 47 %-ға ұлғайып, 223,899 млрд теңгені құрады.

Өсу қарқыны бойынша екінші орынды **KAZ Minerals PLC** жай акциялары алып отыр, олар жыл басынан бері бір акция үшін 41,1 %-ға 4 940 теңгеге дейін қымбаттады. Мыс өндіруші компанияның акциялары ақпан айының соңына дейін мыс фьючерстерінің 10 жылдық максимумдар деңгейіне дейін өсуіне байланысты оң нәтиже берді. KAZ Minerals сондай-ақ 2020 жылдағы қызметтің аудит жүргізілмеген нәтижелерін ұсынды, оған сәйкес компания есепті жылы EBITDA көрсеткішін 5,6 %-ға \$1,431 млрд-қа дейін ұлғайтты. Сонымен қатар, топтың таза қарызы екінші жартыжылдықта операциялық қызметтен түсетін жоғары ақша ағымының және жыл бойы күтілгеннен төмен күрделі шығындар деңгейінің – \$584 млн-ның арқасында 5,7 %-ға \$2,601 млрд-қа дейін төмендеді.

Бірінші тоқсанда бағасы бір акция үшін 21,2 %-ға 150,24 теңгеге дейін қымбаттаған, **"Қазақстан Халық жинақ банкі" АҚ** акциялары да жоғары өсу қарқынын көрсетіп отыр. Банк акциялары бағасының өсуі үшін 2020 жылға жарияланған шоғырландырылған қаржылық нәтижелер іргелі фактор болды, оған сәйкес таза пайда 2019 жылдағы 334,5 млрд теңгемен салыстырғанда 5,4 %-ға өсіп, 352,7 млрд теңгеге дейін ұлғайды. Таза пайда негізінен сақтандыру қызметінен және туынды құралдар мен бағалы қағаздардан (БҚ) түскен таза кірістің ұлғаюы есебінен өсті, деп атап өтті компания. Банктің активтері депозиттер мен капиталдың өсуі есебінен 2020 жылы 12,5 %-ға 10,388 трлн теңгеге дейін ұлғайды. Міндеттемелер 12,2 %-ға 8,895 млрд теңгеге дейін, меншікті капитал 14,2 %-ға, 1,493 млрд теңгеге дейін өсті, жарғылық капитал өзгерген жоқ және 209,027 млрд теңгені құрады.

Бағаның 13,1 %-ға төмендеуі **"Кселл" АҚ** жай акциялары бойынша тіркелді. Компанияның акциялары ақпанның бірінші сауда-саттық аптасында төмендеу үрдісін бастады және оны тоқсанның соңына дейін жалғастырды. Компанияның нарықтық құны 2020 жылға қаржылық есеп берушіліктің шығуына қарамастан төмендеді, оған сәйкес байланыс операторы өткен жылы ҚЕХС бойынша таза пайданы

1,8 есеге 17,6 млрд теңгеге дейін ұлғайтты. Алайда, абоненттік базаның саны 2,7%-ға 8,055 млн абонентке дейін қысқарды. Таза сату көлемі 11,5 %-а өсіп, 174,7 млрд теңгені құрады. Қызмет көрсетуден түскен кіріс 1,8 %-ға 140,1 млрд теңгеге дейін ұлғайды.

КОРПОРАТИВТІК ОБЛИГАЦИЯЛАР

Айналыстағы корпоративтік борыштың көлемі жыл басынан бері 1,1 %-ға немесе 164,4 млрд теңгеге азайып, 14,5 трлн теңгеге (34,3 млрд USD) дейін төмендеді.

Наурыз айының соңында KASE ресми тізімінде 69 эмитенттің 271 корпоративтік облигациялары болды. Жыл басынан бері KASE ресми тізіміне алты эмитенттің он корпоративтік облигацияларының шығарылымы (біреуі жаңа) енгізілді: "Бәйтерек" ҰБХ" АҚ, "Өнеркәсіпті дамыту қоры" АҚ, "Азық-түліктік келісімшарт корпорациясы" Ұлттық компаниясы" АҚ, "аФинанс микроқаржы ұйымы" ЖШС бір шығарылымы, "ТехноЛизинг" ЖШС облигацияларының екі шығарылымы және "Қазақстандық орнықтылық қоры" АҚ төрт шығарылымы.

KASE ресми тізімінен корпоративтік облигациялардың 20 шығарылымы шығарылды: бір шығарылымнан – "Қазақстан Халық жинақ банкі" АҚ, "Кселл" АҚ, "Қазақстан коммуналдық жүйелері" ЖШС, айналым мерзімінің аяқталуына байланысты "Самұрық-Қазына" ұлттық әл-ауқат қоры" АҚ төрт шығарылымы, "Қазақстан Тұрғын үй компаниясы" АҚ, "Бәйтерек" Ұлттық басқарушы холдингі" АҚ екі шығарылымы және олардың жойылуына байланысты "Амангелді Газ" ЖШС шығарылымы, "Исткомтранс" ЖШС халықаралық облигацияларының шығарылымы және "Қазақстан Халық жинақ банкі" АҚ – мерзімінен бұрын өтелуіне байланысты "Haluk Finance" АҚ шығарылымы – эмитентінің бастамасы бойынша, "AsiaCredit Bank (АзияКредит Банк)" АҚ бес шығарылымы – эмитентті банктік және өзге де операцияларды жүргізуге және бағалы қағаздар нарығында қызметті жүзеге асыруға арналған лицензиядан айыруға байланысты.

KASE_BMY корпоративтік облигацияларының табыстылық индексінің мәні 11 базистік нүктеге төмендеп, жылдық 10,65 % құрады.

KASE корпоративтік облигацияларының сауда-саттықтарының көлемі 2020 жылдың үш айымен салыстырғанда 98,7 %-ға немесе 285,5 млрд теңгеге 574,8 млрд теңгеге дейін өсті. Сауда-саттықтың орташа күндік көлемі 10,1 млрд теңгені (қайталама нарықта – 4,6 млрд теңге), мәмілелердің орташа күндік саны – 21 (қайталама нарықта – 15), бір мәміленің орташа күндік көлемі – 485,9 млн теңгені (қайталама нарықта-303,6 млн теңге) құрады.

Бірінші тоқсанда бастапқы нарықта корпоративтік облигациялар секторында жалпы сомасы 312,2 млрд теңгеге тоғыз эмитенттің облигацияларының 14 шығарылымы орналастырылды, бұл өткен жылдың тиісті көрсеткішінен 34,1 %-ға немесе 79,4 млрд теңгеге жоғары:

- "Қазақстандық орнықтылық қоры" АҚ өтеуге жылдық 10,00–10,77% кірістілігі бар облигациялардың алты шығарылымын (KFUSb4, KFUSb5, KFUSb8, KFUSb9, KFUSb10, KFUSb11) орналастыра отырып, 158,1 млрд теңге қаражат тартты (шығарылымдар бойынша орташа сараланған кірістілік жылдық 10,16–10,70% диапазонында ауытқыды);
- "KEGOC" АҚ өтеуге орташа сараланған кірістілігі жылдық 11,62 % құрайтын және өтеуге дейінгі мерзімі 14,3 жыл облигацияларды орналастырып, 8,6 млрд теңге тартты;
- "Қазақстан Тұрғын үй компаниясы" АҚ жылдық өтеуге кірістілігі 11,00 % құрайтын бес жылдық облигацияларды орналастыра отырып, 29,2 млрд теңге тартты;
- "Бәйтерек" Ұлттық басқарушы холдингі" АҚ өтеуге кірістілігі жылдық 11,00 % он жылдық облигацияларды орналастыра отырып, 50,0 млрд теңге тартты;
- "Өнеркәсіпті дамыту қоры" АҚ өтеуге кірістілігі жылдық 11,50 % он жылдық облигацияларды орналастыра отырып, 50,0 млрд теңге тартты;
- "Азық-түліктік келісімшарт корпорациясы" ұлттық компаниясы" АҚ рубльмен номинацияланған бес жылдық облигацияларды жылдық 8,99 % орналастырып, 1,75 млрд рубль (10,0 млрд теңге) көлемінде қаржы тартты;
- "Capital Leasing Group (Капитал Лизинг Груп)" ЖШС өтеуге кірістілігі жылдық 18,00 % және өтеуге дейінгі мерзімі 2,8 жыл облигацияларды орналастырып, 1,3 млрд теңге тартты;
- "Аграрлық несие корпорациясы" АҚ орташа сараланған кірістілігі жылдық 10,23 % құрайтын және өтеуге дейін мерзімі 295 күн болатын облигацияларды орналастырып, 4,6 млрд теңге қаржы тартты;

- "R-Finance" микроқаржы ұйымы" ЖШС өтеуге кірістілігі жылдық 20,00 % үш жылдық облигацияларды орналастыра отырып, 400,7 млн теңге тартты.

Корпоративтік облигациялардың бастапқы нарығында инвесторлардың негізгі санаттары бойынша ЕДБ үлесі – 33,6 %, брокерлік – дилерлік ұйымдар – 5,8 %, басқа институционалдық инвесторлар – 20,3 %, өзге заңды тұлғалар – 39,8%, жеке тұлғалар – 0,5% құрады. Резидент еместердің қатысу үлесі – 0,5 % болды.

Облигациялардың қайталама нарықтағы сауда-саттықтың көлемі 4,6 есеге немесе 206,1 млрд теңгеге дейін өсіп, 262,6 млрд теңгені құрады.

Корпоративтік облигациялардың қайталама нарығындағы инвесторлардың негізгі санаттары бойынша ЕДБ үлесі – 2,5 %, брокерлік-дилерлік ұйымдардың үлесі – 3 %, басқа институционалдық инвесторлардың үлесі – 34,2 %, өзге заңды тұлғалардың үлесі – 59,6%, жеке тұлғалардың үлесі – 0,7 % құрады. Бейрезиденттердің үлесі – 6,1 % болды.

МЕМЛЕКЕТТІК БАҒАЛЫ ҚАҒАЗДАР (МБҚ)

Биржада саудаланатын мемлекеттік борыштың номиналды құны жыл басынан бері 6,8 % немесе 1,1 трлн теңгеге артып, 17,9 трлн теңгеге дейін (42,1 млрд USD) жетті.

Бірінші тоқсанда МБҚ нарығындағы сауда-саттықтың көлемі 11,2 % немесе 93,2 млрд теңгеге өсіп, 924,7 млрд теңгеге жетті. Мәмілелер саны 536 (қайталама нарықта – 244), бір мәміленің орташа көлемі – 1,7 млрд теңгені (қайталама нарықта бір мәміленің орташа көлемі – 817,6 млн теңге) құрады.

Бастапқы нарықтың көлемі 725,2 млрд теңгені құрады, бұл өткен жылдың сәйкес кезеңінің нәтижесінен 35,9% жоғары. Оның ішінде 702 млрд теңгені Қаржы министрлігі он бес облигациялық шығарылымды орналастыру шеңберінде жылдық 8,99-10,40 %-бен (шығарылымдар бойынша орташа алынған кірістілік – жылдық 9,25-10,30 %) қаржы тартты. Наурыз айында Түркістан облысының әкімдігі "Жұмыспен қамтудың 2020-2021 жылдарға арналған Жол картасы" мемлекеттік бағдарламасын іске асыру аясында жылдық 6,07 %-бен 20,2 млрд теңге және Шымкент қаласының әкімдігі бюджет тапшылығын қаржыландыру мақсатында жылдық 10,80 %-бен 2,8 млрд теңгеге қаржы тартты.

Бастапқы нарықтағы инвесторлардың негізгі санаттары тұрғысынан ЕДБ үлесіне – 70,9 %, брокер-дилерлер – 0,2 %, басқа институционалдық инвесторлар – 16,3 %, өзге заңды тұлғалардың үлесі 12,6 % құрады. Бастапқы нарықтағы сауда-саттықтың жалпы көлеміндегі резидент еместердің үлесі 2,9 % құрады.

Бірінші тоқсанның қорытындысы бойынша қайталама нарықтағы сауда-саттықтың көлемі 33% немесе 98,3 млрд теңгеге азайып, 297,8 млрд теңгеден 199,5 млрд теңгеге дейін төмендеді. МЕКАМ сауда-саттығының көлемі 118,2 млрд теңгені немесе МБҚ қайталама нарығындағы сауда-саттық көлемінің 59 %, Ұлттық Банктің ноталары – 75,2 млрд теңгені немесе 38 % құрады. 6 млрд теңгені немесе 3 % құрайтын, қалған көлем Қазақстан Республикасының еурооблигацияларының және шет мемлекеттердің МБҚ-мен жасалған мәмілелерге тиесілі болды.

Қайталама нарықтағы инвесторлардың негізгі санаттары бөлінісінде ЕДБ үлесіне 48,3 %, брокер-дилерлердің үлесіне – 2,3 %, басқа институционалдық инвесторлардың үлесіне – 24,3 %, өзге заңды тұлғалардың үлесі – 24,9 %, жеке тұлғалардың үлесіне – 0,1% келді. Резидент еместердің қатысуы 13,6 % бағаланады.

ХАЛЫҚАРАЛЫҚ ҚАРЖЫ ҰЙЫМДАРЫНЫҢ ОБЛИГАЦИЯЛАРЫ

Есептік кезеңнің соңында KASE сауда-саттық тізімінде төрт халықаралық қаржы ұйымдарының: Еуразиялық даму банкі, Еуропалық Қайта Құру және даму банкі, Халықаралық қаржы корпорациясы (IFC) және Азия Даму Банкі облигацияларының 35 шығарылымы болды.

2021 жылдың бірінші тоқсанында KASE ресми тізімінің "Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары" секторына Азиялық Даму Банкі облигацияларының екі шығарылымы енгізілді, олардың нысаналы мақсаты гендерлік теңсіздікті төмендетуге және әйелдер мен қыздардың құқықтары мен мүмкіндіктерін кеңейтуге жәрдемдесуге бағытталған жобаларды инвестициялау болып табылады. Сондай-ақ, осы кезеңде KASE ресми тізімінен айналыс мерзімінің өтуіне байланысты Халықаралық қаржы корпорациясының облигациялар шығарылымы алынып тасталды.

2021 жылдың өткен кезеңінде сауда-саттық көлемі 31,9 млрд теңгені құрады, бұл 2020 жылдың ұқсас кезеңінің нәтижесінен 39 есе немесе 31,1 млрд теңгеге жоғары.

Бастапқы нарықтың барлық көлемі Азия даму банкінің орналастыруына тиесілі болды, ол жазылу шеңберінде өз облигацияларының екі шығарылымын, өтеуге дейінгі мерзімі 5,1 жыл және 9,8 жыл, тиісінше жылдық 9,95 % және 10,15 %-бен орналастырды.

Инвесторлардың негізгі санаттары тұрғысынан бастапқы нарықта ЕДБ үлесі – 13%, басқа институционалдық инвесторлар – 50,3 %, өзге заңды тұлғалар – 36,7% құрады.

Қайталама нарықтағы сауда-саттықтың көлемі 14,4 млрд теңгені құрады, бұл 2020 жылдың бірінші тоқсанындағы нарық көлемінен 18 есе артық.

Инвесторлардың негізгі санаттары тұрғысынан МҚҰ облигацияларының қайталама нарығында ЕДБ үлесі – 25 %, брокер-дилерлер – 23,2 %, басқа институционалдық инвесторлар – 50 % және өзге заңды тұлғалар – 1,8 % құрады.

ИНВЕСТИЦИЯЛЫҚ ҚОРЛАРДЫҢ ПАЙЛАРЫ

01 сәуірде "Инвестициялық қорлардың бағалы қағаздары" секторында алты басқарушы компания мен төрт ETF басқаратын 13 инвестициялық пай қоры болды.

2021 жылдың үш айындағы сауда-саттықтың көлемі 17,3 млрд теңгені құрап, 2020 жылдың бірінші тоқсанына қарағанда 28 есеге артты.

Қаржы құралы	Көлемі, млн KZT	Мәмілелер саны
RU_UKFFipo	14 842,1	4 054
FHJlag	818,5	20
CSECfe	352,8	37
FFIN_or	350,3	223
FHJlpc	310,4	14
CSECgm	189,8	32
IE_FXBF	137,0	556
US_BIL_	115,0	24
BCClrb	109,8	2
US_SPY_	52,3	226
US_GLD_	8,9	2
FHJllq	6,4	4
	17 295,6	5 307

Инвесторлардың негізгі санаттары бойынша 40,6 % – брокер-дилерлерге, 0,2 % – басқа институционалдық инвесторларға, 8,9 % – басқа заңды тұлғаларға және 50,4 % – жеке тұлғаларға тиесілі.

ЖЕКЕ ТҰЛҒАЛАРДЫҢ БАҒАЛЫ ҚАҒАЗДАР НАРЫҒЫНДАҒЫ ШОТТАРЫ

2021 жылдың 01 сәуіріндегі жағдай бойынша Орталық депозитарийде жеке тұлғаларға ашылған 150 180 жеке шот болды, бұл 2021 жылдың басына қарағанда 17 319 шотқа артық.

ШЕТЕЛ ВАЛЮТАЛАРЫНЫҢ НАРЫҒЫ

2021 жылдың бірінші тоқсанында KASE шетел валюталары нарығындағы сауда-саттыққа 31 KASE мүшесі қатысты. Есептік кезеңде нарыққа "Қазпошта" АҚ, "Freedom Finance" АҚ және "CAIFC INVESTMENT GROUP" АҚ үш брокер қатысты, олардың брутто айналымдағы қатысу үлесі 0,5 % құрады.

Бірінші тоқсанда шетел валюталары нарығындағы сауда-саттықтың көлемі 3,1 трлн теңгені құрады, бұл өткен жылдың ұқсас кезеңінен 3,2 % немесе 99,7 млрд теңгеге төмен. Бірінші тоқсанда сауда-саттықтың орташа күндік көлемі 53,8 млрд теңгені құрады, мәмілелердің орташа күндік саны – 384, бір мәміленің орташа көлемі – 140,2 млн теңге болды.

Төмендегі кестеде Биржада саудаланатын валюталық жұптардың негізгі сипаттамалары көрсетілген (жақшада көрсеткіштің өткен айға қатысты өзгеруі көрсетілген, бағамның өзгеруі шетел валютасының теңгеге орташа сараланған биржалық бағамының номиналды өзгеруін көрсетеді).

Жұп	Көлемі, валютаның млн бірлігі	Сауда-саттық көлеміндегі үлесі, %	Мәмілелер саны	Мин. және макс. бағам, базалық валютаның бірлігіне бағасы белгіленетін валютаның саны	Кезеңнің соңындағы бағам (өзг.%)
USD/KZT	7 128,40 (-10,0 %)	97,6 % (-1,0 %)	20 854 (+206)	414,10 – 425,90	424,97 (+1,0 %)
RUB/KZT	5 574,08 (-0,1 %)	1,0 % (+0,04 %)	598 (+385)	5,5430 – 5,7500	5,6142 (-1,3%)
CNY/KZT	346,53 (x3,0)	0,7 % (+0,5 %)	344 (+207)	64,2100 – 65,6700	64,6687 (-0,1 %)
EUR/KZT	36,42 (x3,2)	0,6 % (+0,4%)	70 (+13)	500,00 – 514,10	500,00 (-2,2%)

АҚША НАРЫҒЫ

Ақша нарығындағы сауда-саттықтың жиынтық көлемі өткен айдың көрсеткішіне қарағанда 11,5 % немесе 3,2 трлн теңгеге ұлғайып, 30,9 трлн теңгені құрады.

Мәмілелер көлемі арқылы орташа өлшемді мәнді білдіретін MM_INDEX ақша нарығының композиттік индикаторы USD/KZT валюталық своп операциялары және бір жұмыс күніне ашылған МБҚ-мен автоматты репо операциялары бойынша кірістілік мәні 2021 жылғы наурыздың соңына қарай 103 б.н. өсіп, жылдық 9,28 % дейін ұлғайды.

РЕПО операцияларының нарығы

Осы сегменттегі сауда-саттықтың көлемі 2021 жылдың бірінші тоқсанында 27,7 трлн теңгені құрады, бұл 2020 жылдың ұқсас кезеңінің көлемінен 17,4 % немесе 4,1 трлн теңгеге артық. Операциялардың орташа күндік көлемі 485,4 млрд теңгені құрады, мәмілелердің орташа күндік саны – 433, бір мәміленің орташа көлемі – 1,1 млрд теңге болды.

МБҚ қоржынымен авторепо нарығындағы сауда-саттықтың көлемі 24,7 трлн теңгені немесе жалпы репо көлемінің 89,4 %, МҚҰО қоржынымен – 639,5 млрд теңгені немесе 2,3%, ББҚ-мен 2,3 трлн теңгені немесе 8,3 %, МБҚ-мен тікелей репо – 18,1 млрд теңгені немесе 0,1 % және МБҚ-мен тікелей репо – 6,6 мың теңгені құрады.

Наурыз айының соңына қарай TONIA индикаторы (Биржада МБҚ қоржынының бағалы қағаздарымен автоматты репо секторында жасалған, бір жұмыс күні мерзімге репо ашу мәмілелері бойынша орташа сараланған пайыздық мөлшерлеме) 105 б.н. өсіп, жылдық 8,25 %-дан 9,3 %-ға дейін ұлғайды.

TRION индикаторы (Биржа орталық контрагенттің қызметтерін пайдалана отырып клирингтік қызметті жүзеге асыратын МБҚ қоржынының бағалы қағаздарымен автоматты репо секторында бір күн ішінде Биржада жасалған, бір жұмыс күні мерзімге репо ашу мәмілелері бойынша орташа сараланған пайыздық мөлшерлеме) жылдық 8,25 %-дан 9,34 %-ға дейін өсіп, 109 б.н.-ге ұлғайды.

TWINA индикаторы (Биржа орталық контрагенттің қызметтерін пайдалана отырып клирингтік қызметті жүзеге асыратын МБҚ қоржынының бағалы қағаздарымен автоматты репо секторында бір күн ішінде Биржада жасалған, жеті жұмыс күні мерзімге репо ашу мәмілелері бойынша орташа сараланған пайыздық мөлшерлеме) жылдық 8,6 %-дан 8,9 %-ға дейін 30 б.п. ұлғайды

TONIA, TRION және TWINA репо операциялары индикаторларының құбылмалылығы бірінші тоқсанда Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің базалық мөлшерлеме дәлізі шеңберінде серпінді ауытқып отырды. Құбылмалылық динамикасы салық кезеңдерінде және карантиндік шектеулер жарияланған кезеңдерде перспективада іскерлік белсенділіктің төмендеуіне реакция ретінде дәстүрлі түрде өсті.

Валюталық своп операцияларының нарығы

2021 жылдың бірінші тоқсанында валюталық своп операциялары нарығында сауда-саттық көлемі 3,2 трлн теңгені құрады, бұл 931,7 млрд теңгеге немесе 2020 жылдың бірінші тоқсанымен салыстырғанда 22,6 % кем. 2021 жылдың бірінші тоқсанында операциялардың орташа күндік көлемі 56,1 млрд теңгені құрады, мәмілелердің орташа күндік саны – 12, бір мәміленің орташа көлемі – 4,8 млрд теңгені құрады.

Қаржы құралдары құрылымда валюталық своп операциялары нарығындағы жалпы көлемнің 56,9 % бір күндік валюталық своппен (USDKZT_0_001) жасалған мәмілелерге, 38,9 % – екі күндік валюталық своппен (USDKZT_0_002) жасалған мәмілелерге, 3,7 % – бір айлық валюталық своппен (USDKZT_0_01M) жасалған мәмілелерге және 0,4 % – апталық валюталық своппен (USDKZT_0_01W) жасалған мәмілелерге тиесілі болды.

Бір күндік долларлық своптың (SWAP-1D (USD) кірістілігі наурыз айының соңында жыл басынан бастап 25 б.н. ұлғайып, жылдық 8,52 % жетті.

ДЕРИВАТИВТЕР НАРЫҒЫ

Биржалық нарық секторында базалық активтері АҚШ доллары, KASE индексі және акциялардың жеке атаулары болып табылатын, фьючерстер қолжетімді. Сәуір айының басында деривативтер нарығында сауда-саттыққа қатысушылардың ашық жайғасымдары болмады, 2021 жылғы бірінші тоқсанда операциялар жүргізілмеді.

Анықтама үшін

"Қазақстан қор биржасы" АҚ (KASE) Орталық Азия өңіріндегі жетекші қор биржасы болып табылады. KASE бағалы қағаздар сауда-саттығының көлемі бойынша ТМД биржаларының арасында екінші орынды және FEAS биржаларының акциялар нарығы капитализациясының деңгейі бойынша алтыншы орынды алады.

Бұл корпоративтік және мемлекеттік бағалы қағаздар, халықаралық қаржы институттарының облигациялары, шетелдік валюталар, ақша нарығының операциялары – репо және своп, сондай-ақ туынды қаржы құралдары үшін әмбебап сауда-саттық алаңы. KASE халықаралық биржалар Федерациясының (WFE), Еуро-Азиялық қор биржалары Федерациясының (FEAS) және басқа да халықаралық және отандық кәсіби бірлестіктердің мүшесі, сондай-ақ БҰҰ "Қор биржалары тұрақты даму үшін" бастамасының қатысушысы болып табылады.

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