

БАСПАСӨЗ МӘЛІМДЕМЕСІ

Алматы қ.

11 қыркүйек 2019 жыл

KASE биржалық нарықтың 2019 жылдың тамыз айындағы жұмыс қорытындыларын жариялайды

"Қазақстан қор биржасы" АҚ (KASE, Биржа) биржалық нарықтың 2019 жылдың тамыз айындағы жұмыс қорытындыларын жариялайды.

- 2019 жылдың тамызындағы KASE сауда-саттықтарының жинытық көлемі 8,8 трлн теңгені құрап, 2019жылдың шілде айымен салыстырғанда 8,9 % немесе 864,9 млрд теңгеге төмендеген.
- 2019 жылдың 1 қыркүйегіндегі жағдай бойынша KASE сауда-саттық тізімдерінде 177 эмитенттің бағалы қағаздары енгізілген.
- Ресми тізімнің "Туынды қаржы құралдары" секторына, базалық активі "Кселл" АҚ жай акциялары болып табылатын, жаһандық депозиттік қолхаттар енгізілді.
- Тамыз айының қорытындысы бойынша акциялар нарығының капиталға айналуы 2,6 % төмендеп, 15,5 трлн теңгені құрады.
- 01 қыркүйектегі жағдай бойынша саудаланатын корпоративтік борыштың көлемі 0,8 % өсіп, 11,9 трлн теңгені құрады.
- 2019 жылдың тамыз айында Биржаның ресми тізіміне алты эмитенттің облигацияларының алты шығарылымы енгізілді, олардың біреуі KASE листингінің процедурасынан өтті.
- Корпоративтік облигациялар нарығында бастапқы орналастырулардың көлемі 106 млрд теңгені құрады.
- 01 қыркүйектегі жағдай бойынша Орталық депозитарийде жеке тұлғаларға ашылған, 120 070 жеке шот болды, бұлбір ай бұрынғы көрсеткіштен 383 шотқа артық және 2019 жылдың басындағы санынан 3 246 артық.

АКЦИЙЛАР НАРЫҒЫ

Тамыз айының қорытындылары бойынша акциялар нарығының капиталға айналуы 2,6 % немесе 420 млрд теңгеге төмендеп, 15,5 трлн теңгені құрады. Төмендеу KASE Индексінің есептеуіне кіретін, бір қатар ірі компаниялардың акцияларына бағаның құлауымен байланысты болды (кестені қара.).

Айдың соңында KASE сауда-саттық тізімдерінде 123 эмитенттің 138 атаудағы акциялары болды, олардың екі шығарылымы листингілік емес бағалы қағаздар секторында айналысқа жіберілген.

Акциялар сауда-саттықтарының көлемі тамыз айында 2019 жылдың шілде айына қарағанда 50,6 % немесе 22,6 млрд теңге азайып, 22 млрд теңгені құрады. Сауда-саттықтың орташа күндік көлемі 1 млрд теңге, орташа күндік мәмілелер саны 417, бір мәміленің орташа көлемі – 2,5 млн теңге.

Қазақстан қор биржасында, KASE ресми тізіміне демеушілік көрсетілмейтін листинг бойынша енгізілген, акциялар бойынша алғашқы мәмілелер жасалды: Ford Motor Company, Intel Corporation, Pfizer Inc., The Coca-Cola Company, NIKE, Inc., Starbucks Corporation, Exxon Mobil Corporation жай акциялары, "Лукойл" КАҚ, "Новолипецкий металлургический комбинат" КАҚ.

Инвесторлардың негізгі санаттары арасында акциялармен жасалған мәмілелердің жиынтық көлеміндегі жеке тұлғалардың үлесі 47,3 % құрады. Екінші деңгейдегі банктердің үлесі (ЕДБ) 5,5 %, брокер-дилерлер – 30,1 %, басқа институционалдық инвесторлар – 3,2 %, өзге заңды тұлғалар 13,9 %. Резидент еместердің қатысу үлесі 12,9 %.

KASE ИНДЕКСІ

KASE Индексі тамыз айын 4,4 %, немесе 99,28 нүктеге төмендеумен аяқтап, 2 174,36 нүктені құрады.

KASE өкілетті тізіміне кіретін. Акциялардың бағаларының өзгеруі

Эмитент	Сауда-саттық коды	Бағаның өзгеруі		
		01.08.2019	01.09.2019	Тамызда
"Кселл" АҚ	KCEL	1 920,00	2 050,00	+6,77%
"Банк ЦентрКредит" АҚ	CCBN	230,01	233,94	+1,71%
"Қазақтелеком" АҚ	KZTK	24 510,01	24 505,00	-0,02%
"KEGOC" АҚ	KEGC	1 563,00	1 530,33	-2,09%
"Қазақстан халық жинақ банкі" АҚ	HSBK	132,55	128,96	-2,71%
"КазТрансОйл" АҚ	KZTO	1 049,99	1 012,77	-3,54%
KAZ Minerals PLC	GB_KZMS	2 779,11	1 982,74	-28,66%

Тамыз айының қорытындылары бойынша ең үлкен өсім "Кселл" АҚ акциялары көрсетті, олардың бағасы 6,8 % өсті. Осы акциялардың нарығы соңғы кезде өте аутқымалы және волатильді. Сондықтан тамыздың үшінші декадасының басындағы шамалы ғана өсім, бағалы қағаздың бағасын бір данасына 1 900 теңгеден 2 050 теңгеге дейін өсірді

KAZ Minerals PLC акциялары ай бойы айтарлықтай арзандады. Мыс өндіруші компанияның акциялары, 2019 жылдың бірінші жарты жылдығының нәтижелерін жариялау тұсында, 28,66 % түсіп, 1 982,74 теңгеге жетті. KAZ Minerals тобының 2019 жылдың бірінші жарты жылдығы бойынша есептерінің нәтижелері бойынша сатудан түскен кірістер \$1 052 млн құрады, ал 2018 жылдың бірінші жарты жылдығында осы көрсеткіш \$1 098 млн болған. Өндірісті көбейту мыс сатудың көлемдерін 3 % арттыруға қолжеткізді, алайды оның есесіне мыстың бағасы 11 % арзандады. Операциялық кіріс \$410 млн (бірінші жарты жылдықта \$464) құрады.

КОРПОРАТИВТІК ОБЛИГАЦИЯЛАРДЫҢ НАРЫҒЫ

01 қыркүйектегі жағдай бойынша KASE ресми тізімінде 66 эмитенттің корпоративтік облигацияларының 255 шығарылымы енгізілген. Тамыз айында Биржаның ресми тізіміне 6 эмитенттің 6 облигациялар шығарылымы енгізілді: "МеталлИнвестАтырау" ЖШС, "Фонд проблемных кредитов" АҚ, "Аграрлық несие корпорациясы" АҚ, "Бәйтерек девелопмент" АҚ, "Novacom Corporation" ЖШС, "Бәйтерек" ҰБХ" АҚ.

KASE сауда-саттық тізімдерінен тамыз айында төрт эмитенттің корпоративтік облигацияларының бес шығарылымы айналыста болу мерзімі аяқталуына байланысты шығарылды.

Айналыстағы корпоративтік борыштың көлемі 0,8 % немесе 95,3 млрд теңгеге өсіп, 11,9 трлн теңгеге жетті.

KASE_BMY корпоративтік облигациялардың кірістілік индексінің мәні тамызда 1 базистік нүктеге көтеріліп, жылдық 10,75 % құрады.

Биржадағы корпоративтік облигациялардың сауда-саттықтарының көлемі шілде айымен салыстырғанда 27,7 % немесе 61,2 млрд теңгеге азайып, 159,6 млрд теңге болды. Сауда-саттықтардың орташа күндік көлемі 7,6 млрд теңге, орташа күндік мәмілелердің саны – 8, бір мәміленің орташа көлемі – 907 млн теңгені құрады.

Тамыз айында корпоративтік облигациялардың бастапқы нарығында жеті шығарылым орналастырылды, олардың жалпы сомасы 106 млрд теңге болды, бұл шілде айындағы осы көрсеткіштен 47,8 % немесе 97 млрд теңге төмен.

- "Көтерме-бөлшек сауда кәсіпорны" АҚ 06 тамызда жеті жылдық облигацияларын жылдық 10,4975 %-бен орналастырып, 480,5 млн теңге тартты;
- "Баспана" Ипотекалық ұйымы" АҚ 06 тамызда өз облигацияларын орташа сараланған кірістілігі жылдық 10,3440 %-бен орналастырып, 23,6 млрд теңге тартты;
- "Проблемалық несиелер қоры" АҚ 14 тамызда он жылдық облигацияларын жылдық 9,0 %-бен орналастырып, 10,1 млрд теңге тартты;
- "Еуразиялық банк" АҚ 15 тамызда жеті жылдық облигацияларын жылдық 10,95 %-бен орналастырып, 2,0 млрд теңге тартты;
- "Қазақстан темір жолы" Ұлттық компаниясы" АҚ 20 тамызда 40 млрд теңге тартты;
- Банк ВТБ (Қазақстан) Еншілес ұйымы АҚ 20 тамызда екі жылдық облигацияларын жылдық 10,42 %-бен орналастырып, 4,9 млрд теңге тартты;
- "Бәйтерек" Ұлттық басқарушы холдингі" АҚ 29 тамызда он жылдық облигацияларын жылдық 9,75 %-бен орналастырып, 25 млрд теңге тартты.

Инвесторлардың негізгі санаттары бойынша корпоративтік облигациялардың бастапқы нарығындағы ЕДБ үлесі (ЕДБ) – 14,2 %, брокер-дилерлердің еншісінде – 0,1 % жетер-жетпес, басқа институционалдық инвесторлардың үлесі – 45,6 %, өзге заңды тұлғалардың еншісі – 40,2 %. Резидент еместер сауда-саттықтарға қатысқан жоқ.

Облигациялардың қайталама нарығындағы сауда-саттықтарды көлемі 3 есе немесе 35,9 млрд теңге өсіп, 53,6 млрд теңгеге жетті.

Инвесторлардың негізгі санаттары бойынша корпоративтік облигациялардың қайталама нарығындағы екінші деңгейдегі банктердің үлесі (ЕДБ) – 2,8 %, брокер-дилерлер – 0,5 %, басқа институционалдық инвесторлар – 93,5 %, өзге заңды тұлғалар – 0,3 %. Резидент еместердің қатысу үлесі 0,2 %.

МБҚ НАРЫҒЫ

Қазақстан қор биржасында саудаланатын мемлекеттік борыштың коминалды құны тамыз айында 3,4 % немесе 420,8 млрд теңгеге өсіп, 12,7 трлн теңгені құрады.

МБҚ нарығындағы сауда-саттықтардың тамыз айындағы көлемі 81,7 % немесе 311,2 млрд теңгеге азайып, 69,6 млрд теңгені құрады. Сауда-саттықтың орташа күндік көлемі 3,3 млрд теңге деңгейінде қалыптасты, орташа күндік мәмілелер саны – 3, бір мәміленің орташа көлемі – 1 млрд теңге болды.

МБҚ нарығының бастапқы нарығының көлемі 39,9 млрд теңгені құрап, шілде айымен салыстырғанда 88,5 % немесе 308,9 млрд теңгеге азайған. Алты облыстың, Алматы, Нұр-Сұлтан және Шымкент қалаларының жергілікті атқарушы органдарының мемлекеттік бағдарламаларын жүзеге асыру шегінде 11,6 млрд теңгені жылдық 0,35 % тартты. Қалған көлем – 28,3 млрд теңгені, айта кетсек бұл шілде айының көрсеткішінен 91,9 % немесе 320,5 млрд теңгеге кем көрсеткіш, – қаржы министрлігі облигациялардың жеті шығарылымын жылдық 8,55–9,75 %-бен орналастыру арқылы тартқан.

Бастапқы нарықтағы инвесторлардың негізгі санаттарының құрылымында екінші деңгейдегі банктердің үлесі (ЕДБ) – 18,2 %, басқа институционалдық инвесторлар – 52,7 %, өзге заңды тұлғалар – 29,1 %. Резидент еместер сауда-саттықтарға қатысқан жоқ.

Қайталама нарықтағы сауда-саттықтардың көлемі 7,3 % немесе 2,3 млрд теңгеге азайып, 29,6 млрд теңгені құрады. Қайталама нарықтағы сауда-саттықтардың жалпы айналымынан 88,4 % Ұлттық Банктің ноталары.

Инвесторлардың негізгі санаттарының құрылымында ЕДБ үлесі – 40,7 %, брокер-дилерлер – 2 %, басқа институционалдық инвесторлар – 34,1 %, өзге заңды тұлғалар – 23,2 %. Резидент еместер сауда-саттықтарға қатысқан жоқ.

ХҚҰ ОБЛИГАЦИЯЛАРЫ

Есептік кезеңнің соңында KASE сауда-саттық тізімдерінде бес халықаралық қаржы ұйымдары облигацияларының 27 шығарылымы болды: Еуразиялық даму банкі, Еуропалық қайта құру және даму банкі, Еуропалық инвестициялық банк, халықаралық қаржы корпорациясы (IFC) және Азиялық даму банкі.

Есептік айда ХҚҰ облигациялары секторында орналастырулар болған жоқ.

Қайталама нарықтағы сауда-саттықтардың көлемі 5 млрд теңгені құрады. Оның 50 %, заңды тұлғалар болып табылатын, брокерлік-дилердік компаниялардың клиенттері жасасқан мәмілелер болса, қалған 50 % институционалдық инвесторлардың еншісінде болды.

ИНВЕСТИЦИЯЛЫҚ ҚОРЛАРДЫҢ ҮЛЕСПҰЛДАРЫ

01 қыркүйектегі жағдай бойынша "Инвестициялық қорлардың бағалы қағаздары" секторында алты компанияның басқаруындағы жеті қаржы құралы болды.

Сауда-саттық көлемі 65,4 % төмендеп, 20,2 млн теңгені құрады. Мәмілелердің көлемі бойынша көшбасшы State Street Global Advisors басқаруындағы US_SPY_ (9,8 млн теңге; 15 мәміле) үлеспұлдары болды, екінші орында "BCC Invest" АҚ басқаруындағы BCC1_cc (4 млн KZT; 1 мәміле), ал үшінші орындана – FinEx FFIN Kazakhstan Equity ETF қосалқы қорының IE_FXBF акциялары (ETF KASE Индексіне; 3,4 млн теңге; 17 мәміле) және төртінші орында – "Сентрас Секьюритиз" АҚ басқаруындағы CSECfe (3 млн KZT; 1 мәміле) үлеспұлдар орналасты.

Инвесторлардың негізгі санаттары бойынша жеке тұлғалардың еншісінде – 57,9 %, 32 % – брокер-дилерлер және 10,2 % – өзге заңды тұлғалар.

ҚОР НАРЫҒЫНДАҒЫ ЖЕКЕ ТҰЛҒАЛАРДЫҢ ШОТТАРЫ

2019 жылдың 01 қыркүйегіндегі жағдай бойынша Орталық депозитарийде жеке тұлғаларға ашылған, 120 070 жеке шот болды, бұл 383 осында бір ай бұрынғы көрсеткіштен артық, және 2019 жылдың басындағы санынан 3 246 шотқа артық.

ШЕТЕЛ ВАЛЮТАЛАРЫНЫҢ НАРЫҒЫ

Шетел валюталары нарығындағы сауда-саттықтардың көлемі 996,1 млрд теңге деңгейінде қалыптасты, бұл өткен айдың көрсеткішінен 5,2 % немесе 54,7 млрд теңгеге төмен. Сауда-саттықтардың орташа күндік көлемі 47,4 млрд теңге, орташа күндік мәмілелердің саны – 383, бір мәміленің орташа көлемі – 123,7 млн теңге.

Төмендегі кестеде Биржада саудаланатын валюталық жұптардың негізгі сипаттамалары берілген (жақшада бағамның алдыңғы жылмен 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, валюта бірлігіне KZT	айдың соңындағы бағамы (% өзг.)
USD/KZT	2 557,9 (-6,0 %)	99,3 % (-0,10 %)	7 868 (-385)	385,01 – 387,73	387,44 (+0,8 %)
RUB/KZT	435,7 (+16,2 %)	0,3 % (+0,04 %)	88 (+25)	5,7900 – 6,0571	5,8249 (-3,8 %)
CNY/KZT	48,8 (X 2,1)	0,3 % (+0,15 %)	72 (+8)	53,9869 – 55,7250	54,0750 (-3,1 %)
EUR/KZT	3,6 (-39,6 %)	0,2 % (-0,09 %)	24 (-6)	425,40 – 434,85	430,00 (+0,3 %)

Берілген мәліметтерден теңгенің негізгі валюталарға қатысты тұрақталуын және рубль мен юаньға қатысты нығаюын байқауға болады.

Теңгенің долларға қатысты бағамы үш теңге шамасындағы әлсіз төмендеген баға арнасында болды. Теңгенің әлсіздеуі бағытындағы шамалы төмендеуге Қытай мен АҚШ арасындағы сауда қырқысы тұсындағы әлем экономикаларының қарқынының баяулауы тәуекелі, дүниежүзілік өндірістің бәсеңсіюі және тұрғындардың жұмыспен қамтылуының төмендеу салдарынан болған. Бұдан басқа, Ресейге қарсы ықпалшаралар риторикасының сақталуын да айта кеткен жөн.

АҚША НАРЫҒЫ

Тамыз айының соңында TONIA индикаторы 139 б.н. өсіп, жылдық 9,66 % құрады, сондай-ақ TWINA индикатор 102 б.н.артып, жылдық 9,36 % құрады.

Бір күндік долларлық своптың кірістілігі SWAP-1D (USD) тамыздың соңында жылдық 9,83 % жетіп, бір айда 192 б.н. артты. Екі күндік своптың кірістілігі SWAP-2D (USD) 185 б.н. өсіп, до жылдық 10,12 % құрады.

Тамызда KazPrime-3M (KZT) индикаторы Ұлттық Банктің базалық мөлшерлемесінің жоғарғы шегіне қарай қозғалысын жалғастырып, жылдық 10 % құрады.

Бір жұмыс күнге ашылған, USD/KZT валюталық своп операциялары және МБҚ-мен автоматты репо операциялары бойынша мәміленің көлемі арқылы орташа сараланған кірістіліктің мәнін көрсететін, ақша нарығының композиттік индикаторы MM_Index, тамыз айының соңында 147 б.н. өсіп, жылдық 9,69 % құрады.

Репо операцияларының нарығы

Осы сегменттегі сауда-саттықтардың көлемі 4,8 трлн теңгені құрады, бұл өткен жылдың ұқсас көрсеткішінен 8,9 % немесе 470,5 млрд теңге жоғары. Операциялардың орташа күндік көлемі 229,2 млрд теңге, мәмілелердің орташа күндік саны – 363, бір мәміленің орташа көлемі – 631,9 млн теңгені құрады.

Репо ашылу операциялары сауда-саттықтарының жалпы көлемінен 97,2 % 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 87,8 % құрады.

Валюталық своп операциялары

Валюталық своп нарығындағы сауда-саттық көлемі 4,7 % өсіп, 2 763 млрд теңгені құрады. Операциялардың орташа күндік көлемі 131,6 млрд теңгені құрады, мәмілелердің орташа күндік саны – 45, бір мәміленің орташа көлемі – 2,9 млрд теңге болды.

Сауда-саттықтың жалпы көлеміндегі құралдық құрылымы 78,7 % (2,2 трлн теңге немесе 5,6 млрд USD) екі күндік валюталық своп (USDKZT_0_002) мәмілелерінің үлесінде болды.

Тамыз айында "ұзын" валюталық своптармен 17 мәміле жасалды – 13 мәміле мерзімі бір апталық своптармен сомасы 145 млн АҚШ доллары (56,1 млрд теңге) жылдық 7,8–9,7 %-бен, және төрт мәміле бір айлық своптармен жылдық 8-8,5 % мөлшерлемесі бойынша жасалып, сомасы 40 млн АҚШ долларын (15,5 млрд теңге) құрады.

ДЕРИВАТИВТЕР НАРЫҒЫ

Осы кезде биржалық нарықтың осы секторында, базалық активтері АҚШ доллары, KASE Индексі және акциялардың кейбір атаулары болып табылатын, фьючерстер саудалауға қолжетімді. Тамыз айында АҚШ долларының бағамына апталық фьючерспен, көлемі 387,6 млн теңге, бір мәміле жасалды. Фьючерстің ақырғы есептесу бағасы бір АҚШ долларына 387,21 теңгені құрады. Қыркүйектің басына қарай деривативтер нарығында сауда-саттыққа қатысушылардың ашылған жайғасымдары болған жоқ.

Анықтама үшін

"Қазақстан қор биржасы" АҚ (KASE) Орталық Азия аймағындағы жетекші қор биржасы болып табылады. KASE бағалы қағаздармен сауда-саттық көлемі бойынша ТМД қор биржаларының арасында екінші орын, ал FEAS қор биржаларының арасында нарықтық капиталдандыру деңгейінде алтыншы орын алады.

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.

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