

## БАСПАСӨЗ МӘЛІМДЕМЕСІ

Алматы қ.

11 наурыз 2020 жыл

### **KASE 2020 жылдың ақпан айындағы биржалық нарықтың жұмыс нәтижелерін ұсынады**

"Қазақстан қор биржасы" АҚ (KASE, Биржа) 2020 жылдың ақпан айындағы биржалық нарықтың жұмыс нәтижелерін ұсынады.

- KASE сауда-саттықтарының жиынтық көлемі ақпан айында 10 252,9 млрд теңгені құрап, қаңтар айымен салыстырғанда 12,2 % немес 1 115,2 млрд теңгеге өсті.
- Үстіміздегі жылдың ақпан айында KASE ресми тізіміне "Қазақстанның Даму Банкі" АҚ халықаралық облигацияларының бір шығарылымы енгізілді.
- 2020 жылдың ақпан айының қорытындысы бойынша KASE Индексінің мәні 3,3 % төмендеп, 2 222,59 нүктені құрады.
- Нарықтың капитализациясы 0,02 % азайып, 17,1 трлн теңгені құрады.
- Саудаланатын корпоративтік борыштық көлемі 0,3 % өсіп, 12,9 трлн теңгені құрады.
- Корпоративтік облигациялар секторында бастапқы орналастырулардың көлемі 30,6 млрд теңгеге жетті.
- 2020 жылдың 01 наурызындағы жағдай бойынша Орталық депозитарийде 118 773 жеке тұлғаларға ашылған жеке шоттар болды, бұл бір ай бұрынғы көрсеткіштен 1 141 шотқа артық және 2019 жылдың басындағы санынан 1 949 шотқа артық.

### **АКЦИЯЛАР САНЫ**

Ақпан айының қорытындысы бойынша акциялар нарығының капиталға айналуы 0,02 % немесе 4 млрд теңгеге төмендеп, 17,1 трлн теңгені құрады.

Айдың соңында KASE сауда-саттық тізімдерінде 123 эмитенттің 139 атаудағы акциялары тұрды, олардың үш шығарылымы "листингілік емес бағалы қағаздар" секторында айналысқа жіберілген. 2020 жылы акциялар тізімінде өзгерістер болған жоқ.

Акциялар сауда-саттықтарының көлемі қаңтар айымен салыстырғанда 80,3 % немесе 14,4 млрд теңгеге төмендеп, 3,5 млрд теңгені құрады.

Акциялармен жасалған мәмілелердің жиынтық көлеміндегі инвесторлардың негізгі санаттары бойынша жеке тұлғалардың үлесі – 43,3 %. Екінші деңгейдегі банктердің (ЕДБ) үлесі – 0,4 %, брокер-дилерлердің үлесі – 24,8 %, басқа институционалдық инвесторлар – 7,5 %, өзге заңды тұлғалардың үлесі – 23,9 %. Резидент еместердің қатысуы – 16 % шамасында болды.

### **KASE ИНДЕКСІ**

Ақпан айының қорытындысы бойынша Қазақстан қор нарығының басты индикаторы 3,3 % төмендеп, 2 222,59 нүктеге жетті. KASE Индексінің салыстырмалы тұрақтылығына теңгенің бір АҚШ долларына 375 теңге деңгейінде теңгені нығаюы және Fitch Ratings халықаралық рейтингтік агенттігінің Қазақстанның ұлттық және шетел валютасындағы ұзақ мерзімді рейтингтерін "BBB" деңгейінде растағаны ықпал етті. Есептік ай барысында KASE Индексінің

өсуі және төмендеу драйвері "Қазақстан халық жинақ банкі" АҚ және KAZ Minerals PLC жай акцияларының қозғалысы болды, олардың әрқайсысының KASE Индексінің қоржынындағы үлес салмағы 15 % деңгейінде. KAZ Minerals PLC акцияларының баға белгілеулерінің төмендеуі еліміздің ең ірі банкінің баға белгілеулерінің өсуінің KASE Индексіне ықпалын нивелирледі. KAZ Minerals PLC тобының позитивті қаржылық нәтижелеріне қарамастан, шикізат нарықтарының баға конъюнктурасының төмендеуі компания акцияларын инвесторлар тарапынан жаппай сатуын күшейтті.

Эмитент	Сауда-саттық коды	Бағаның өзгеруі		
		01.02.2020	01.03.2020	2020 ақпанында
"Қазақстан халық жинақ банкі" АҚ	HSBK	137,22	142,80	+4,1 %
"KEGOC" АҚ	KEGC	1 600,00	1 606,93	+0,4 %
"Банк ЦентрКредит" АҚ	CCBN	237,00	237,00	0,0 %
"Қазатомөнеркәсіп" ұлттық атомдық компаниясы" АҚ	KZAP	5 050,00	4 865,00	-3,7 %
"Кселл" АҚ	KCEL	2 380,00	2 271,86	-4,5 %
"Қазақтелеком" АҚ	KZTK	24 801,00	23 501,02	-5,2 %
"ҚазТрансОйл" АҚ	KZTO	1 029,97	974,42	-5,4 %
KAZ Minerals PLC	GB_KZMS	2 329,00	2 111,50	-9,3 %

Ақпанда "Қазақстан халық жинақ банкі" АҚ жай акциялары 4,1 % қымбаттады, ал 2020 жылдың басынан бастап бағалы қағаздың бағасының өсуі KASE сауда-саттық алаңында 9 % құрады. London Stock Exchange (LSE) сауда-саттық алаңында көрсеткіштер ұқсас болды - тиісінше 3,8 % және 4,9 %. Банктің бағалы қағаздарының құнының өсуінің елеулі факторы оның сектордағы жайғасымының тұрақтылығы, сондай-ақ 2019 жылдың қорытындысы бойынша таза пайданың өсуі және соған байланысты дивиденділік төлемдердің ұлғаюы күтілуде. Ақпан айының соңында жай акциялардың құны KASE және LSE қор нарықтарының сауда-саттық алаңдарында түзетіліп, алдындағы акциялар құнының қатты өсуі жаңа локальды максимумдардан кері қайтуына себеп болды. 2012 жылдың декабрь айындағы 1:10 пропорциясында акциялардың сплиті жүзеге асырылғаннан кейін, 2020 жылдың 21 ақпанында банктің бір жай акциясының құны максималды мәнге жетті.

Индекстік қоржынның басты аутсайдері KAZ Minerals PLC жай акциялары болды. Ақпан айында өндірушінің жай акциялары 9,3 % арзандап, ал 2020 жылдың басынан бастап – 19,7 % бағасы түсті. Бағалы қағаздың LSE сауда-саттықтарындағы көрсеткіштері ұқсас болып, тиісінше 6,4 % және 22,9 % құрады. Бағалы қағаздардың баға белгілеулерінің аз ғана қалпына келуі KAZ Minerals тобының берешегін қайта қаржыландыру және компанияның оң мәнді қаржылық нәтижелері туралы жаңалық қамтамасыз етті. Компаниялар тобы бойынша сатудан түскен кірістер, жыл бойы мыстың орташа бағасы төмендегеніне қарамастан, 2019 жылы \$2,266 млрд (2018 – \$2,162 млрд) дейін ұлғайған. Өсім жоғарғы өндірістік көрсеткіштердің арқасында болды, сондай-ақ мыс пен алтынды сату көлемдері 2018 жылмен салыстырғанда тиісінше 7 % және 33 % артқан. Bloomberg мәліметтері бойынша, London Metal Exchange (LME) тауарлық биржада ақпан айында мыс фьючерстерінің құны 1,2% өсіп, ал жылдың басынан бастап 9 % төмен болған. Компанияның Жаһандық депозиттік қолхаттарының бағасы LSE биржасында 2020 жылдың ақпанында 6,4 % арзандап, ал жылдың басынан бастап жалпы төмендеу 22,9 % құрады. Коронавирустың өршуі туралы жаңалықтар, ал соның салдарынан Қытай мен әлемнің жалпы экономикасының баяулауы, акциялардың ай бойы бағасының төмендеуіне кері ықпалын тигізді. Ақпан айының соңында KAZ Minerals PLC бір жай акцияның құны KASE сауда-саттық алаңында 2 111,50 теңгені құрады, бұл 2017 жылдың шілде айынан бастап минималды мән болып табылады.

## КОРПОРАТИВТІК ОБЛИГАЦИЯЛАРДЫҢ НАРЫҒЫ

Ақпан айының соңында KASE ресми тізімінде 72 эмитенттің корпоративтік облигацияларының 272 шығарылымы болды.

KASE ресми тізіміне "Қазақстанның Даму Банкі" АҚ XS2106835262 (BRKZe10) халықаралық облигацияларының бір шығарылымы енгізілді.

Корпоративтік борыштың көлемі ақпанда 0,3 % немесе 42,1 млрд теңгеге өсіп, 12,9 трлн теңгеге жетті.

KASE\_BMY корпоративтік облигациялардың кірістілік индексінің мәні 3 базистік нүктеге өсіп, жылдық 10,72 % құрады.

Корпоративтік облигациялардың сауда-саттықтарының көлемі Биржада қаңтар айымен салыстырса, 41,8 % немесе 24,6 млрд теңге азайып, 34,3 млрд теңгені құрады.

Ақпан айында корпоративтік облигациялардың бастапқы нарығында төрт шығарылым орналастырылып, олардың жалпы көлемінің сомасы 30,6 млрд теңгені құрады, бұл қаңтарданы орналастырылымдардың жалпы көлемінен 30,6 % немесе 13,5 млрд теңгеге төмен:

- "Баспана" Ипотекалық ұйымы" АҚ өзінің KZ2C00006336 (BASPB6) және KZ2C00006484 (BASPB8) облигацияларын орташа сараланған кірістілігі жылдық 10,70 %-бен орналастырып, тиісінше 15,8 млрд теңге және 13,4 млрд теңге тартты;
- "ҚазАгроҚаржы"АҚ 07 ақпанда өтеуге дейін қалған мерзімі 4,9 жыл, орташа сараланған кірістілігі 13,00 % KZ2C00006385 (KAFB9) облигацияларын 1,0 млрд теңге тартты;
- "ТехноЛизинг" ЖШС 13 ақпанда өтеуге дейін қалған мерзімі 3,8 жыл, орташа сараланған кірістілігі 16,00 % KZ2P00006299 (THLZb1) облигацияларын 405,2 млн теңге тартты.

Инвесторлардың негізгі санаттары бойынша корпоративтік облигациялардың бастапқы нарығында ЕДБ үлесі – 43,4 %, брокер-дилерлердің үлесі – 5 %, басқа институционалдық инвесторлар – 36,9 %, өзге заңды тұлғалардың үлесі – 14,7 %, жеке тұлғалардың үлесі – 0,1 %. Резидент еместердің қатысу үлесі 1,1 % құрады.

Облигациялардың қайталама нарығындағы сауда-саттық көлемі 75,4 % немесе 11,1 млрд теңгеге төмендеп 3,6 млрд теңгені құрады.

Корпоративтік облигациялардың қайталама нарығындағы инвесторлардың негізгі санаттары бойынша ЕДБ үлесі – 30,4 %, брокер-дилерлердің үлесі – 16,1 %, басқа институционалдық инвесторлар – 25,8 %, өзге заңды тұлғалардың үлесі 22,5 %, жеке тұлғалардың үлесі – 5,2 % болды. Резидент еместердің қатысу үлесі 5,9 % құрады.

## МЕМЛЕКЕТТІК БАҒАЛЫ ҚАҒАЗДАР НАРЫҒЫ

Биржада саудаланатын мемлекеттік борыштың номиналды құны ақпан айының қорытындысы бойынша 3,1 % немесе 416,1 млрд теңгеден 13,9 трлн теңгеге дейін артты.

Қазақстан қор биржасында қаңтар айында МБҚ нарығындағы сауда-саттық көлемі 47,7 % млрд немесе 87 млрд теңгеге төмендеп, 95,3 млрд теңгеге жетті.

Алғашқы нарық көлемі 89,3 млрд теңгені құрады, ол қаңтар айының нәтижесінен 46,9 % төмен. Оның ішінде 10 млрд теңгені Нұр-Сұлтан қаласының әкімдігі тартты, Қаржы миинстрлігі жылдық 9,50-9,65 %-бен 79,3 млрд теңгені тартты, ол қаңтар айының көрсеткішінен 53 %. Сатып алушылар ретінде ЕДБ қатысты, олардың үлесі 3,4 %, брокер-дилерлер үлесі 0,8 % құрады, өзге институционалдық инвесторлар үлесі 84,4 %, өзге заңды тұлғалардың үлесі 11 % асты. Алғашқы нарықтағы бейрезиденттер мәмілелері қатысқан жоқ.

Қайталама нарықтағы сауда-саттық көлемі 57,4 % немесе 8,2 млрд теңгеге төмендеп, 6,1 млрд теңгеге дейін жетті. Қайталама нарықтағы сауда-саттықтың жалпы айналымы Ұлттық Банк ноттарының 97 % қалды. Көлемі 166,5 млн теңге бес мәміле шет ел мемлекеттерінің МБҚ жасалды.

Қайталама нарықтағы инвесторлардың негізгі санатында ЕДБ үлесі 48 % ЕДБ үлесіне, брокер-дилерлердің үлесі – 8,1 %, өзге институционалдық инвесторлар – 5,6 %, өзге заңды тұлғалар - 38,2 %, жеке тұлғалар – 1 %. Резидент еместер сауда-саттыққа қатыспады.

## ХҚҰ ОБЛИГАЦИЯЛАРЫ

Есептік айда KASE сауда-саттық тізімдерінде бес халықаралық қаржы ұйымдары облигацияларының 30 шығарылымы болды, соның ішінде: Еуразиялық даму банкі, Еуропалық қайта құру және даму банкі, Еуропалық инвестициялық банк, Халықаралық қаржы корпорациясы (IFC) және Азия даму банкі.

Есептік айда Қазақстан қор биржасында ХҚҰ облигацияларын орналастыру өткізілген жоқ.

## ИНВЕСТИЦИЯЛЫҚ ҚОРЛАРДЫҢ ҮЛЕСПҰЛДАРЫ

2020 жылдың 01 қаңтарындағы жағдай бойынша "Инвестициялық қорлардың бағалы қағаздар" секторында сегіз компанияның басқаруындағы 11 қаржы құралы болды.

Есептік кезеңде сауда-саттық көлемі 402,9 млн теңгені құрап, қаңтар айына қарағанда 3,9 % немесе 299,1 млн теңгеге өсті.

Құралдар	Көлемі, млн KZT	Мәміле саны
US_BIL_	240,1	7
CSECFE	73,7	7
CSECGM	43,1	9
FFIN_or	40,4	2
US_SPY_	4,9	8
IE_FXBF	0,7	21
	<b>402,9</b>	<b>54</b>

Негізгі инвесторлар құрамына 54,8 % жеке тұлғаларға – 30,5%, брокер-дилерлердің үлесіне – 14,7 % өзге заңды тұлғаларға келді.

## БАҒАЛЫ ҚАҒАЗДАР НАРЫҒЫНДАҒЫ ЖЕКЕ ТҰЛҒАЛАРДЫҢ ШОТТАРЫ

2020 жылдың 01 наурызындағы жағдай бойынша Орталық депозитарииде жеке тұлғалар ашқан 118 773 жеке шот бар, ол өткен аймен салыстырғанда 1 141 шотқа көп және 2019 жылдың басына қарағанда 1 949 шотқа артық.

## ШЕТЕЛ ВАЛЮТАЛАРЫНЫҢ НАРЫҒЫ

Шет ел валюталарының нарығында сауда-саттық көлемі 797,8 млрд теңгеге жетті, ол өткен жылдың көрсеткішіне қарағанда 11,9 % немесе 107,4 млрд теңгеге аз.

Келесі кестеде KASE саудаланатын валюталық жұбының негізгі сипаттамасы келтірілген (жақшаның ішінде өткен жылдың сәйкес кезеңінде көрсеткішінің өзгеруі көрсетілген, бағамның өзгеруі шет елдік валютаның теңгеге орташа сараланған биржалық бағамының номиналдық өзгеруін көрсетеді).

Жұп	Көлемі, млн валюта бірлігі	Сауда-саттық көлеміндегі үлесі, %	Мәміле саны	Мин. және макс. бағамдары, валюта бірлігіне KZT	жылдың соңындағы бағамы (% өзг.)
USD/KZT	2 097,7 (-11,5 %)	99,4 % (+0,24 %)	5 937 (-842)	375,94 – 381,19	381,19 (+0,56 %)
RUB/KZT	396,2 (+8,4 %)	0,3 % (+0,04 %)	67 (+6)	5,6976 – 6,0027	5,6976 (-5,31 %)
CNY/KZT	18,7 (-65,8 %)	0,1 % (-0,20 %)	37 (-1)	53,4087 – 54,3150	54,5840 (-0,49 %)
EUR/KZT	3,5	0,2 %	19	406,00 – 421,30	417,90

(-37,7 %)

(-0,08 %)

(-10)

(+0,34 %)

## АҚША НАРЫҒЫ

Ақпан айының соңында TONIA индикаторы (мерзімі бір жұмыс күндік репо ашылу мәмілелері бойынша орташа сараланған пайыздық мөлшерлемесі) 110 б.н. төмендеп, жылдық 9,14 % -дан 10,24 %-ға дейін құрады, сонымен қатар TWINA индикаторының мәні (мерзімі жеті жұмыс күндік репо ашылу мәмілелерінің орташа сараланған пайыздық мөлшерлемесі) 51 б.н. өсіп, жылдық 9,24 %-дан 9,75 % -ға дейін артқанын көрсетті.

KazPrime-3M (KZT) индикаторы ақпан айы бойы өзгеріссіз қалды және жылдық 10,25 % құрады, сондай-ақ KIBOR индикаторы өзгеріссіз қалды.

Ақпан айының соңында бір күндік долларлық своп кірістілігі бір айда 212 б.н. артып, SWAP-1D (USD) жылдық 10,69 % құрады. Екі күндік своп кірістілігі SWAP-2D (USD) 179 б.н. өсіп, жылдық 10,34 % құрады.

KazPrime-3M (KZT) индикаторы өзінің қозғалысын Ұлттық банктің базалық мөлшерлемесінің жоғары шегінде жалғастырып, индикаторы жылдық 10,25 % құрады.

USD/KZT валюталық своп операциялары бойынша кірістіліктің мәміле мәнін көрсететін MM\_Index қаржы нарығының композиттік индикаторы және бір жұмыс күніне ашылған МБҚ автоматты репо операцияларымен ақпан айының соңына қарай 114 б.н. артып, жылдық 9,11 %-дан 10,25 %-ға дейін артты.

## РЕПО ОПЕРАЦИЯЛАРЫНЫҢ НАРЫҒЫ

Осы сегменттегі сауда-саттық көлемі 8 032,3 млрд теңгені құрады, бұл өткен айдың көрсеткішінен 1 791,2 млрд теңге немесе 28,70 % жоғары.

Репо ашылу операциялары сауда-саттықтарының жалпы көлемінен 98,10 % 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 97,04 % құрады.

## ВАЛЮТАЛЫҚ СВОП ОПЕРАЦИЯЛАРЫ

Валюталық своп нарығындағы сауда-саттық көлемі 34,29 % немесе 442,1 млрд теңгеден 1 289,3 млрд теңгеге дейін төмендеді. Сауда-саттықтың жалпы көлеміндегі құралдық құрылымы 61,6 % екі күндік валюталық своп (USDKZT\_0\_002) мәмілелерінің үлесінде болды.

Ақпан айында "ұзақ" валюталық своппен бір айда жалпы сомасы 26,42 млрд теңгеге мәміле жасалды.

## ДЕРИВАТИВТЕР НАРЫҒЫ

Осы кезде биржалық нарықтың осы секторында, базалық активтері АҚШ доллары, KASE индексі және акциялардың кейбір атаулары болып табылатын, фьючерстер саудалауға қолжетімді. Қаңтар айында апталық фьючерстермен мәміле жасалған жоқ. Ақпан 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 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](mailto:pr@kase.kz).