



Қазақстан қор биржасы
Казахстанская фондовая биржа
Kazakhstan Stock Exchange

Республика Казахстан, г. Алматы
БЦ "Алматы Тауэрс", 8 этаж
Тел.: +7 (727) 237 5342, email: pr@kase.kz

БАСПАСӨЗ МӘЛІМДЕМЕСІ

Алматы қ.
жыл

11 мауысым 2019

KASE 2019 жылдың мамыр айындағы биржалық нарықтың жұмыс қорытындыларын жариялайды

- 2019 жылдың мамырында KASE сауда-саттықтарының жиынтық көлемі 10 342,5 млрд теңгені құрап, 2019 жылдың сәуір айымен салыстырғанда 4 % немесе 425,4 млрд теңгеге төмендеді.

Мамыр айының қорытындысы бойынша:

- Бағалы қағаздар нарығы (+21 % немесе +60,1 млрд теңге) және шет елдік валюталар (+2,1 % немесе +16,9 млрд теңге) нарығы оң динамиканы көрсетті:
- Бағалы қағаздар нарығында өсім нарықтың барлық секторында тіркелді
 - акциялар бойынша – 28,3 %;
 - МБҚ бойынша – 1,6 %;
 - корпоративтік облигациялар бойынша – 10 %;
 - ХҚҰ облигациялары бойынша – 83,6 %;
 - инвестқорлардың БҚ бойынша – 3,9 есе.
- 2019 жылдың мамыр айының қорытындысы бойынша KASE Индексінің мәні 3,3 % төмендеп, и 2 256,68 нүктені құрады.
- 2019 жылдың 01 маусымында акциялар нарығын қаржыландыру 15,6 трлн теңге (-2 %) көлемінде қалыптастырылды.
- 2019 жылдың мамыр айының қорытындысы бойынша саудаланатын корпоративтік борыш көлемі 0,5 % дейін төмендеп, 11,5 трлн теңгені құрады.
- 2019 жылдың 01 маусымында Орталық депозитарийде жеке тұлғалардың атына ашылған 119 037 жеке шоттар ашылды, ол алдыңғы айға қарағанда 238 шотқа және 2019 жылдың басына қарағанда 2 213 шотқа артық.

АКЦИЯЛАР НАРЫҒЫ

2019 жылдың мамыр айының қорытындысы бойынша акциялар нарығының капитализациясы 2 % төмендеп немесе 320,4 млрд теңгеден 15,6 трлн теңгеге дейін құлдырады. Көрсеткіштің төмендеуіне үлестік құралдарының кері баға динамикасы әсер етті.

Айдың соңына қарай KASE сауда-саттық тізімдерінде 139 эмитенттің 124 атаудағы акциялары болды, соның ішінде екі атаудағысы листинглік емес бағалы қағаздар секторында айналысқа жіберілді.

мамыр айында акциялармен сауда-саттық көлемі сәуір айына қарағанда 28,3 % өсіп немесе 2,4 млрд теңгеден 10,7 млрд теңгеге жетті. Сауда-саттықтың орташа күндік көлемі 533,5 млн теңгені құрады. Мәмілелердің орташа күндік саны – 385. Бір мәміленің орташа көлемі – 1,4 млн теңге.

Инвесторлардың негізгі санаттары бойынша ең белсенді жеке тұлғалар болды, олардың шоттарына акциялардың жалпы айналымының 55,3 % тиесілі болды. Брокер-дилерлердің қатысу үлесі 22,6 %, басқа институционалдық инвесторлардың шоттарына 1,3 % тиесілі, екінші деңгейдегі банктердің үлесі (ЕДБ) 0,1 %, заңды тұлғалардың үлесі 20,7 %. Резидент еместердің қатысуы 36,6 % болды.

KASE Индексі

Мамыр айының қорытындысы бойынша KASE Индексінің мәні 3,3 %, немесе 76,49 нүктеден 2 256,68 нүктеге құлдыраумен аяқтады (2019 жылдың 25 қаңтарынан бастап жабылудың ең төменгі деңгейі және 2018 жылдың соңынан 2,1 %, немесе 48,3 нүктеге төмен).

KASE өкілетті тізіміне енгізілген акциялар бағаларының өзгеруі

Эмитент	Сауда-саттық коды	Бағасы		Баға өзгеруі
		01.05.2019	01.06.2019	мамырда
"Қазақтелеком" АҚ	KZTK	25 749,50	26 790,00	+4,04%
"Банк ЦентрКредит" АҚ	CCBN	234,02	239,79	+2,47%
"Қазақстан Халық жинақ банкі" АҚ	HSBK	105,05	107,41	+2,25%
"Кселл" АҚ	KCEL	1 967,29	1 951,00	-0,83%
"KEGOC" АҚ	KEGC	1 638,00	1 606,99	-1,89%
"КазТрансОйл" АҚ	KZTO	1 254,30	1 175,00	-6,32%
KAZ Minerals PLC	GB_KZMS	3 229,97	2 560,00	-20,74%

KAZ Minerals PLC үлестік құралдарының индексі төмендеу үстінде, олар бір айда 20,74 % арзандап, 2 560 теңгені құрады. Негативті динамика мыс баға белгілеуінің құлдырауымен байланысты болды және Қытай тарапынан сауда-саттық соғысы эскалациясы жағдайында металлға сұраным жеткіліктілігіне қатысты инвесторлардың алаңдауына байланысты орын алды. Балама тренд компанияның жақын бәсекелестерінің акцияларының бағасы бойынша байқалады, Voliden AB (-23 %) және Glencore (-16,3 %). Сонымен, KAZ Minerals PLC жай акцияларының бағасы жыл басынан бері қол жеткізген барлық өсімін жоғалтып, қаңтардағы деңгейіне жетті.

"КазТрансОйл" АҚ жай акцияларының баға белгілеулері күрт төмендеуі екінші ай қатарынан жай акциялары бойынша тіркелуде, мамыр айында бағасы 6,32 % төмендеп, 1 175 теңгеге жетті. 2019 жылдың 28 мамырында "КазТрансОйл" АҚ акционерлерінің жылдық жалпы жиналысының шешімімен "КазТрансОйл" АҚ. 2018 жылға жай акциялары бойынша дивиденд төлеу туралы шешім қабылдады және бір акцияға 104 теңгеден бекітілді. Осыған қарағанда, ол инвесторлардың күткенін ақтамады.

Мамыр айында "Қазақтелеком" АҚ жай акциялары 4,04 % өсіп, 26 790 теңгені құрады. 21 мамырда "Қазақтелеком" АҚ миноритарлық акционерлермен корпоративтік дауды реттегені туралы ресми түрде хабарлады. 29 мамырда компания өзінің жай акциялары бойынша жалпы сомасы 4 млрд теңге, немесе бір жай акцияға 781,06 теңге дивиденд төлеуді аяқтағаны туралы есеп берді. Сондай-ақ компания артықшылықты акциялары бойынша бір акцияға 481,06 теңге көлемінде қосымша дивиденд төлеуді жүзеге асырды.

"Қазақстан Халық Жинақ банкі" АҚ жай акцияларының баға белгілеулері оң динамиканы көрсетуді жалғастыруда. Экс-дивидендтік датаның келуіне байланысты сәуір айы акциялары төмендеуімен аяқтап, еліміздің ірі бантері мамыр айында акциялардың баға белгілеуін

жаңартып, қозғалысын жаңартты. Нарыққа қатысушылар банктің болашағын сектордың шоғырлануын жалғастыру аясында оң бағалап отыр.

КОРПОРАТИВТІК ОБЛИГАЦИЯЛАР НАРЫҒЫ

Мамыр айының соңында KASE ресми тізімінде 63 эмитенттің 241 атаудағы облигациялары шығарылымы болды. Есептік айда KASE ресми тізіміне "АстанаГаз КМГ" АҚ бір шығарылым облигациясы қосылды. KASE ресми тізімінен айналым мерзімі өтуіне байланысты "КазАгро" Ұлттық басқарушы холдингі" АҚ халықаралық облигациялары шығарылды. Осы жағдай KASE айналымындағы корпоративтік борыш мәнінің құны өзгеруіне әсер етті.

Мамыр айында айналымдағы корпоративтік борыш көлемі 0,5 % немесе 62,8 млрд теңгеге төмендеп, 11,5 трлн теңгеге дейін жетті.

Корпоративтік облигациялардың қайталама нарығындағы сауда-саттық көлемі сәуір айына қарағанда 10 % өсіп, 43,3 млрд теңгеден 47,6 млрд теңгеге жетті. Сауда-саттықтың орташа күндік көлемі 2,4 млрд теңгені құрап, мәмілелердің орташа күндік көлемі – 9, бір мәміленің орташа көлемі – 256,1 млн теңгені құрады.

Алғашқы нарықта облигациялардың екі шығарылымының үш орналасуы арқасында сауда-саттық көлемі 8,2 % немесе 1,6 млрд теңгеге өсті.

- "Баспана" Ипотекалық ұйымы" АҚ BASPb3 коммерциялық облигацияларын орташа сараланған кірістілігі жылдық 9,3864 % орналастырып, 17,1 млрд теңге тартты;
- "Сбербанк России" АҚ Еншілес Банкі KZ2C00003218 (SBERb10) облигацияларын жылдық өтеу мерзімі 2,5 жыл, жылдық 10,47 % орналастыра отырпы, 4,4 млрд теңге тартты.

Корпоративтік облигациялардың қайталама нарығында ЕДБ үлесі 61,4 %. Өзге институционалдық инвесторлар – 43,8 %, өзге заңды тұлғалар – 6,9 %, жеке тұлғалардың үлесі – 36,2 %. Өзге заңды тұлғалар – 2,3 % құрады.

Қайталама нарығындағы облигациялардың сауда-саттығының көлемі 11,6 % немесе 2,7 млрд теңгеге өсіп, немесе 26,2 млрд теңгеге дейін жетті. Инвесторлардың корпоративтік облигациялардың қайталама нарығындағы қатысу үлесі келесідей бөлінді: ЕДБ үлесі 38,6 %, брокер-дилерлер – 2,1 %, өзге институционалдық инвесторлар – 51,5 %, өзге заңды тұлғалар – 5,5 %, жеке тұлғалардың үлесі – 2,3 %. Бейрезиденттердің үлесі – 3,4 % құрады.

МЕМЛЕКЕТТІК БАҒАЛЫ ҚАҒАЗДАР (МБҚ) НАРЫҒЫ

Биржада саудаланатын мемлекеттік борыштың номиналды құны мамыр айында 1,2 % немесе 146,6 млрд теңгеден 12,4 трлн теңгеге өсті.

Мамыр айында KASE МБҚ сауда-саттықтарының көлемі 1,6 % немесе 2,7 млрд теңгеге өсіп, 176,5 млрд теңгеге жетті. Сауда-саттықтың орташа күндік көлемі 8,8 млрд теңге көлемінде қалыптасты, орташа күндік мәміле саны – 4, бір мәміленің орташа саны – 2,5 млрд теңге.

Бастапқы нарықтағы МБҚ мәміле көлемі 16,6 % немесе 20,6 млрд теңгеге төмендеп, 144,4 млрд теңгені құрады. Есептік кезеңде мемлекеттік бағдарламаны жүзеге асыру аясында алты облыстың және Алматы және Нұр-Сұлтан қалаларының жергілікті атқарушы органдары жылдық 0,35 % 19,3 млрд теңгені тартты (сәуір айында көлемі 10,4 млрд теңгені құрады). Қалған көлемі – 125,1 млрд теңге 10,3 % немесе 11,7 млрд теңгеге сәуір айындағы көрсеткіштен аз, қаржы министрлігі ұзақ мерзімді облигациялардың үш шығарылымын жылдық 8,56–8,84 % орналастыра отырып, тартты.

Бастапқы нарықтағы инвесторлардың негізгі санаттары бойынша институционалдық инвесторлардың үлесі 86,6 %, өзге заңды тұлғаларға үлесі – 13,4 % тиесілі. Резидент еместер сауда-саттыққа қатысқан жоқ.

Қайталама нарықтағы сауда-саттықтың көлемі 35,7 % млрд теңге немесе 17,8 млрд теңгеден 32,1 млрд теңгеге төмендеді. Қайталама нарықтың сауда-саттығының жалпы айналымынан 94,1 % Ұлттық Банктің ноталарының сауда-саттықтарының үлесіне келді.

Қайталама нарықтағы ЕДБ үлесі 40,5 %, брокер-дилерлердің үлесі – 2 %, өзге институционалдық инвесторлардың үлесі – 33,9 %, өзге заңды тұлғалар – 23,2 %, жеке тұлғалардың үлесі – 0,5 %. Резидент еместер сауда-саттыққа қатысқан жоқ.

ХҚҰ облигациялары

Есептік айда KASE сауда-саттық тізімдерінде бес халықаралық қаржы ұйымдары облигацияларының 26 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 "Халықаралық қаржы корпорациясының бағалы қағаздары" секторына үш шығарылымның облигациялары енгізілді: Еуропалық қайта құру және даму банкінің алты жылдық халықаралық облигацияларының бір шығарылымы енгізілді, онда жазылым аясында KASE сауда-саттық жүйесінде жартыжылдық купонға 0,5 % маржамен 60 млрд теңгеге, және Еуразиялық даму банкінің бес жылдық екі облигациялары шығарылымы жылдық 9,5 % 30 млрд теңгеге орналастырылған. Сонымен қатар, есептік кезеңде Еуразиялық даму банкінің тағы бір шығарылымы бес жылдық облигациялары 20 млрд теңгеге жылдық 9,5 % орналастырылды. Бұл қағаздар бұрын KASE ресми тізіміне енгізілген.

Инвесторлар құрамында алғашқы нарықта ЕБД үлесіне 4,1 %, брокер-дилерлердің үлесіне – 0,4 %, өзге институционалдық инвесторларға – 94,7 %, өзге заңды тұлғалардың үлесі 1,5 % құрады, жеке тұлғалардың үлесі – кем дегенде 0,1 %. Бейрезиденттер сауда-саттыққа қатысқан жоқ.

ХҚҰ облигацияларының қайталама нарығында сауда-саттық көлемі 151 млн теңгені құрады. 50 % брокерлік-дилерлік компаниялар жасаған мәмілелерге, және 50 % институционалдық инвесторлар үлесі құрады.

Инвестициялық қорлардың үлес пұлдары

01 маусымындағы жағдай бойынша "Инвестициялық қорлардың бағалы қағаздар" секторында латыкомпанияның басқаруындағы жеті қаржы құралы болды.

Сауда-саттық көлемі 3,9 есе өсіп, 145,4 млн теңгеге жетті. Көлемі бойынша көшбасшылары "Сентрас Секьюритиз" АҚ басқаруындағы CSECfe (111,2 млн теңге) және CSECgm (28,8 млн теңге) үлес пұлдары, үшінші орында State Street Global Advisors басқаруындағы – US_SPY_ (2,7 млн теңге), төртінші орында – FinEx FFIN Kazakhstan Equity ETF қосымша қорының IE_FXBF акциялары (KASE Индексінде ETF; 2,7 млн теңге).

Инвесторлардың негізгі санаттары бойынша жеке тұлғалардың үлесіне – 4 %, брокерлік-дилерлік компаниялардың үлесі – 1,7 %, және өзге заңды тұлғалардың үлесі 94,3 % құрады.

ШЕТЕЛ ВАЛЮТАЛАР НАРЫҒЫ

Мамыр айында шетел валюталарының сауда-саттықтарына 28 KASE мүшелері сауда-саттыққа қатысты.

Шетел валюталары сауда-саттықтарының көлемі 811,8 млрд теңге, ол алдыңғы айға қарағанда 2,1 % немесе 16,9 млрд теңгеге көп. Сауда-саттықтың орташа күндік көлемі 40,6 млрд теңгені құрады, мәмілелердің орташа күндік көлемі – 239, бір мәміленің орташа көлемі – 138,6 млн теңге.

Есептік кезеңде теңгенің айырбастау бағамына әсер ететін негізгі фактор ретінде әлімдік нарықтағы мұнай бағасы әсер етті, Brent эталондық маркалық мұнай бағасы әлемдік нарықта мамыр айының қорытындысы бойынша 11,4 % жетті. Оған әсер еткен тек Қытай мен АҚШ арасында ғана емес, сауда-саттық шиеленістері эскалациясы әсер етуде. Сарапшылардың көбісі дамыған және дамушы экономика дауларына негативті әсер етуінен екендігіне көздері жетіп отыр.

Көбінесе, мамыр айында аталмыш фактордың әсерінен теңге АҚШ долларына қатысты номиналды 0,4 % дейін әлсіреп, бір долларға 382,56 теңгені құрады. Еуроға қатысты әлсіреу аздап байқалды. Юаньға және рубльге қатысты теңге нығайды.

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	жылдың соңындағы бағамы (% өзг.)
USD/KZT	2 114,5 (+1,9 %)	98,9 % (-0,13 %)	5 667 (+591)	378,01 – 382,56	382,56 (+0,4 %)
RUB/KZT	567,6 (-24,6%)	0,4 % (-0,15 %)	71 (-26)	5,8094 – 5,9044	5,8617 (-1,0 %)
CNY/KZT	39,1 (+9,5 %)	0,3 % (+0,01 %)	85 (+22)	54,4852 – 56,0930	55,1900 (-2,4 %)
EUR/KZT	7,4 (x3)	0,4 % (+0,26 %)	36 (+19)	421,60 – 427,55	426,83 (+0,1 %)

АҚША НАРЫҒЫ

Ай бойы TONIA индикаторы Ұлттық банктің базалық мөлшерлемесінің төменгі дәлізінің жұмыс режимінде қозғалды. Алайда айдың аяғына қарай оның мәні 92 б.н өсіп, жылдық 8,92 % құрады, ол нарықтың жеке қатысушылары тарапынан теңгелік өтімділігіне уақытша сұраныммен байланысты болды. TWINA индикаторының мәні (мерзімі жеті жұмыс күндік репо ашылу мәмілелерінің орташа сараланған пайыздық мөлшерлемесі) 11 б.н. өсімді көрсетіп, жылдық 8,11 % құрады.

Мамыр айының соңында бір күндік долларлық своп кірістілігі SWAP-1D(USD) жылдық 7,7 % құрады, бір айда 130 б.н. жетті. Екі күндік своп кірістілігі SWAP-2D(USD) 108 б.н. өсіп, жылдық 7,58 % құрады.

Мамыр айында KazPrime-3M (KZT) өзінің қозғалысын Ұлттық банктің базалық мөлшерлемесінің жоғары шегінде жалғастырып, индикаторы 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 мамыр айының соңында жылдық 8,73 % құрап, 75 б.н. төмендеді.

Репо операциялар нарығы

Осы сегменттегі сауда-саттық көлемі 6 827,4 млрд теңгені құрады, бұл өткен жылдың көрсеткішінен 2,3 % жоғары. Операциялардың орташа күндік көлемі 341,4 млрд теңгені құрады, мәмілелердің орташа күндік саны – 382, бір мәміленің орташа көлемі – 894,2 млн теңге.

Репо ашылу операциялары сауда-саттықтарының жалпы көлемінен 98 % 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 94,1 % құрады.

Барлығы мамыр айында репо нарығындағы мәмілелер жасасуға Биржаның 42 мүшесі қатысты. аталмыш сегментте сауда-саттықтың жалпы айналымынан 88 % астамын банктер құрады. Резидент еместердің есептік айда қатысу үлесі 0,7 % құрады.

Валюталық своп операциялары

Валюталық своп нарығындағы сауда-саттық көлемі 21,8 % азайып, 2 357,6 млрд теңгені құрады. Операциялардың орташа күндік көлемі 117,9 млрд теңгені құрады, мәмілелердің орташа күндік саны – 43, бір мәміленің орташа көлемі – 2,8 млрд теңге болды. Сауда-саттықтың жалпы

көлеміндегі құралдық құрылымы 82,1 % (1,9 трлн теңге немесе 5,1 млрд USD) екі күндік валюталық своп (USDKZT_0_002) мәмілелерінің үлесінде болды.

Мамыр айында "ұзақ" валюталық своппен жеті мәміле жасалды – төрт мәміле апталық своппен сомасы 48 млн АҚШ долларымен (18,23 млрд теңге) жылдық 6,6 және жылдық 7,1 %; бір айға своптары үш мәміле 20 млн АҚШ долларын құрады (7,6 млрд теңге) жылдық 7 %.

ДЕРИВАТИВТЕР НАРЫҒЫ

Осы кезде биржалық нарықтың осы секторында, базалық активтері АҚШ доллары, KASE индексі және акциялардың кейбір атаулары болып табылатын, фьючерстер саудалауға қолжетімді. Бірінші тоқсанда фьючерстермен мәмілелер жасалған жоқ. Мамырдың басына қарай деривативтер нарығында сауда-саттыққа қатысушылардың ашылған жайғасымдары болған жоқ.

Анықтама үшін

"Қазақстан қор биржасы" АҚ Орталық Азия аймағындағы жетекші қор биржасы болып табылады. KASE репо нарығының құралдары, шетел валюталары, мемлекеттік және корпоративтік бағалы қағаздар, халықаралық қаржы институттарының облигациялары, сондай-ақ туынды қаржы құралдар үшін әмбебап сауда-саттық алаңы.

KASE Биржа федерациясының (WFE), Еуро-Азиялық қор биржалар федерациясының (FEAS), БҰҰ-ның "Қор биржасы тұрақты даму үшін" бастамасының және басқа да халықаралық және отандық кәсіби қауымдастықтарының мүшесі. KASE бағалы қағаздармен сауда-саттық көлемі бойынша ТМД елдерінің қор биржаларының арасында екінші орын, ал FEAS қор биржаларының арасында нарықтық капиталдандыру деңгейінде алтыншы орында.

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