

БАСПАСӨЗ МӘЛІМДЕМЕСІ

Алматы қ.

2019 жыл 13 ақпан

KASE 2019 жылдың қаңтар айындағы биржалық нарықтың жұмыс қорытындыларын жариялайды

"Қазақстан қор биржасы" АҚ (KASE, Биржа) 2019 жылдың қаңтарындағы биржалық нарықтың жұмыс нәтижелерін хабарлайды.

- KASE сауда-саттықтарының жиынтық көлемі 2019 жылдың қаңтар айында 10 534,1 млрд теңгені құрап, алдығы аймен салыстырғанда 10,4 % немесе 933,3 млрд теңгеге өсті. Қаржы нарығы оң өсу қарқынын көрсетіп, өсім көлемі 16,7 % құрады.
- Акциялар нарығын қаржыландыру 0,4 % өсіп, 15,6 трлн теңгені құрады.
- KASE Индексінің мәні қаңтар айының қорытындысы бойынша 1,2 % төмендеп, 2 278,33 нүктеге жетті.
- Биржада айналыстаға корпоративтік борыштың көлемі 1,7 % өсіп, 11 трлн теңгені құрады.
- Корпоративтік облигациялар нарығындағы алғашқы орналастыру көлемі 6 млрд теңгені құрады.
- Азия даму банкі жеті жылдық және бес жылдық облигацияларды инфляция деңгейінен жылдық 1,3 % және 1 % маржамен орналастыра отырып, 30,5 млрд теңге тартты.
- 2019 жылдың 01 ақпанындағы жағдай бойынша Орталық депозитарийде жеке тұлғалардың атына ашылған 117 682 жеке шот болды, яғни алдыңғы айдағы санынан 858 шотқа артық.

АКЦИЯЛАР НАРЫҒЫ

Айдың соңына қарай Биржаның сауда-саттық тізімдерінде 113 эмитенттің 129 атаудағы акциялары болды, соның ішінде үш атаудағы листингтік емес бағалы қағаздар. 09 қаңтардан бастап жай акцияларға айырбастауға байланысты Kaspі.kz артықшылықты акциялары KASE ресми тізімінен шығарылды.

KASE акцияларының нарығын қаржыландыру қаңтар айында 0,4 % немесе 64 млрд теңгеден 15,6 трлн теңгеге өсті.

KASE Индексі үш айлық өсімді тоқтатып, жыл басын 1,2 % төмендеумен немесе 26,6 нүктеден 2 278,33 нүктеге дейін төмендеумен бастады. Өкілеттік тізім акцияларының үш атауы қызыл аймақта қалып, баға өзгеруі пайыздық мәнінде екеуі екі мәнді көрсетті.

KASE өкілетті тізіміне кіретін акциялар бағасының өзгеруі

Эмитент	Сауда-саттық коды	Баға өзгеруі		
		01.01.2019	01.02.2019	қаңтарда
KAZ Minerals PLC	GB_KZMS	2 530,00	2 899,50	14,60%
"КазТрансОйл" АҚ	KZTO	1 342,00	1 405,50	+4,73%
"Банк ЦентрКредит" АҚ	CCBN	234,21	241,99	+3,32%
"KEGOC" АҚ	KEGC	1 600,64	1 611,59	+0,68%
"Қазақстан Халық Жинақ Банкі" АҚ	HSBK	100,41	99,91	-0,50%
"Кселл" АҚ	KCEL	1 850,00	1 824,60	-1,37%
"Қазақтелеком" АҚ	KZTK	33 499,00	25 000,00	-25,37%

KAZ Minerals PLC үлестік құралдары өсім лидері болды, олардың бағасы бір акцияға 14,6 % өсіп, 2 899,5 теңгені құрады. Сонымен қатар, негізгі өсім айдың соңғы төрт күніне келді, акциялардың баға белгілеулері 13,6 % қосты. Мұндай өсімге компанияның 2018 жылға өндірістік есебі н жариялануымен қатар, оңтайлы макроэкономикалық жағдай әсер етті. 24 қаңтардағы баспасөз мәлімдемесіне сәйкес 2018 жылдың қорытындысы бойынша KAZ Minerals тобы мыс өндірісін бір жылда 14 % көтеріп, 294,7 мың тоннаға жеткізгені туралы хабарлады. Ол жылдық жоспарды межеден артық орындағаны, яғни 270-300 мың тоннаға жеткізгенін көрсетеді. Мыс өндірісінің өсімі Ақтоғай ТКБ жоғары нәтижесіне байланысты. Сонымен қатар, Лондон биржасында мыстың бағасын белгілеу 25 қаңтардан бастап, 4,4 % ға өсіп, есептік айдың аяғында 6 146 мың АҚШ долларын құрады. 22 қаңтарда KAZ Minerals Баимская мыс жобасын сатып алу бойынша мәміленің алғашқы кезеңі реттеуші келісімін алған соң және келісімге байланысты өзге де жағдайлардан соң, аяқталғаны туралы хабарлады, ол туралы 2018 жылдың 02 тамызында компания хабарлаған болатын.

"Қазақтелеком" АҚ жай акциялары құлдырап, өз бағасының төрттен бірін жоғалтып алды, және қаңтар айының қорытындысы бойынша KASE Индексінің төмендеуіне негізгі себеп болды. Ұлттық телекоммуникациялық компанияның баға белгілеулері 10 жылдық максимумнан алшақтап кетті, 25,4 % төмендеп, 25 000 теңгені құрады, ол 2018 жылдың 06 наурызынан бастап ең төменгі мәні болып табылады. Компания акцияларының баға құлдырауы қаңтар айының ортасында миноритарлық акционерлерімен істі талқылаулардың әсерінен орын алды.

2019 жылдың қаңтар айында акциялармен сауда-саттық көлемі 17 % немесе 1,6 млрд теңгеге өсіп, 11,4 млрд теңгеге дейін жетті. Сауда-саттық тың орташа күндік көлемі 568,4 млн теңгені құрады. Мәмілелердің орташа күндік саны 389 құрады, бір мәміленің орташа көлемі – 1,5 млн теңгені құрады.

"ҚазМұнайГаз" Барлау Өндіру" АҚ 2019 жылдың 31 қаңтарында өзінің артықшылықты акцияларын RDGZp арнайы мамандандырылған сауда-саттықтар аясында кері сатып алуды жалғастырды. Есептік кезеңде компания өзінің 70 757 артықшылықты акциясын бір акцияға 12 800 теңге бағасымен, жалпы сомасы 905,7 млн теңгеге кері сатып алды. Бағдарлама аясында "ҚазМұнайГаз" Барлау Өндіру" АҚ биржада 15,3 млрд теңгеге 1 194 462 акция сатып алды.

Инвесторлардың негізгі санаттары бойынша ең белсенді жеке тұлғалар болды, олардың шоттарына акциялардың жалпы айналымының 42,2 % тиесілі болды. Брокер-дилерлердің үлесі 31,9 %, басқа институционалдық инвесторлардың шоттарына 7,1 % тиесілі, өзге заңды тұлғалардың үлесі 18,8 %. Екінші деңгейдегі банктер (ЕДБ) акциялардың сауда-саттығына қатысқан жоқ. Резидент еместердің қатысуы 25,4 % болды.

КОРПОРАТИВТІК ОБЛИГАЦИЯЛАР НАРЫҒЫ

Биржада айналыстағы корпоративтік борыштың жалпы көлемі 1,7 % өсіп, 11 трлн теңгеге жетті.

2019 жылдың 01 қаңтарында KASE ресми тізімінде 62 эмитенттің 247 атаудағы облигациялары енгізілді. Қаңтарда KASE ресми тізіміне "Нұрбанк" АҚ және "Проблемалық несие қоры" АҚ облигациялары енгізілді, екі шығарылым облигациялары – "Фридом Финанс" АҚ және "Еуразиялық банк" АҚ айналым мерзімі өтуіне байланысты тізімнен шығарылды.

KASE_BMY негізгі алаңының корпоративтік облигациялардың кірістілігі 13 б.н. төмендеп, жылдық 11,01 % құрады.

KASE корпоративтік облигациялар сауда-саттығының жалпы көлемі есептік кезеңде 220,4 млрд теңгені құрап, алдыңғы аймен салыстырғанда 33,5 % есе мөмендеді немесе 111 млрд теңгені құрады, алғашқы нарықта орналастыруды төмендету есебінен 97,9 %, сонымен қайталама нарықта сауда-саттық көлемі 5 есе өсті. Орташа күндік көлем 11 млрд теңгені құрады, мәмілелердің орташа күндік саны – 16, бір мәміленің орташа көлемі – 678,1 млн теңге.

Бір айдың ішінде Биржада жалпы сомасы 6 млрд теңгеге облигациялары орналстырылды:

- "Сбербанк России" Еншілес Банкі АҚ өтеу мерзімі 2,9 жылға дейін облигацияларды жылдық 11 %-бен 812 млн теңге тартты;
- "Компания Фаэтон" ЖШС өтеу мерзімі 6,5 жылға дейін облигацияларды жылдық 10,9991 % -бен 130,2 млн теңге тартты;
- "Баспана" Ипотекалық ұйымы" АҚ өтеу мерзімі бір жылға дейінгі облигацияларды жылдық 9,7499 % -бен 5 млрд теңге тартты.

Корпоративтік облигациялардың алғашқы нарығындағы инвесторлардың негізгі санаттары бойынша ЕДБ үлесі – 45,8 % құрады, брокер-дилерлердің үлесі – 0,5 %, басқа институционалдық инвесторлар – 38,9 %, заңды тұлғалар – 14,8 % болды.

Корпоративтік облигациялардың қайталама нарығындағы сауда-саттық көлемі 214,4 млрд теңгені құрады, ол алдыңғы айдағы нәтижеден асты – 46,0 млрд теңге.

Корпоративтік облигациялардың қайталама нарығындағы инвесторлардың негізгі санаттары бойынша ЕДБ үлесі – 48,3 % құрады, брокер-дилерлердің үлесі – 0,7 %, басқа институционалдық инвесторлар – 4,7 %, заңды тұлғалар – 45,4 %, жеке тұлға 0,8 %, доля физических лиц – 0,8 %. болды. Резидент еместердің қатысуы – 2,9 %.

МЕМЛЕКЕТТІК БАҒАЛЫ ҚАҒАЗДАР (МБҚ) НАРЫҒЫ

Биржада саудаланатын мемлекеттік борыштың номиналды құны 11,6 трл теңгені құрады, бұл жыл басындағы көрсеткіштен 2,5 % немесе 285,9 млрд теңгеге артық.

KASE МБҚ сауда-саттықтарының көлемі 139,6 млрд теңгені құрап, алдыңғы аймен салыстырғанда 14,1 % артып немесе 17,2 млрд теңгені құрады. Орташа күндік сауда-саттық көлемі 7 млрд теңгені құрады. Орташа күндік мәміле саны 3 құрады, бір мәміленің орташа көлемі 2,5 млрд теңге.

Алғашқы нарықтағы сауда-саттық көлемі 26,7 % өсіп, 115,9 млрд теңгеге жетті. Қаржы министрлігі нарықта ұзақ мерзімді облигациялардың төрт шығарылымын нарықта жылдық 8,6–8,82 % орналастырды.

МБҚ қайталама нарығының көлемі 23,1 % немесе 7,1 млрд теңгеге төмендеп, 23,8 млрд теңгені құрады. Қайталама нарықтың сауда-саттық айналымының 95,8 % Ұлттық банктің ноттарына, еурооблигациялар мен Қаржы министрлігінің үлесіне 1,1 % және 3,4 % сәйкесінше келді.

Бастапқы нарықтағы инвесторлардың негізгі санаттары бойынша МБҚ 70,9 % құрады, брутто-айналым ЕДБ, 2,1 % – брокер-дилерлерге, 22,6 % – басқа институционалдық инвесторларға, 3,8 % – өзге заңды тұлғаларға және 0,6 % жеке тұлғалар игерді. Резидент еместердің үлесі - 1,6 %.

ХАЛЫҚАРАЛЫҚ ҚАРЖЫ ҰЙЫМДАРЫ (ХҚҰ) ОБЛИГАЦИЯЛАРЫ

Есептік жылдың соңында төрт халықаралық қаржы ұйымы облигацияларының 16 шығарылымы болды. Қаңтарда аталмыш құралдармен сауда-саттықтың жиынтық көлемі 30,6 млрд теңгеге жетті.

Айдың ішінде Азиялық даму банкі инфляция деңгейінен тиісінше жылдық маржамен 1,3 % және 1 % белгілеп, жеті жылдық және бес жылдық облигацияларын орналастырып, 30,5 млрд теңгені тартты.

Қайталама нарықтың көлемі 22,2 % млн теңге деңгейінде қалыптасты. Барлығы осы сектордағы инвесторлардың негізгі санаттары бойынша ЕДБ үлесі 0,4 % құрады, брокер-дилерлердің үлесі – 0,4 %, басқа институционалдық инвесторлар – 99,2 % болды.

ИНВЕСТИЦИЯЛЫҚ ҚОРЛАР ПАЙЛАРЫ

2019 жылдың 01 ақпанында осы секторда алты компанияның басқаруындағы жеті қаржы құралы болды.

Аяқталған кезеңде сауда-саттық көлемі 19,3 млн теңгені құрады, бұл 2018 жылдың желтоқсан айының нәтижесінен 77,1 % кем. Көлемдер бойынша көшбасшылар State Street Global Advisors

басқаруындағы US_SPY_ үлеспұлдары (13,3 млн KZT; 18 мәміле), екінші орында – "Сентрас Секьюритиз" АҚ басқаруындағы CSECfe үлеспұлдары (5,1 млн KZT; 5 мәміле) , үшінші орында – FinEx FFIN Kazakhstan Equity ETF қосалқы қорының IE_FXBF акциялары (KASE Индесіне ETF; 891,2 мың теңге; 22 мәміле).

Инвесторлардың негізгі санаттары бойынша жеке тұлғалардың үлесі – 43,2 %, брокерлік-дилердік компаниялар 35,3 % және өзге заңды тұлғалардың үлесі – 21,5% құрады.

БАҒАЛЫ ҚАҒАЗДАР НАРЫҒЫНДАҒЫ ЖЕКЕ ТҰЛҒАЛАРДЫҢ ШОТТАРЫ

2019 жылдың 01 ақпанындағы жағдай бойынша Орталық депозитарийдің есепке алу жүйесінде жеке тұлғалардың атынан ашылған 117 682 жеке шот болды, бұл алдыңғы айдың санынан 858 шотқа артық.

ШЕТЕЛ ВАЛЮТАЛАРЫНЫҢ НАРЫҒЫ

Қаңтарда KASE шет елдік валюталар нарығындағы сауда-саттыққа 26 KASE мүшесі қатысты.

Шетел валюталары нарығындағы сауда-саттықтың көлемі 770,6 млрд теңгеге жетті, бұл өткен жылдың көрсеткішінен 26,8 % немесе 282,5 млрд теңгеге төмен. Өткен жылдың қаңтар айымен салыстырғанда сауда-саттық көлемі 38,1 % төмендеп немесе 474,2 млрд теңгеге жетті. Орташа күндік сауда-саттық көлемі 38,5 млрд теңге, орташа күндік мәмілелер саны – 258, бір мәміленің орташа көлемі – 149,4 млн теңгені құрады.

Қаңтарда ұлттық валюта үшін жақсы жаңалықтар орын алды. Brent маркалы мұнай бағасын белгілеу айдың бірінші жартысында біртіндеп өсе бастады. Алғашқы он күні өсім 14,6 % -ға өсіп, бір баррельге 61,68 АҚШ долларын құрады, одан кейін баға қозғалысы тар диапазонда бір баррельге 59–62,7 АҚШ доллары аралығында болды. Сонымен қатар, рубльдің доллармен жұбы бір айда 6 %-ға нығайды. Қаңтар айының аяғында АҚШ ФРС ашық нарығындағы операциялар комитеті федеральдық қорлар бойынша мөлшерлемені бұрынғы деңгейінде жылдық 2,25–2,5 % сақтау туралы жариялады. Сонымен қатар, есептік айдың соңына қарай теңге рубльге қарағанда к 4,8 % әлсіреді, ал доллар бағамы өткен жылдың соңғы сауда-саттық күні қол жеткізген өзінің тарихи шыңынан 1,1 % түзетілді.

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	2 020,9 (-28,1 %)	99,1 % (-0,27 %)	4 991 (-763)	373,66 – 381,38	380,06 (-1,1 %)
RUB/KZT	475,9 (-26,6 %)	0,4 % (+0,01 %)	85 (-21)	5,6029 – 5,8125	5,8125 (+5,0 %)
CNY/KZT	28,3 (+11,0 %)	0,2 % (+0,07 %)	67 (+16)	54,2815 – 56,5400	56,5400 (+2,3 %)
EUR/KZT	6,4 (+51,2 %)	0,4 % (+0,19 %)	15 (+3)	427,15 – 438,10	438,10 (+2,7 %)
USD/KZT	2 020,9 (-28,1 %)	99,1 % (-0,27 %)	4 991 (-763)	373,66 – 381,38	380,06 (-1,1 %)

АҚША НАРЫҒЫ

Ұлттық Банк 14 қаңтардағы отырыс қорытындысы бойынша базалық мөлшерлемені жылдық 9,25 % +/- 1 б.н. симметриялық дәлізбен сақтауға шешім қабылдады. 2018 жылдың желтоқсан айында жылдық инфляция жылдық 5,3 % құрады, ол мақсатты дәліздің 5–7 % төменгі шекарасына сәйкес келеді. Ағымдағы жылдың қаңтар айында өзінің төмендеуін 5,2 % дейін жалғастырды, ал жаңа бағыты 2019 жылдың соңына қарай 4 – 6 % деңгейінде белгіленді.

Қаңтар айының соңында TONIA индикаторы 1 б.н. төмендеп, жылдық 8,25 % құрады. TWINA индикаторы мәні сондай-ақ 1 б.н төмендеп, жылдық 8,26 % көрсетті. Қысқа мерзімді қарыз мөлшерлемелерінің тұрақтылығы МБҚ репо сегментінде байқалады. Сонымен қатар, TONIA индикаторы 20 күннің тоғыз сауда-саттық күнінде жылдық 8,25 % деңгейінде орналасты, сонымен қатар, ол ең жоғарғы көрсеткішке 8,35 % дейін жетті.

Бір күндік долларлық своп кірістілігі SWAP-1D (USD) қаңтар айының аяғында жылдық 5,95 % жетті, бір айда 148 б.н. жетті. Екі күндік свопа SWAP-2D (USD) кірістілігі сондай-ақ 55 б.н. төмендеп, жылдық 6,84 % құрады.

Қаңтар айында KazPrime-3M (KZT) индикаторы Ұлттық Банктің базалық мөлшерлемесін жоғары шекарасында жылдық 10,25 % жалғастырды.

Қаржы нарығының композитті индикаторы MM_Index, валюталық своп операциялары бойынша кірістілігі мәмілесінің орташа сараланған көлемі USD/KZT және бір күнге ашылған МБҚ автоматты репо операциялары бойынша қаңтар айының аяғына қарай 11 б.н. төмендеп, жылдық 8,15 % құрады.

Репо операциялары

Осы сегменттегі сауда-саттық көлемі 6,1 трлн теңгені құрады, бұл өткен жылдың көрсеткішінен 7,7 % төмен немесе 821,5 трлн теңгені құрады. Операциялардың орташа күндік көлемі қаңтар айында 307 млрд теңгені құрады, мәмілелердің орташа күндік көлемі – 373, бір мәміленің орташа көлемі – 823 млн теңге.

Репо ашылу операциялары сауда-саттықтарының жалпы көлемінен 98,1 % 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 88 % құрады.

Барлығы қаңтар айында репо нарығындағы мәмілелер жасасуға Биржаның 43 мүшесі қатысты. Осы сегменттегі сауда-саттықтың жалпы айналымының 84 % астамы банктерге тиесілі. Резидент еместердің есептік айда қатысу үлесі 0,6 % құрады, алайда әдеттегі 0,2 % деңгейден үш есе жоғары.

Валюталық своп операциялары

Валюталық своп нарығындағы сауда-саттық көлемі 38,8 % азайып, 3,2 трлн теңгені құрады. Операциялардың орташа күндік көлемі 161,1 млрд теңгені құрады, мәмілелердің орташа күндік саны – 49, бір мәміленің орташа көлемі – 3,3 млрд теңге. Сауда-саттықтың жалпы көлеміндегі құралдық құрылымы 83,1 % (2,7 трлн теңге немесе 7,1 млрд USD) екі күндік валюталық своп нарығында (USDKZT_0_002) мәмілелерінің үлесінде болды.

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 фьючерстермен мәмілелер жасалған жоқ. Ақпан айының басында

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