



БАСПАСӨЗ ХАБАРЛАМАСЫ

Алматы қаласы

2020 жылдың 21 қаңтары

KASE биржалық нарықтың 2019 жылдың қорытындысы бойынша жұмыс қорытындысын ұсынады

"Қазақстан қор биржасы" АҚ (KASE немесе Биржа) 2019 жылға негізгі қызмет қорытындысы туралы хабарлайды.

- 2019 жылы KASE сауда-саттықтарының жиынтық көлемі 118,14 трлн теңгені құрап, 2018 жылмен салыстырғанда 7,6 % немесе 9,71 млрд теңгеге төмендеді;
- Бағалы қағаздар нарығы көлемі 8,5 % өсіп, 5 286,8 млрд теңге құрады.
- 2019 жылы листинг рәсімінен 30 жаңа эмитенттің бағалы қағаздары өтті: акциялар секторында - 19, корпоративтік облигациялар секторында - 7, ХҚО облигациялар секторында - 2, инвестициялық қорлардың бағалы қағаздар нарығында - 2.
- 2019 жылдың қорытындысы бойынша KASE Индексінің мәні 3% өсіп, 2 363,79 нүктені құрады.
- Акциялар нарығын қаржыландыру бір жылда 11 % өсіп, 17 трлн теңгені құрады.
- KASE айналымдағы корпоративтік борыш көлемі 12 % өсіп, 12 трлн теңгеге жетті.
- 2020 жылдың 01 қаңтарында Орталық депозитарийде ашылған жеке тұлғалардың жеке шоттар саны 117 695 құрады, ол 2019 жылдың басына қарағанда 871 шотқа артық.

НЕГІЗГІ ЖОБАЛАР МЕН ІС-ШАРАЛАР

KASE 2019–2021 жылдарға арналған даму стратегиясын жүзеге асыру аясында 2019 жылы Биржа келесі жобаларды жүзеге асырды және келесі іс-шараларды жүргізді:

- 2019 жылдың 03 желтоқсанынан бастап KASE қор нарығына "Мәскеу биржасы" БАҚ (MOEX) сауда-саттық клирингілік жүйесі негізінде әзірленген, ASTS+ сауда-саттық клирингілік жүйесі енгізілді. Осы күннен бастап KASE қаржы құралдары бойынша ОК қызметін атқаруға кірісті, сауда-саттық жаңа жүйеде ашылды. Екі оқиға да KASE және MOEX арасындағы стратегиялық серіктестік туралы келісім-шартты жүзеге асыру кезеңі болып табылады.
- KASE валюталық нарығында орталық контрагент қызметін дамыту үшін, биржаға аталмыш нарықта есептеу режимінің бұзуылуы жағдайын реттеуге мүмкіндік беретін және нарық қатысушыларына міндеттемелерін уақтылы орындауға кепілдік беруіне мүмкіндік беретін өтімділік провайдрлерін тартты (қытай юаны – "Алматы қаласындағы Қытай Сауда-саттық-өнеркәсіп Банкі" АҚ, ресей рубль және еуро – Еуразиялық даму Банкі, еуро – "Kaspi Bank" АҚ).
- KASE және Мәскеу биржасы (MOEX) 2019 жылдың 29 қаңтарында бұрын тараптар қол қойылған Стратегиялық ынтымақтастық туралы Келісім-шартты жүзеге асыру аясында KASE 32 360 акцияларын сату бойынша мәміле жасады. Мәміле қорытындысы бойынша MOEX үлесі Биржа капиталында орналастырылған акциялардың 3,32 % құрады.

- Нельсон-Сигельдің үлгісіне негізделген, Қазақстан Республикасының индекстелмеген мемлекеттік бағалы қағаздардың (МБҚ) нарықтық бағалауының репрезентативтілігі өсуіне ықпал ететін, тәуекелсіз қисық кірістілікті құрудың жаңа әдістемесі қолданысқа енгізілді.
- 2019 жылдың 30 қыркүйегінен бастап орындалуы алты айлық және бір жылдық АҚШ доллары/қазақстандық тенге валюталық жұбымен валюталық своп операцияларымен сауда-саттық ашылды.
- KASE 2019 жылдың 01 шілдесінен бастап шет елдік валюталар бойынша сауда-саттық күнінің ұзақтығын арттырды және нарықтың аталмыш сегментінде сауда-саттық сессиясын біріктірді.
- 2019 жылдың 26 ақпанынан бастап "ұзақ" валюталық своппен алғашқы мәмілелер жасалды – бір мәміле бір айға своптарымен 5 млн АҚШ доллары (1,9 млрд теңге) және апталық своптармен екі мәміле 7 млн АҚШ доллары (2,9 млрд теңге) жылдық 7,5 % мөлшерлемесі бойынша жасалды.
- KASE 2019 жылдың 16 қарашасында Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі ұйымдастырған, "Қазақстан қаржыгерлер Ассоциациясы" БЗТ бірлесе отырып, "Қазақстан экономикасының қаржы нарығы және нақты секторы" атты конференциясы аясында "Капитал нарығы. Өсім мүмкіндіктері мен нүктелері" атты панельдік пікірталас өткізді.
- KASE биржалық нарығы қызметі туралы, сондай-ақ қазақстанды қор нарығына қаржы тарту мүмкіндіктері туралы ақпараттылығын арттыру аясында Биржа бірқатар шараларды атқарды: "KASE Day" Москва қаласында (Ресей), Минск (Беларусь), Ташкент (Өзбекстан), Шымкент, Ақтөбе, Алматы және Нұр-Сұлтан.
- шет елдік институционалдық инвесторларға Қазақстан қор нарығының әлеуеті туралы және оған қол жеткізу әдістері туралы ақпарат беру мақсатында 2019 жылдың 05 желтоқсанында Лондон қаласында KASE Қазақстан Республикасы Ұлттық Банікмен және Citi бірлесіп, "Kazakhstan: Local Markets Development" атты конференция өткізді.
- KASE "Эмитент күні" жобасы аясында "KEGOC" АҚ, Халықаралық Қаржы Корпорациясы (IFC) және "Қазақстанның тұрғын үй құрылыс жинақ банкі" АҚ инвесторлармен және кәсіби қатысушылармен кездесу өткізді.
- "Биржалық симулятор" атты конкурс өткізіліп, 46 ЖОО-нан 1167 студент қатысты. Жоба 2008 жылдан бастап орындалып келеді. 11 жылда оған Қазақстанжәне алыс, таяу шет елдерден 80 ЖОО 6 мыңнан астам студент қатысты.
- 2019 жылдың 01 қыркүйегі мен 01 қазаны аралығындағы кезеңде KASE акциялар нарығында жеке инвесторлар арасында Конкурс өткізді. Биылғы жылы конкурс аясында 454 қатысушы 137 млн теңге сомаға 2 800 мәміле жасады.
- "KASE Talks" жобасы аясында Болат Жамишев, Қадыржан Дамитов, Тимур Турлов, Галим Хусаинов, Ерғали Бегімбетов, Дмитрий Жеребятьев және Санжар Кеттебековтің қатысуымен ашық дәрістер өткізілді.
- БҰҰ бастамасы аясында "Тұрақты қор биржасы", KASE "БҰҰ-әйелдер" құрылымымен "Ring the Bell for Gender Equality" сауда-саттық ашылу салтанатын және "Әйелдердің құқығын және мүмкіндіктерін кеңейту қағидалары" атты конференция өткізді.
- KASE Халықаралық инвесторлар апталығы аясында "Ring the Bell for Financial Literacy" іс-шарасын өткізді.
- Биржаның тарихы мен қазақстандық қаржы нарығының тарихына арналған "Болашақ қалай құрылды" атты KASE кітабының тұсаукесері өткізілді. Кітап үш тілде – қазақ, орыс және ағылшын тілдерінде жарық көрді. Кітаптың шығарылуы2018 жылдың қараша айында атап өтілген, 25-жылдық мерейтойға арналды.
- 2019 жылы "Қаржы нарығы: статус PRO" 14 бағдарламасы шығарылымы жарық көрді.
- Бір жыл ішінде Биржа "Атамекен" Кәсіпкерлердің Ұлттық палатасы, "Даму" кәсіпкерлікті дамыту қоры, Халықаралық қаржы корпорациясы (IFC), "Қазпочта" АҚ және басқа да ұйымдармен бірлесіп, халықтың қаржылық сауаттылығын арттыру мақсатында, кәсіпкерлер мен бұқара үшін түрлі оқыту шараларын өткізді.

АКЦИЯЛАР НАРЫҒЫ

Жыл басынан бері акциялар нарығының капитализациясы 11,2% өсіп, 17,2 трлн теңгені құрады. Көрсеткіштің өзгеруі бірқатар компания акцияларының аталмыш индикаторын есептеуге қосуынан және кейбір атаулы акциялардың бағалары айтарлықтай өсуі есебінен болды.

2019 жылдың аяғында KASE ресми тізімінде 125 эмитенттің 141 акциялары орналастырылды, олардың ішінде 3 компанияның 3 атаулы акциялары листингтік емес бағалы қағаздар секторында айналысқа жіберілді.

Өткен кезеңде KASE ресми тізіміне 19 жаңа компанияның (бұрын KASE эмитенті болмаған) 20 атаулы акциялары енгізілді және үш компанияның үш атаулы акциялары листингтік емес алаңда айналымға жіберілді.

тоқсан	Эмитент атауы	алаңы	Сауда-саттық тізіміне
I	"North Caspian Petroleum" (Норт Каспиан Петролеум)	балама	04.02.19
	Apple Inc.	негізгі	06.03.19
	Facebook, Inc.	негізгі	06.03.19
	Microsoft Corporation	негізгі	06.03.19
	Starbucks Corporation	негізгі	06.03.19
	Ford Motor Company	негізгі	14.03.19
	Intel Corporation	негізгі	14.03.19
	The Coca-Cola Company	негізгі	14.03.19
	NIKE, Inc.	негізгі	14.03.19
	Pfizer Inc.	негізгі	14.03.19
	Tesla, Inc.	негізгі	14.03.19
	Yandex N.V.	негізгі	26.03.19
	Tiffany & Co.	негізгі	26.03.19
	Exxon Mobil Corporation	негізгі	26.03.19
II	"ГМК "Норильский никель" БАҚ	негізгі	01.04.19
	"Лукойл" БАҚ	негізгі	01.04.19
	"Новолипецк металлургиялық комбинаты" БАҚ	негізгі	01.04.19
III	"Товарная Биржа "Каспий" АҚ – жай акциялары	балама	20.09.19
	"Товарная Биржа "Каспий" АҚ – артқшылықты акциялары	балама	20.09.19
	"Алтын Калкан" Халықтық компаниясы" АҚ	Бейлистингтік БҚ	02.09.19 искл. 04.12.19
	"Астана-Инвест" Инвестициялық Үйі" АҚ	Бейлистингтік БҚ	02.09.19 искл. 04.12.19
IV	"СНINATOWN" АҚ	Бейлистингтік БҚ	26.12.19
	"Бенкала" Тау рудалары" компаниясы АҚ	балама	31.12.19

KASE ресми тізімінен тоғыз атаулы акциялары шығарылды: "Kaspi.kz" АҚ артықшылықты акциялары олардың жай акцияларға айырбасталуына байланысты, "АЛАТАУ-ҚҰС" АҚ және JUPITER ENERGY LIMITED және "Аль Сакр Финанс" АҚ жай акциялары, эмитент бастамасы бойынша "Цесна" Корпорациясы" АҚ және "ҚазМұнайГаз" Барлау Өндіру" АҚ артықшылықты акциялары, "Scipio" жай акциялары KASE алдында жыл сайынғы листингтік алым төлемі бойынша қарызы болуы себебінен шығарылды. Листингтік емес бағалы қағаздар секторынан 90 күнтізбелік күн ішінде мәміле жасаламағандықтан, "GLOTUR DS MULTIMEDIA" АҚ жай акциялары, "Алтын Калкан" Халықтық компаниясы" АҚ және "Астана-Инвест" Инвестициялық Үйі" АҚ шығарылды.

2019 жылы акциялармен сауда-саттық көлемі 62,3 % төмендеп немесе 336,3 млрд теңгеге өсіп, 203,6 млрд теңгені құрады. Мұндай құлдыраудың себебі 2018 жылы тұрақты емес сипаттағы мәмілелердің көлемі үлкен болуына байланысты болды.

2019 жылы алғашқы нарықта бір орналастыру болды. Ferro-Alloy Resources Limited жай акцияларына жазылау аясында бір акцияға бағасы 0,7 фунтов стерлингтен 14 908 акция (балама 348,698 теңге) орналастырып, 10 435,6 фунт стерлинг тартты (балама 5 198 389,8 теңге).

Қайталама нарықтағы акциялардың көлемі 62,3 % төмендеп, 203,6 млрд. теңгені құрады.

Инвесторлардың негізгі санаты арасында қайталама нарықта белсенділері жеке тұлғалар болып табылады, олардың шоттарына акциялармен сауда-саттықтың брутто айналымынан 51,5 % -дан келді. Екінші деңгейдегі банктердің қатысуы (ЕДБ) – 0,7 %, брокер-дилерлер – 24,5 %, өзге институционалдық инвесторлар – 5,3 %, өзге заңды тұлғалардың үлесі 18,1 %. Бейрезиденттердің қатысуы 20,3 % бағаланады.

KASE ИНДЕКСИ

KASE Индексі жыл басынан бері 2,6 % нүктеден 2 363,79 нүктеге дейін өсті. 2019 жылы KASE Индексі өкілеттік тізіміне "Казатомпром" Ұлттық атом компаниясы" АҚ қосылды. Сонымен, есептік жылдың соңында KASE Индексіне 8 атаулы акциялар енгізілді.

KASE өкілетті тізіміне енгізілген акциялар бағаларының өзгеруі

Эмитент	Сауда-саттық коды	Бір акцияға бағасы, KZT		Жыл басынан бері баға өзгеруі, %
		01.01.20	01.01.19	
"Қазақстан Халық Жинақ банкі" АҚ	HSBK	131,00	100,41	+30,47
"Кселл" АҚ	KCEL	2 330,00	1 850,00	+25,95
KAZ Minerals PLC	GB_KZMS	2 630,02	2 530,00	+3,95
"KEGOC" АҚ	KEGC	1 624,00	1 600,64	+1,46
"Казатомпром" ұлттық атом компаниясы" АҚ	KZAP	5 218,00	5 200,00	+0,35
"Банк ЦентрКредит" АҚ	CCBN	226,10	234,21	-3,46
"Қазақтелеком" АҚ	KZTK	27 100,00	33 499,0	-19,10
"КазТрансОйл" АҚ	KZTO	1 035,90	1 342,00	-22,81

2019 жылдың қорытындысы бойынша индекстік акциялар арасында өсім бойынша алдыңғы қатарда "Қазақстан Халық жинақ банкі" АҚ акциялары тұр. Эмитент "Казкоммерцбанк" АҚ сатып алғаннан кейін банктік қызмет нарығында алдыңғы орындарда келеді, тұрақты жоғары рентабельділік пен өтімділіктің жоғары көлемінде капиталдың жоғарғы деңгейіне ие болып отыр. "Қазақстан Халық жинақ банкі" АҚ 2019 жылдың қаңтар-маусым айларында ХҚО бойынша шоғырландырылған таза табысы 164,2 млрд теңгені құрады, ол 2018 жылдың қаңтар-маусым айларында қарағанда 1,9 есе артық. Банктің жағымды операциялық қызметі көрсеткіштеріне қосымша, инвесторлық қауымдастық дивидендтік саясаттың жаңаруына оң көзқарас білдірді. Маусым айының соңында "Қазақстан Халық жинақ банкі" АҚ Директорлар кеңесі банктің дивидендтік саясатына өзгертулер мен толықтыруларды бекітті, оған сәйкес есептік кезеңде шоғырландырылған таза табысының 50 % және 100 % көлемі (бұрын 15 -тен 50 %-ге дейін) дивиденд төлеуге бағытталды. Мамыр айында S&P Global Ratings халықаралық рейтинглік агенттігі банктің ұзақ мерзімді несие рейтингін "BB" деңгейінде және қысқа мерзімді рейтингін "B" деңгейінде растады, болжам "Тұрақты" және банктің рейтингі ұлттық шкаламен "kzA+" деңгейінде расталды. Желтоқсан айында Fitch Ratings халықаралық рейтинглік агенттігі эмитент дефолтының және оның еншілес компаниясы Halyk Finance ұзақ мерзімді рейтингін "BB" деңгейінен "BB+" деңгейіне дейін арттырды.

Ағымдағы жылы "Кселл" АҚ акцияларының бағасына 25,9 % қосылды. Компания акцияларын жоғары жылжитатын негізгі позитивті факторлар арасында компания табысының нарықтағы стратегиялық жағдайын нығайтқаны үшін табыс өсімі әлеуетін атап өтуге болады. Компанияның "Қазақтелеком" АҚ құрылымына енгізілуі қызмет сапасына айтарлықтай көңіл бөлетін, неғұрлым тұрақты бәсекеге қабілетті ортаны қалыптастыруы мүмкін.

KAZ Minerals PLC компаниясы акциялары бір жылда 4 % қымбаттады. Компания акцияларының өсуінің негізгі факторлары тұрақты қаржылық және өндірістік нәтижелері, сондай-ақ шикізат баға белгілеуінің оң динамикасы – компанияның өндіріс көлемі мен сату көлемі болып табылады.

2019 жылдың бірінші жартыжылдығында KAZ Minerals таза ақшалай құнын төменгі деңгейде сақтай отырып, жоғары өндірістік және қаржылық нәтижелерге қол жеткізді, мыс өндірісін 6 % арттырды. Алайда 2019 жылдың қаңтар-маусым айларында KAZ Minerals 18 % артып, 227 млн USD құрады. Аталмыш факт ірі көлемдегі жобаны табысты жүзеге асырғандығын көрсетеді, болашақта нарықтағы компанияның айтарлықтай артықшылығы болуы мүмкін.

"KEGOC" АҚ компаниясы акциялары 2019 жылдың басынан бері 1,5 % өсті. Компания өткен жылдың сәйкес кезеңімен салыстырғанда табысы 48 % дейін өсіп, 191 млрд теңгені құрағаны туралы есеп берді, сонымен қатар, қарастырылған кезеңде таза табысы 7 % төмендеп, 29,7 млрд теңгені құрады. Табыс өсімі көбінесе жаңа қызмет түрінен, сондай-ақ, басқа қызмет түрлері бойынша кірісі бірқалыпты өсіп отырғандықтан, 52 млрд теңгеге негізделеді (жүктемелі көтеруге дайындығын қамтамасыз ету).

Ағымдағы жылы бағаның төмендеуі – "Қазақтелеком" АҚ (-19,1 %) және "КазТрансОйл" АҚ (-22,8 %) акциялары бойынша байқалады.

Ұлттық телекоммуникациялық оператордың "Қазақтелеком" АҚ жай акцияларының баға белгілеуі есептік жылы маңызды корпоративтік жаңалықтардың түсуіне байланысты жоғарғы құбылмалылыққа ұшырады. Инвесторлар компанияның ауқымды күрделі шығындарын, акциялармен сауда-саттық көлемінің өсімін және облигациялар түріндегі қосымша ішкі қаржы тартуды ескере отырып, компанияның жағдайын әртүрлі бағалады. Маусым айында Fitch Ratings агенттігі "Қазақтелеком" АҚ және "Кселл" АҚ дефолтының ұзақ мерзімді рейтингін әрбір компанияға сәйкесінше "BB+" және "BB" деңгейінде растай отырып, "Позитивті" бағасын ұсынды. Агенттікте "Қазақтелеком" АҚ рейтингін компанияның нарықта басымдыққа ие болуымен, еркін тұрақты ақша ағымының болуымен, бір қалыпты левверидж және жағымды реттеу ортасының қалыптасуымен түсіндірді. Акция бағасы 2019 жылдың қараша айынан бастап, мықты аралық есептіліктің жариялануы аясында қалпына келе бастады. 2019 жылдың 30 қыркүйегіне аяқталған тоғыз айында "Қазақтелеком" АҚ түсімі 3а 2018 жылдың сәйкес кезеңімен салыстырғанда 90 % дейін өсіп, 298,6 млрд теңгені құрады. Түсімнің өсімі көбінесе мобильдік телекоммуникациялық байланыс есебінен жүргізілді. ХҚО бойынша таза табысы 26,6 % артты.

"КазТрансОйл" АҚ акциялары ағымдағы жылы бірқатар жағымсыз жағдайлардың орын алуы себебінен "аюлар" тарапынан қысым көруде. Нарықтың жағымсыз реакциясының басты себебі биылғы жылы алғаш рет IPO басталған сәттен акционерлердің күткен көлеміне көбеймеген дивидендік төлем көлемінің сәйкес келмеуіне байланысты болды. Жартыжылдықтың қорытындысы бойынша компания мықты қаржылық нәтижелерін көрсетті. "КазТрансОйл" АҚ шоғырландырылған таза табысы 2019 жылдың қаңтар-маусым айларында 33,8 млрд KZT құрады, ол 2018 жылдың I жартыжылдығындағы көрсеткішінен 22,4 % артық.

КОРПОРАТИВТІК ОБЛИГАЦИЯЛАР

2019 жылдың қорытындысы бойынша KASE саудаланатын корпоративтік борыш 12,4 % немесе 1,3 трлн млрд теңгеге өсіп, 12,1 трлн теңгені құрады.

2020 жылдың 01 қаңтарында KASE ресми тізімінде 71 эмитенттің 256 атаудағы корпоративтік облигациялары шығарылымы болды. 2019 жылы KASE ресми тізіміне 26 эмитенттің 43 шығарылым облигациялары енгізілді, оның ішінде 7 жаңа эмитенттің 9 шығарылымы. Сонымен қатар, мерзімінен юбұрын өтеу немесе облигациялардың айналым мерзімі өтуіне байланысты 20 эмитенттің 34 шығарылым облигациялары тізімнен шығарылды.

Корпоративтік облигациялардың кірістілігі индексі мәні KASE_BMY жыл басынан бері 30 базистік нүктеге төмендеп, жылдық 10,84% құрады.

Корпоративтік облигациялар нарығының жиынтық көлемі KASE 2019 жылы 2,7 трлн теңгені құрады, 2018 жылға қарағанда 17,6 % немесе 406,1 млрд. теңгеге артты. Көлемінің артуы алғашқы және қайталама нарықта байқалды.

Барлығы KASE 27 эмитенттің 42 шығарылым облигациялары орналастырылды. Тартудың жиынтық көлемі 1,9 трлн теңгені құрады және 5,1 % немесе 95,5 млрд. теңгеге артты.

Корпоративтік облигациялардың алғашқы нарығында инвесторлардың негізгі санатында ЕДБ үлесі 18,3 % құрады. брокер-дилерлер – 1,5 %, өзге институционалдық инвесторлар – 75,5 %, өзге заңды тұлғалар – 3,7 %, жеке тұлғалар – 0,9%. Резидент еместер үлесі 8,9 % құрады.

Есептік кезеңде облигациялардың қайталама нарығында сауда-саттық көлемі 68,9 % немесе 310,7 млрд теңгеге өсіп, 761,9 млрд теңгені құрады.

Инвесторлардың корпоративтік облигациялардың қайталама нарығындағы ЕДБ қатысу үлесі 37,3 %, брокер-дилерлер – 2,6 %, өзге институционалдық инвесторлар – 27,2 %, өзге заңды тұлғалар – 32,0 %. Нарықтың аталмыш сегментінде жеке тұлғалардың үлесі 1,0 % құрады. Резидент еместер үлесі – 1,7 % бағаланады.

МЕМЛЕКЕТТІК БАҒАЛЫ ҚАҒАЗДАР

Биржада саудаланатын мемлекеттік борыштың номиналды құны қазан айында 1,7 трлн теңгеге немесе 14,6% артып, 13,0 трлн теңгені құрады.

Қазақстан қор биржасында МБҚ нарығындағы сауда-саттық көлемі 2018 жылға қарағанда 10,9 % немесе 178,9 млрд теңгеге өсіп, 1,8 трлн теңгеге жетті.

2019 жылы МБҚ алғашқы нарықтағы көлемі 69,5 % немесе 539,2 млрд теңгеге азайып, 1,4 трлн теңгені құрады. Оның ішінде 108,9 млрд теңгені 14 облыстың әкімдіктері, Нұр-Сұлтан, Алматы және Шымкент қалаларының әкімдіктері мемлекеттік және үкіметтік бағдарламаны жүзеге асыру аясында тартты.

KASE сауда-саттық алаңында Қаржы министрлігінің қаржы тарту көлемі 1,3 млрд теңгені құрады. Аталмыш сома 2019 жылға жоспарланған тарту көлеміне сәйкес және 2018 жылғы көрсеткішке қарағанда 592,3 млрд теңге (80 %) артық. Қаржы министрлігінің орналастыру аясындағы кірістілігі жылдық 8,46 % – 9,9 % диапазоны аралығында құбылып отырды. Облигацияларды өтеу мерзімі – екі жылдан 20 жылға дейін.

Инвесторлардың негізгі санатында алғашқы нарықта ЕДБ үлесіне 0,6 %, институционалдық инвесторлардың үлесіне – 91,4 %, заңды тұлғалардың үлесі 8 % құрады.

Қайталама нарықтағы сауда-саттық көлемі 52,4 % немесе 414,3 млрд теңгеге төмендеп, 377,1 млрд теңгеге дейін жетті. Ұлттық Банк ноттарымен сауда-саттық үлесі бұрынғыдай жалпы сауда-саттық көлемінен – 89 % жоғары деңгейде қалады, 2018 жылы сауда-саттықтың жалпы айналымы - 85,5 % құрады. Сонымен қатар, эмитенттің айналымдағы нот көлемі біршама азайып, 3,4 трлн теңгені құрады.

2019 жылдың қыркүйек айынан бастап, Биржаның ресми тізіміне шет елдік МБҚ енгізілді – Украина, Түрік Республикасы және Оман Сұлтанатының Қаржы министрлігінің облигациялары енгізілді. Аталмыш облигациялармен мәміле көлемі 686,9 млн теңгеге жетіп, 81 мәміле жасалды.

Қайталама нарықтағы инвесторлардың негізгі санатында ЕДБ үлесі 41,6 %, брокер-дилерлердің үлесі – 3,7 %, өзге институционалдық инвесторлар – 33,3 %, өзге заңды тұлғалар - 21,2 %, жеке тұлғалар – 0,3 %. Резидент еместер қатысуы 0,1 % бағаланады.

ХҚҰ ОБЛИГАЦИЯЛАРЫ

Есептік жылдың соңында KASE сауда-саттық тіздерінде бес халықаралық қаржы ұйымдары облигацияларының 30 шығарылымы болды: Азиялық даму банкі, Еуразиялық даму банкі, Еуропалық қайта құру және даму банкі, Еуропалық инвестициялық банк, Халықаралық қаржылық корпорация (IFC).

Өткен кезеңде сауда-саттықтың көлемі 540,2 млрд теңгені құрап, 2018 жылмен салыстырғанда 5,3 есе (+434,8 %) немесе 439,2 млрд теңгеге артты.

2019 жылдың басынан бастап ресми тізімге бес эмитенттің 19 облигациялар шығарылымы енгізілді: Азиялық даму банкінің үш шығарылымы, Еуразиялық даму банкінің бес шығарылым, Еуропалық қайта құру және даму банкінің сегіз шығарылымы, Халықаралық қаржылық корпорацияның екі шығарылымы және Еуропалық инвестициялық банктің бір шығарылымы.

Есептік кезеңде бастапқы нарықтағы сауда-саттық көлемі 534 млрд теңгені құрады:

- Азиялық даму банкі жеті жылдық және екі бес жылдық облигацияларын орналастырып, тиісінші инфляция деңгейінен үстем жылдық 1,3 %, 1 % және 1,5 % маржасын белгілеп, 45,9 млрд теңге тартты;

- IFC жазылым арқылы, екі жылдық халықаралық облигацияларының екі шығарылымын жылдық 8,95 % және 9,5 % орналастырып, 32,4 млрд. теңге тартты;
- Еуразиялық даму банкі үші жылдық облигацияларын жылдық 9,7 % орналастырып, 20 млрд. теңге тартты; бес жылдық облигацияларды жылдық 9,5 % орналастырып, 50 млрд теңге тартты; орташа сараланған кірістілігі жылдық 9,2032 % үш айлық дисконттық облигацияларды орналастырып, 9,8 млрд теңге артты; Банктің тартуларының жалпы көлемі 79,8 млрд. теңгені құрады;
- Еуропалық қайта құру және даму банкі жазылым арқылы бес, алты, жеті сегіз жылдық халықаралық облигацияларын жылдық 1,0–1,5 % маржамен орналастыру арқылы 376 млрд. теңге тартты.

Инвесторлардың негізгі санаттары бойынша бастапқы нарықта ЕДБ үлесі 3,4 %, брокер-дилерлердің үлесі – 0,1 %, басқа институционалдық инвесторлар – 93,3 %, өзге заңды тұлғалардың үлесі 3,1 %, жеке тұлғалардың үлесі – 0,1 % жетер-жетпес болды.

Қайталама нарықтағы сауда-саттықтың көлемі 6,1 млрд теңгені құрады. Осы сектордағы инвесторлардың негізгі санаттары бойынша ЕДБ шоттарына 2 % тиесілі, брокер-дилерлердің үлесі – 8,5 %, басқа институционалдық инвесторлар – 5,5 %, өзге заңды тұлғалардың үлесі 84 % құрады.

ИНВЕСТИЦИЯЛЫҚ ҚОРЛАРДЫҢ ҮЛЕСПҮЛДАРЫ

Есептік кезеңнің соңында инвестициялық қорлардың бағалы қағаздары секторында 8 компанияның басқаруындағы 11 қаржы құралы болды.

2019 жыл басырында KASE ресми тізіміне үлеспұлдардың 3 шығарылымы және бір ETF енгізілді:

- "Фридом Финанс" АҚ басқаруындағы "GoodWill" ИҮИҚ үлеспұлдары;
- "First Heartland Jysan Invest" АҚ басқаруындағы "Ликвидный" ИҮИҚ және "Процентный" ИҮИҚ үлеспұлдары
- SPDR Series Trust (АҚШ) инвестициялық қоры шығарған, US78468R6633 SPDR Bloomberg Barclays 1-3 Month T-Bill ETF акциялары.

2019 жылдағы инвестициялық қорлардың БҚ сауда-саттықтары көлемдерінің параметрлері

Қаржы құралы	Көлемі, млн KZT	Мәмілелер саны
CSECFE	323,0	56
ASYL_or	154,0	6
US_BIL_	148,8	9
CSECgm	141,2	23
US_SPY_	101,9	103
IE_FXBF	32,6	200
BCCI_cc	8,3	3

Аяқталған кезеңде сауда-саттықтардың көлемі 909,9 млн теңгені құрады, бұл 2018 жылдың нәтижесінен 21 есе немесе 476 млн теңгеге артық.

Инвесторлардың негізгі санаттары бойынша жеке тұлғалардың үлесі 40,7 %, брокер-дилерлердің үлесі – 8,1 %, басқа институционалдық инвесторлар – 3 %, өзге заңды тұлғалардың үлесі 48,3 % болды.

ШЕТЕЛ ВАЛЮТАЛАРЫНЫҢ НАРЫҒЫ

Шетел валюталарының нарығындағы сауда-саттықтардың көлемі 11,1 трлн KZT жетті, бұл өткен жылдың осы көрсеткішінен 17,1 % немесе 2,3 трлн KZT кем.

Төмендегі кестеде Биржада саудаланатын валюталық жұптардың негізгі сипаттамаларын келтірілген (жақшаның ішінде өткен жылдың ұқсас кезеңі қатысты өзгеруі көрсетілген, бағамның өзгеруі шетел валютасының KZT қатысты орташа сараланған биржалық бағамының номиналды өзгеруін сипаттайды).

KASE сауда-саттық алаңындағы валюталық жұптардың сауда-саттық параметрлерінің өзгеруі

Жұп	Көлемі, млн.валюта бірл.	Сауда-с. көлеміндегі үлесі, %	Мемілер саны	Мин. және макс. бағам, баға белгіленетін валютаның саны	Кеңе соңындағы бағам (изм.%)
USD/KZT	28 837,7 (-25,6 %)	99,0 % (-0,2 %)	77 628 (+3%)	373,56 – 390,12	382,60 (-0,4 %)
RUB/KZT	11 487,0 (+7,1 %)	0,6 % (+0,2 %)	1 007 (-35%)	5,5360 – 6,1960	6,1960 (+11,9 %)
CNY/KZT	324,1 (+48,7 %)	0,2 % (+0,1 %)	707 (+30%)	53,9869 – 56,6900	55,9200 (-0,7%)
EUR/KZT	60,6 (+7,1 %)	0,2 % (+0,1 %)	297 (+47%)	421,60 – 438,10	428,20 (+0,4 %)

Өр жеке жыл үшін тән факторларға қарамастан, соңғы жылдарда доллар / KZT жұбының баға белгілеулерінің динамикасында маусымдық белгілер байқалады. Бірінші жарты жылдықта теңге – жаңа жыл мерекесінен кейін, долларға қатысты нығаяды да, жазғы демалыс маусымына қайта оралады. Бірақ ағымдағы жылы бағамның волатильділігі баяу болды. Биржалық нарықта KZT АҚШ долларына сұрамным және өтінім бағамдарының арасындағы спред сәуір айынан бастап 0-0,4 KZT аралығында шоғырланды.

Үстем динамика рубль/теңге жұбының баға белгілеулері бойынша байқалды, бұл 31 желтоқсанда өзінің XX ғасырдағы тарихи максимумын жаңартты (бір рубльге 6,1960 теңге).

2019 жылдың 01 шілдесінен бастап шетел валюталарының сауда-саттықтарын өткізгенде KASE сауда-саттық күнінің ұзақтылығын үлкейтті: валюталық сауда-саттықтардың аяқталу уақыты 15:30-дан 17:00-ге дейін созылды. Осы өзгертулер сауда-саттық күнін ұзарту және шетелдік және халықаралық қатысушылар үшін қазақстандық теңгемен есеп айырысу мүмкіндіктерін кеңейту аясында енгізілген болатын. Осы өзгертулерді енгізгеннен бастап статистика АҚШ долларын сатып алу/сату бойынша операциялардың көлемі 15:30-дан кейін орта есеппен алғанда бар-жоғы бір күндегі көлемнің 1% ғана құрайды.

АҚША НАРЫҒЫ

Ақша нарығындағы сауда-саттықтың жиынтық көлемі 101,7 трлн теңге жетіп, өткен жылдың көрсеткішінен 7,1 %, немесе 7,8 трлн теңгеге төмен болды.

Репо операцияларының нарығы

Репо операцияларының жиынтық көлемі 2019 жылы 72,7 трлн теңгені құрады, бұл өткен 2018 жылмен салыстырғанда 3,1 трлн теңгеге немесе 4,2 % кем. Репо операцияларының елеулі бөлігі – 97 % астамы, МБҚ себетімен авторепо операциялары құрады.

Биржада Орталық контрагент (ОК) қызметтерін іске қосуға байланысты KASE сауда-саттық жүйесінде ОК-пен авторепо операциялары және ОК-пен тікелей репо операциялары пайда болды. Осы операциялар бойынша көлем тиісінше 12,1 млрд. теңгені және 3,3 млрд. теңгені құрады.

TONIA ақша нарығының индикаторы бірінші бес айда салыстырмалы тұрақты болды, орташа мәні 8,19 % құрады, ал одан кейінгі айларда волатильділіктің амплитудасы арта бастады,

маусым айынан бастап желтоқсанға дейін TONIA орташа мәні 8,6 % құрады. Бір жылдағы TONIA индикаторының орташа мәні жылдық 8,43 % құрады.

TWINA ақша индикаторы TONIA волатильділігінің нысанын қайталағанымен, амплитудасы оған қарағанда аздау болды, 2019 жылдың 12 айындағы орташа мәні жылдық 8,55 % құрады.

ВАЛЮТАЛЫҚ СВОП ОПЕРАЦИЯЛАРЫ

Валюталық своп операцияларының жиынтық көлемі 2018 жылы құраған 33,6 трлн теңгеден 2019 жылы 29 трлн теңгеге дейін 13,9 % азайды. Валюталық своп операцияларының басым бөлігі АҚШ доллары-теңге валюталық жұбында жасалды, 2018 жылы өзгермеген 99,99 % үлесі 2019 жылы да өзгерген жоқ.

2019 жылы алғашқы рет евро және теңге жұбында валюталық своп операциялары жүзеге асырылды. 2019 жылы жалпы көлем 128 млн. теңгені құрады. Рубль-теңге валюталық своп операцияларының көлемдері ақайып 2018 жылдағы 219,5 млн. теңгеден 174,5 млн теңге дейін немесе 20,5 % азайды.

2019 жылы АҚШ доллары бойынша валюталық своп операцияларының мөлшерлемелері ең көбі жылдық 11 % жетті USDKZT_1D және жылдық 10,19 % USDKZT_2D.

ДЕРИВАТИВТЕР НАРЫҒЫ

Осы кезде биржалық нарықтың осы секторында саудалауға базалық активі АҚШ доллары және KASE Индексі болып табылатын, фьючерстер қолжетімді. Тамыз айында АҚШ долларының бағамына апталық фьючерспен бір мәміле жасалды, оның көлемі 387,6 млн теңгені құрады. Фьючерстің ақырғы есеп айырысу бағасы бір АҚШ долларына 387,21 теңгені құрады. 2020 жылдың қаңтар айының басында деривативтер нарығының қатысушыларының 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.