

ПРЕСС-РЕЛИЗ

г. Алматы

10 февраля 2021 года

KASE представляет итоги работы биржевого рынка за январь 2021 года

АО "Казахстанская фондовая биржа" (KASE, Биржа) информирует об основных итогах деятельности за январь 2021 года.

- Совокупный объем торгов на KASE в январе 2021 года составил 11,3 трлн тенге и снизился относительно декабря 2020 года на 8 % или 987,5 млрд тенге.
- Значение Индекса KASE выросло на 4,6 % или на 124,34 пункта до 2 799,92 пунктов.
- Капитализация рынка акций увеличилась на 4 % или 760,1 млрд тенге и составила 19,8 трлн тенге.
- Процедуру листинга прошли 2 эмитента негосударственных ценных бумаг.
- По состоянию на 01 февраля 2021 года в торговых списках KASE находились негосударственные ценные бумаги 473 наименований 188 эмитентов.
- По состоянию на 01 февраля 2021 года в Центральной депозитарии числилось 136 685 лицевых счетов, открытых на физические лица, что на 3 824 счета больше, чем месяцем ранее и на 18 990 счетов больше чем на начало 2020 года.

КЛЮЧЕВЫЕ ПРОЕКТЫ И МЕРОПРИЯТИЯ

В январе 2021 года KASE представила для широкого круга пользователей мобильное приложение "KASE Mobile". Приложение дополняет список информационных продуктов Биржи и направлено, прежде всего, на упрощение доступа к биржевой информации для розничных и профессиональных инвесторов, а также предоставляет возможность участвовать с его помощью в учебных торгах.

Приложение позволяет пользователям отслеживать рыночную и справочную информацию по большинству торгуемых на Бирже инструментов – акциям, корпоративным и государственным облигациям, иностранной валюте. Через "KASE Mobile" можно просматривать данные по индикаторам рынка KASE, новости Биржи и ее эмитентов.

Особенностью приложения "KASE Mobile" является структурированный доступ к информации по рынкам "в один клик", возможность создания пользователем избранного набора инструментов для дальнейшего отслеживания их цен на одной странице. Использование "KASE Mobile" бесплатно и не требует авторизации.

РЫНОК АКЦИЙ

По итогам января капитализация рынка акций увеличилась на 4 % или 760,1 млрд тенге и составила 19,8 трлн тенге (46,8 млрд USD).

На конец января в торговых списках KASE находились акции 139 наименований 123 эмитентов, из них три выпуска допущены к обращению в секторе "нелистинговые ценные бумаги". В отчетном месяце новые акции в официальный список не включались.

В январе из торгового списка Биржи были исключены простые акции трех наименований: Tiffany & Co (US_TIF_) – из официального списка KASE по заявлению инициатора допуска указанных акций о добровольном делистинге (в связи с исключением из списка Нью-Йоркской биржи, являющейся основной площадкой, по причине поглощения эмитента указанных акций компанией LVMH MOET HENNESSY); АО "Қазақстан Мақтасы" (KZMK) и АО "Национальная

компания "Продовольственная контрактная корпорация" (PRKR) – из сектора "нелистинговые ценные бумаги" в связи с отсутствием сделок в течение 90 дней.

Объем торгов акциями в январе относительно декабря 2020 года снизился на 18,7 % или 4,7 млрд тенге до 20,5 млрд тенге. Среднедневной объем торгов составил 1,1 млрд тенге, среднедневное количество сделок составило 1 390, средний объем одной сделки – 817,9 тыс. тенге.

В отчетном месяце в секторе первичного рынка акций АО "БАСТ" разместило в торговой системе 54 546 простых акций KZ1C00001015 (BAST) на сумму 600 млн тенге. Всего к размещению было предложено 364 485 простых акций. Спрос к предложению составил 15 %. В общем объеме активных заявок на долю юридических лиц пришлось 81,7 %, на долю физических лиц – 18,3 %.

Объем вторичного рынка в январе составил 19,9 млрд тенге, что на 21,1 % ниже показателя декабря 2020 года.

Среди основных категорий инвесторов на долю физических лиц пришлось 54,2 % от суммарного объема сделок с акциями. Доля брокеров-дилеров составила – 7,7 %. На долю других институциональных инвесторов пришлось 5,3 %, прочих юридических лиц – 32,8 %. Участие нерезидентов оценивается в 4,1 %.

ИНДЕКС KASE

Индекс KASE по итогам января вырос на 4,6 % или 124,34 пункта до 2 799,92 пунктов. Объем сделок с индексными акциями в январе (без учета специализированных торгов по приобретению простых акций АО "КазТрансОйл") составил 3,2 млрд тенге. Наибольший объем торгов пришелся на простые акции АО "Народный сберегательный банк Казахстана" – 1,3 млрд тенге (42,2 % от общего объема торгов с индексными акциями).

Изменение цен акций, входящих в представительский список KASE

Эмитент	Торговой код	Изменение цены		
		на 01.01.2021	на 01.02.2021	в январе
KAZ Minerals PLC	GB_KZMS	3 502,00	4 100,00	+17,1 %
АО "Народный сберегательный банк Казахстана"	HSBK	123,99	134,00	+8,1 %
АО "Казатомпром"	KZAP	7 150,00	7 499,99	+4,9 %
АО "Кселл"	KCEL	2 760,00	2 839,90	+2,9 %
АО "КазТрансОйл"	KZTO	970,00	996,00	+2,7 %
АО "KEGOC"	KEGC	1 697,00	1 690,00	-0,4 %
АО "Казахтелеком"	KZTK	26 700,00	26 015,07	-2,6 %
АО "Банк ЦентрКредит"	CCBN	215,64	210,00	-2,6 %

За отчетный период лидерами роста среди представителей индексной корзины стали простые акции KAZ Minerals PLC, которые выросли в цене на 17,1 % до 4 100 тенге за акцию. Основная часть роста, а именно чуть более 11 %, пришлась на первую торговую неделю января, когда акции меднодобывающей компании отыгрывали положительный фон, вызванный ростом фьючерсов на медь до уровней близких восьмилетним максимумам.

Цены на медь продемонстрировали значительное восстановление во втором полугодии 2020 года благодаря высокому спросу со стороны Китая и ввиду перспектив более быстрого восстановления мировой экономики в 2021 году — на фоне создания вакцин от COVID-19 в разных странах мира. В последнюю торговую неделю января акции компании начали корректироваться вниз на фоне снижения цен фьючерсов на медь.

28 января KAZ Minerals предоставила производственный отчет за двенадцать месяцев и четвертый квартал 2020 года, согласно которому компания сократила производство меди в 2020 году относительно 2019 года на 1,8 %. Реализовано меди на 5,2 % меньше, чем в 2019 году. Как отмечается в сообщении компании, снижение связано с задержкой отгрузки на в конце

2020 года. Производство золота за отчетный период также сократилось – на 2,6 %, реализовано на 9,1 % меньше.

Значительный рост в цене также продемонстрировали простые акции АО "Народный сберегательный банк Казахстана". Цена акций за отчетный месяц выросла на 8,1 % до 134 тенге за акцию. Улучшение финансовых показателей, отмеченных в ноябре 2020 года позитивным рейтинговым апгрейдом агентством Fitch, а также демонстрация готовности выполнять свои обязательства в больших объемах, побудили инвесторов охотнее приобретать финансовые активы крупнейшего банка страны.

РЫНОК КОРПОРАТИВНЫХ ОБЛИГАЦИЙ

Объем корпоративного долга в обращении в январе снизился на 1,6 % или 239,3 млрд тенге до 14,5 трлн тенге.

На конец января в официальном списке KASE находились 279 выпусков корпоративных облигаций 72 эмитентов. В официальный список KASE были включены четыре выпуска облигаций АО "Казахстанский фонд устойчивости". Из официального списка KASE были исключены шесть выпусков корпоративных облигаций: выпуск АО "Народный сберегательный банк Казахстана", выпуск АО "Кселл" и четыре выпуска АО "Фонд национального благосостояния "Самрук-Қазына" – в связи с истечением срока обращения.

Значение индекса доходности корпоративных облигаций KASE_BMY выросло на 8 базисных пунктов до 10,84 % годовых.

Объем торгов корпоративными облигациями на KASE снизился относительно декабря на 65,8 % или 451 млрд тенге до 234,8 млрд тенге. Среднедневной объем торгов составил 13 млрд тенге (на вторичном рынке – 9,1 млрд тенге), среднедневное количество сделок – 20 сделок (на вторичном рынке – 18 сделок), средний объем одной сделки – 669 млн тенге (на вторичном рынке – 510,5 млн тенге).

В январе на первичном рынке в секторе корпоративных облигаций были размещены пять выпусков облигаций двух эмитентов на общую сумму 70,4 млрд тенге, что на 88,7 % или 553,7 млрд тенге ниже показателя декабря:

- АО "Казахстанский фонд устойчивости" привлекло 61,8 млрд тенге, разместив четыре выпуска облигаций (KFUSb4, KFUSb5, KFUSb8, KFUSb9) с доходностью 10,27–10,77 % годовых;
- АО "KEGOC" привлекло 8,6 млрд тенге, разместив облигации KZ2C00006658 (KEGCb3) со среднезвешенной доходностью к погашению 11,6161 % годовых.

В разрезе основных категорий инвесторов на первичном рынке корпоративных облигаций доля БВУ составила 48,1 %, брокеров-дилеров – 4,8 %, других институциональных инвесторов – 9,6 %, прочих юридических лиц – 37,5 %.

Объем торгов на вторичном рынке облигаций вырос в 2,7 раз или 102,7 млрд тенге до 164,4 млрд тенге.

В разрезе основных категорий инвесторов на вторичном рынке корпоративных облигаций доля БВУ составила менее 0,1 %, брокеров-дилеров – 1,8 %, других институциональных инвесторов – 10,9 %, прочих юридических лиц – 86,9 %, доля физических лиц – 0,4 %. Доля нерезидентов составила 8,3 %.

РЫНОК ГОСУДАРСТВЕННЫХ ЦЕННЫХ БУМАГ (ГЦБ)

Номинальная стоимость торгуемого на KASE государственного долга по итогам января выросла на 3,7 % или 622,4 млрд тенге до 17,4 трлн тенге.

В январе объем торгов на рынке ГЦБ вырос в 2,3 раза или на 192,2 млрд тенге до 342,3 млрд тенге. Среднедневной объем торгов составил 19 млрд тенге (на вторичном рынке – 3,8 млрд тенге), среднедневное количество сделок – 11 (на вторичном рынке – 5 сделок), средний объем одной сделки – 1,8 млрд тенге (на вторичном рынке – 840,4 млн тенге).

На первичном рынке ГЦБ объем торгов составил 274,3 млрд тенге, что выше показателя декабря 2020 года в 3,3 раза или 191,4 млрд тенге. Весь объем пришелся на размещение казначейских обязательств Министерства финансов Республики Казахстан. Всего было размещено шесть выпусков облигаций под 9,29–10,40 % годовых (средневзвешенная доходность – 9,54–10,40 % годовых). Нерезиденты на первичном рынке не участвовали.

В структуре инвесторов на первичном рынке ГЦБ на долю БВУ пришлось 78,3 %, на долю брокеров-дилеров – 0,4 %, на долю других институциональных инвесторов – 9,5 %, доля прочих юридических лиц составила 11,9 %. Участие нерезидентов оценивается в 3,3 %.

Объем торгов на вторичном рынке вырос на 1,2 % или на 0,8 млрд тенге до 68,1 млрд тенге. 78,6 % или 53,5 млрд тенге об общего оборота торгов вторичного рынка пришлось на сделки с МЕКАМ, 20,3 % или 13,9 млрд тенге – на ноты Национального Банка. Остальной объем, составляющий 1,1 % (742,4 млн тенге), пришелся на сделки с еврооблигациями Республики Казахстан и с ГЦБ иностранных государств.

В структуре инвесторов на вторичном рынке на долю БВУ пришлось 35,7 %, на долю брокеров-дилеров – 1,4 %, на долю других институциональных инвесторов – 16,2 %, доля прочих юридических лиц составила 46,6 %, доля физических лиц не превышает 1 %. Участие нерезидентов оценивается в 14,4 %.

ОБЛИГАЦИИ МФО

На конец отчетного месяца в торговых списках KASE находилось 34 выпуска облигаций четырех международных финансовых организаций: Евразийского банка развития, Европейского банка реконструкции и развития, Международной финансовой корпорации (IFC) и Азиатского банка развития.

В отчетном месяце сделок в данном секторе заключено не было.

ПАИ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ФОНДОВ

На 01 февраля в секторе "Ценные бумаги инвестиционных фондов" находились 17 инструментов под управлением десяти компаний.

С 20 января паи KZPF00000231 (BCCIrб) ИПИФ "ЦентрКредит – Разумный баланс" под управлением АО "BCC Invest" включены в сектор "Ценные бумаги инвестиционных фондов" официального списка KASE.

В отчетном месяце объем торгов составил 5,4 млрд тенге и вырос относительно декабря на 25,7 %.

Инструмент	Объем, млн KZT	Кол-во сделок
RU_UKFFipo	3 729,6	1 210
FHJlag	764,7	7
FFIN_or	260,5	120
FHJlpc	247,9	3
CSECfe	168,1	18
IE_FXBF	113,9	128
CSECgm	89,5	18
US_BIL_	21,8	8
US_SPY_	15,6	70
US_GLD_	8,9	2
FHJlds	0,1	7
FHJlhm	0,1	7
	5 420,8	1 598

В разрезе основных категорий инвесторов 47,3 % приходится на физические лица, 34,9 % – на брокеров-дилеров, 0,6 % – на других институциональных инвесторов и 17,1 % – на прочих юридических лиц.

СЧЕТА ФИЗИЧЕСКИХ ЛИЦ НА РЫНКЕ ЦЕННЫХ БУМАГ

По состоянию на 01 февраля 2021 года в Центральной депозитарии числилось 136 685 лицевых счетов, открытых на физические лица, что на 3 824 счета больше, чем месяцем ранее и на 18 990 счетов больше чем на начало 2020 года.

РЫНОК ИНОСТРАННЫХ ВАЛЮТ

В январе 2021 года в торгах на рынке иностранных валют на KASE принимали участие 28 членов KASE. В отчетном месяце на рынке принимали участие три брокера, доля его участия в брутто обороте составила 0,2 %.

Объем торгов на рынке иностранных валют составил 954,1 млрд тенге, что ниже показателя предыдущего месяца на 15 % или на 168,8 млрд тенге. Среднедневной объем торгов в январе 2021 составил 53 млрд тенге, среднее количество сделок – 403, средний объем одной сделки – 131,5 млн тенге.

В нижеследующей таблице приводятся основные характеристики торгуемых на KASE валютных пар (в скобках указано изменение показателя к предыдущему месяцу, изменение курса отражает номинальное изменение средневзвешенного биржевого курса иностранной валюты к тенге).

Пара	Объем, млн единиц валюты	Доля в объеме торгов, %	Число сделок	Мин. и макс. курсы, кол-во котируемой валюты за ед. базовой	Курс на конец месяца (изм.%)
USD/KZT	2 225,50 (-15,00 %)	98,04 % (-0,0004 %)	6 996 (-478)	417,96 – 425,00	424,21 (+0,78 %)
RUB/KZT	1 501,48 (-16,26 %)	0,88 % (-0,02 %)	162 (-33)	5,5470 – 5,7250	5,5996 (-1,52 %)
CNY/KZT	103,40 (-35,11 %)	0,70 % (-0,21 %)	78 (-5)	64,6100 – 65,5750	65,5672 (+1,33 %)
EUR/KZT	6,91 (x2,28)	0,37 % (+0,23 %)	21 (+7)	508,00 – 517,50	515,00 (+0,49 %)

Как следует из вышеприведенных данных тенге завершил январь ослаблением к основным валютам, но укрепился к рублю. В качестве поддержки выступали рост цен на нефтяные продукты, вызванное данными о сокращении уровня добычи нефти Саудовской Аравией с февраля по март на 1 миллион баррелей в сутки, а также развитие вакцинации. Однако давление на рынок оказывало общее негативное настроение инвесторов касательно восстановления мировой экономики.

ДЕНЕЖНЫЙ РЫНОК

Совокупный объем торгов на рынке денег составил 9 752,2 млрд тенге, снизившись относительно показателя прошлого месяца на 4,8 %, или на 496,7 млрд тенге.

Композитный индикатор денежного рынка MM_Index, представляющий собой средневзвешенное значение через объем сделок значение доходности по операциям валютного свопа USD/KZT и операциями автоматического репо с ГЦБ, открытыми на один рабочий день, уменьшился на 1 б.п. с 8,25 % до 8,24 % годовых, средневзвешенная ставка в январе составила 8,18 %.

Рынок операций РЕПО

Объем торгов в данном сегменте в январе 2021 года составил 8 520,4 млрд тенге, что меньше объема прошлого месяца на 802,5 млрд тенге или на 8,6 %. Среднедневной объем операций

составил 473,4 млрд тенге, среднее количество ежедневных заключенных сделок – 411, средний объем одной сделки – 1,2 млрд тенге.

Объем операций авторепо с ГЦБ составил 5 575,3 млрд тенге или 65,4 % от общего объема операций репо, авторепо с НЦБ – 2 940,3 млрд тенге или 34,5 %, прямое репо НЦБ – 4,9 млрд тенге или 0,1 %.

К концу января основным индикатором денежного рынка - TONIA (средневзвешенная процентная ставка по сделкам открытия репо сроком на один рабочий день, заключенным на Бирже в секторе автоматического репо с ценными бумагами Корзины ГЦБ) не изменился и составил 8,25 % годовых.

Индикатор TRION (средневзвешенная процентная ставка по сделкам открытия репо сроком на один рабочий день, заключенным на Бирже в течение дня в секторе автоматического репо с ценными бумагами Корзины ГЦБ, по которым Биржа осуществляет клиринговую деятельность использованием услуг Центрального контрагента) увеличился на 1 б.п. с 8,25 % до 8,26 % годовых.

Индикатор TWINA (средневзвешенная процентная ставка по сделкам открытия репо сроком на семь рабочих дней, заключенным на Бирже в секторе автоматического репо с ценными бумагами Корзины ГЦБ, по которым Биржа осуществляет клиринговую деятельность использованием услуг Центрального контрагента) продемонстрировал снижение на 25 б.п. с 8,60 % до 8,35 % годовых в январе.

Индикаторы операций репо TONIA, TRION и TWINA после Нового года снижались параллельно, в дальнейшем увеличивались с началом налоговой недели с сохранением узкого горизонтального спреда на протяжении всего месяца.

Рынок операций валютного свопа

Объем торгов в январе на рынке операций валютного свопа составил 1 231,8 млрд тенге, что больше на 305,8 млрд тенге или на 33 % объемов в декабре (926 млрд тенге). Количество сделок составило 245, что больше на 44 сделки или на 21,9 % по сравнению с предыдущим месяцем.

Среднедневной объем операций в январе составил 68,4 млрд тенге, среднее количество сделок – 14, средний объем одной сделки – 5 млрд тенге.

В инструментальной структуре 71 % от общего объема на рынке валютного свопа пришлось на сделки с однодневным валютным свопом (USDKZT_0_001), 24,6 % от общего объема торгов на рынке валютного свопа пришлось на сделки с двухдневным валютным свопом (USDKZT_0_002), 1,0 % от общего объема торгов на сделки недельного валютного свопа (USDKZT_01W), 3,4 % от общего объема торгов с месячным валютным свопом (USDKZT_01M).

Индикатор однодневного долларowego свопа SWAP-1D (USD) на конец января уменьшился на 35 б.п. с 8,28 % до 7,93 % годовых. Значение двухдневного свопа SWAP-2D (USD) уменьшилось на 4 б.п. с 7,99 % до 7,95 % годовых.

Рынок деривативов

В секторе биржевого рынка доступны фьючерсы, базовыми активами которых являются доллар США, индекс KASE и отдельные наименования акций. К началу февраля открытые позиции участников торгов на рынке деривативов отсутствовали, операции в январе не производились.

Для справки

АО "Казахстанская фондовая биржа" (KASE) является ведущей фондовой биржей в Центрально-Азиатском регионе. KASE занимает второе место среди бирж СНГ по объему торгов ценными бумагами, и шестое место по уровню капитализации рынка акций бирж FEAS.

Это универсальная торговая площадка для корпоративных и государственных ценных бумаг, облигаций международных финансовых институтов, иностранных валют, операций рынка денег

– репо и своп, а также производных инструментов. KASE является членом Международной федерации бирж (WFE), Федерации Евро-Азиатских фондовых бирж (FEAS) и других международных и отечественных профессиональных объединений, а также участником инициативы ООН "Фондовые биржи за устойчивое развитие".

Дополнительная информация: +7 (727) 237 5342, pr@kase.kz.