



ПРЕСС-РЕЛИЗ

г. Алматы

13 марта 2019 года

KASE представляет итоги работы биржевого рынка в феврале 2019 года

АО "Казахстанская фондовая биржа" (KASE, Биржа) представляет итоги работы биржевого рынка в феврале 2019 года.

- Совокупный объем торгов на KASE в феврале 2019 года составил 11 454,2 млрд тенге и вырос относительно предыдущего месяца на 8,7 % или на 920,1 млрд тенге. Положительную динамику продемонстрировали рынок ценных бумаг (в 3 раза) и иностранных валют (+30,8 %).
- На рынке ценных бумаг рост отмечался почти во всех секторах: в секторе корпоративных облигаций – в 4,3 раза, ГЦБ – на 13,8 %, облигаций МФО – в 2 раза, ЦБ инвестиционных фондов – на 59,8 % и производных ценных бумаг – в 4 раза.
- Объем первичных размещений на рынке корпоративных облигаций достиг 641,9 млрд тенге.
- По итогам февраля значение Индекса KASE выросло на 3,8 % до 2 365,55 пунктов.
- На 01 марта 2019 года на площадке KASE торговались акции 126 наименований 111 эмитентов и 245 выпусков корпоративных облигаций 63 эмитентов. В официальный список Биржи были включены простые акции АО "North Caspian Petroleum" и облигации АО "Оптово-розничное предприятие торговли".
- Капитализация рынка акций выросла на 1,5 % и составила 15,8 трлн тенге.
- Объем корпоративного долга в обращении вырос на 4,3 %, достигнув отметки 11,4 трлн тенге.
- В феврале были заключены первые сделки с "длинными" валютными свопами на сумму 4,6 млрд тенге, доходность по сделкам составила 7,5 % годовых.
- На 01 марта 2019 года в Центральной депозитарии числилось 118 184 лицевых счета, открытых физическим лицам, что 1 360 счетов больше чем на начало года.

РЫНОК АКЦИЙ

На конец месяца в торговых списках KASE находились 126 наименований акций 111 эмитентов, из них два выпуска допущены к обращению в секторе нелистинговые ценные бумаги. В феврале из торговых списков Биржи исключены четыре наименования акций: простые и привилегированные акции АО "Kaspi Bank", простые акции АО "Scipio" и простые акции АО "GLOTUR DS MULTIMEDIA" (сектор нелистинговые ценные бумаги), включены простые акции АО "North Caspian Petroleum".

Капитализация рынка акций выросла на 1,5% или на 234,3 млрд тенге до 15,8 трлн тенге.

Объем торгов акциями в феврале относительно января 2019 года снизился на 13,6 % или 1,5 млрд тенге до 9,8 млрд тенге. Среднедневной объем торгов составил 491 млн тенге, среднедневное количество сделок – 482, средний объем одной сделки – 1 млн тенге.

Размещений в отчетном месяце не было. В рамках подписки в торговой системе KASE было продано 493 335 простых акций US_FRHC Freedom Holding Corp. по 3 047,31 тенге за акцию на сумму 1,5 млрд тенге. В рамках специализированных торгов по приобретению простых акций АО "Рахат", которые проводились на KASE с 21 января по 26 февраля, было приобретено 112,4 тыс. акций на сумму 2,3 млрд тенге.

Кроме того, 22 февраля 2019 года были проведены дополнительные специализированные торги для финальных расчетов с акционерами в целях полного исполнения клиентских заявок, принятых брокером в период программы выкупа акций АО "Разведка Добыча "КазМунайГаз". Объем выкупа указанных акций в феврале составил 571,2 млн тенге. Всего в рамках программы обратного выкупа на KASE были выкуплено 1 239 087 привилегированных акций на общую сумму 15 860 313 600 тенге.

Среди основных категорий инвесторов наиболее активными были физические лица, на счета которых пришлось 53,5 % от суммарного объема сделок с акциями. Доля брокеров-дилеров составила 15,8 %, доля других институциональных инвесторов – 0,7 %, прочих юридических лиц – 30,1 %. Банки второго уровня (БВУ) в торгах акциями участия не принимали. Доля нерезидентов оценивается в 30,5 %.

ИНДЕКС KASE

В феврале Индекс KASE вырос на 3,8 %, или на 87,2 пункта до 2 365,55 пунктов. Данный показатель роста за месяц является максимальным с января прошлого года.

Изменение цен акций, входящих в представительский список KASE

Эмитент	Торговый код	Изменение цены		
		на 01.02.2019	на 01.03.2019	в январе
АО "Казхаттелеком"	KZTK	25 000,00	28 398,99	+13,60%
KAZ Minerals PLC	GB_KZMS	2 899,50	3 187,00	+9,92%
АО "Народный сберегательный банк Казахстана"	HSBK	99,91	104,50	+4,59%
АО "Кселл"	KCEL	1 824,60	1 854,00	+1,61%
АО "КазТрансОйл"	KZTO	1 405,50	1 400,00	-0,39%
АО "Банк ЦентрКредит"	CCBN	241,99	237,00	-2,06%
АО "KEGOC"	KEGC	1 611,59	1 572,45	-2,43%

Драйвером роста Индекса KASE в отчетном месяце стали простые акции АО "Казхаттелеком", которые выросли в цене на 13,6 % до 28 398,99 тенге за акцию. Характер такого роста расценивается как восстановительный. Напомним, что месяцем ранее компания потеряла более четверти своей рыночной капитализации на фоне судебных исков миноритарных акционеров. После достижения своего 11-ти месячного минимума в конце января котировки акций компании реабилитировались, отыграв в феврале почти половину январского падения.

Впечатляющие показатели роста второй месяц подряд демонстрируют долевые инструменты KAZ Minerals PLC. В феврале рост котировок акций производственной компании составил почти 10 % до 3 187 тенге за акцию, достигнув максимальных значений с начала августа 2018 года. Как и прежде, положительная динамика была обеспечена ростом цен на медь, которая за февраль подорожала почти на 7 %. 21 февраля компания представила финансовые результаты деятельности за 2018 года. Согласно пресс-релизу компании, валовой доход от реализации за 2018 год составил 2,162 млрд долларов США (+12 %), операционный доход – 851 млн долларов США (+19 %), свободный денежный поток – 585 млн долларов США (+29 %).

Тройку лидеров замыкают долевые инструменты АО "Народный сберегательный банк Казахстана", подорожавшие на 4,59 % до 104,50 тенге за одну простую акцию. Котировки акций банка перешли в фазу "бычьего" рынка в начале февраля после преодоления уровня десятидневной скользящей средней снизу вверх. Спрос инвесторов на акции банка вырос в преддверии публикации финансовой отчетности и сезона дивидендных выплат.

Явных лидеров падения в отчетном месяце не было. Больше всех в цене потеряли простые акции АО "KEGOC", которые снизились в цене на 2,43 % до 1 572,45 тенге. Котировки акций

компании продолжили плавное движение в нисходящем тренде, сформированном в конце прошлого месяца.

РЫНОК КОРПОРАТИВНЫХ ОБЛИГАЦИЙ

На конец февраля в официальном списке KASE находились 245 выпусков облигаций 63 эмитентов. В отчетном месяце в официальный список KASE включен один выпуск облигаций АО "Оптово-розничное предприятие торговли". Из официального списка KASE исключены два выпуска облигаций в связи с истечением срока обращения: АО "Цеснабанк" и Дочернего банка АО "Хоум Кредит энд Финанс Банк" и один выпуск международных облигаций АО "НУХ "КазАгро" в связи с их досрочным погашением.

Объем корпоративного долга в обращении вырос на 4,3 % или 475,7 млрд тенге, достигнув отметки 11,4 трлн тенге.

Значение индекса доходности корпоративных облигаций KASE_BMY незначительно снизилось в феврале на 1 базисный пункт до 11 % годовых.

Объем торгов корпоративными облигациями на KASE вырос относительно января в 4,3 раза или 727,7 млрд тенге до 948,1 млрд тенге. Среднедневной объем торгов составил 47,4 млрд тенге, среднедневное количество сделок – 12, средний объем одной сделки – 4,1 млрд тенге.

Объем торгов на первичном рынке вырос до 641,9 млрд тенге с 6 млрд тенге в январе за счет ряда крупных размещений. Всего в феврале на KASE состоялось шесть размещений корпоративных облигаций:

- АО "Фонд проблемных кредитов" привлекло 604 млрд тенге, разместив 15-летние облигации FPKRb2 под 9 % годовых;
- АО "Ипотечная организация "Баспана" привлекло 5 млрд тенге, разместив краткосрочные облигации (301 день) BASPb2 под 9,7499 % годовых;
- АО "КазАгроФинанс" привлекло 4,2 млрд тенге, разместив облигации под 12 % годовых со сроком до погашения 4,8 лет;
- ТОО "Компания Фаэтон" привлекло 1,7 млрд тенге, разместив семилетние облигации под 10,5 % годовых;
- АО "Нурбанк" привлекло 10 млрд тенге, разместив семилетние облигации под 10,95 % годовых;
- АО "Кселл" привлекло 17 млрд тенге, разместив облигации под 11,5 % годовых со сроком до погашения 1,9 лет.

В разрезе основных категорий инвесторов на первичном рынке корпоративных облигаций доля БВУ составила 1,3 %, брокеров-дилеров менее 0,1 %, на долю других институциональных инвесторов пришлось 97,2 %, прочих юридических лиц – 1,4 %, участие физических лиц оценивается в менее 0,1%. Доля нерезидентов составила 0,2 %.

Объем торгов на вторичном рынке облигаций вырос на 42,8 % или 91,8 млрд тенге до 306,3 млрд тенге.

В разрезе основных категорий инвесторов на вторичном рынке корпоративных облигаций доля БВУ составила 49 %, брокеров-дилеров – 0,8 %, других институциональных инвесторов – 50 %, прочих юридических лиц – 0,1 %, доля физических лиц – 0,1 %. Доля нерезидентов – 0,2 %.

РЫНОК ГОСУДАРСТВЕННЫХ ЦЕННЫХ БУМАГ (ГЦБ)

Номинальная стоимость торгуемого на KASE государственного долга в феврале снизилась на 1 % или 113,9 млрд тенге до 11,5 трлн тенге.

В феврале объем торгов на рынке ГЦБ вырос на 13,8 % или 19,2 млрд тенге до 158,9 млрд тенге. Среднедневной объем торгов сложился на уровне 7,9 млрд тенге, среднедневное количество сделок – 4, средний объем одной сделки – 1,9 млрд тенге.

На первичном рынке ГЦБ объем сделок вырос на 6,9 % или на 8 млрд тенге до 123,9 млрд тенге. В отчетном месяце в рамках реализации государственных программ местные исполнительные органы г. Астаны и четырех областей Жамбылской, Западно-Казахстанской, Костанайской, Павлодарской привлекли 22,7 млрд тенге под 0,35 % годовых. Остальной объем

– 101,2 млрд тенге – привлекло Министерство финансов, разместив четыре выпуска долгосрочных облигаций под 8,66–8,74 % годовых. Относительно января объем привлечения Министерством финансов снизился на 12,6 % или 14,6 млрд тенге.

В структуре инвесторов на первичном рынке ГЦБ на долю институциональных инвесторов пришлось 81,7 %, на долю юридических лиц – 18,3 %. Нерезиденты в торгах не участвовали.

Объем торгов на вторичном рынке вырос на 47,2 % или на 11,2 млрд тенге до 35 млрд тенге. 99,3 % об общего оборота торгов вторичного рынка пришлось на ноты Национального Банка.

В структуре инвесторов на вторичном рынке на долю БВУ пришлось 41 %, на долю брокеров-дилеров – 4,7 %, на долю других институциональных инвесторов – 17,2 %, доля прочих юридических лиц составила 36,8 %, доля физических лиц – 0,4 %. Нерезиденты в торгах не участвовали.

ОБЛИГАЦИИ МФО

На конец отчетного периода в торговых списках KASE находилось 19 выпусков облигаций четырех международных финансовых организаций. В феврале список KASE пополнился еще тремя выпусками облигаций: Евразийского банка развития, Европейского банка реконструкции и развития и Международной финансовой корпорации.

Объем торгов в секторе МФО вырос в 2 раза или на 32,3 млрд тенге до 62,9 млрд тенге. Весь объем пришелся на первичный рынок:

- IFC привлекла через подписку 22,9 млрд тенге, разместив двухлетние международные облигации под 8,95 % годовых;
- Евразийский банк развития привлек 20 млрд тенге, разместив трехлетние облигации под 9,7 % годовых;
- Европейский банк реконструкции и развития привлек через подписку 20 млрд тенге, разместив семилетние международные облигации с маржой 1 % годовых.

В структуре инвесторов на долю БВУ пришлось 6,6 %, на долю брокеров-дилеров – 0,05 %, на долю других институциональных инвесторов – 52,6 %, доля прочих юридических лиц составила 40,7 %.

Паи инвестиционных фондов

На 01 марта в секторе "Ценные бумаги инвестиционных фондов" находились семь инструментов под управлением шести компаний.

Объем торгов вырос на 59,8 % и достиг 30,8 млн тенге. Лидерами по объему выступают паи US_SPY_ (11,2 млн тенге; 7 сделок) под управлением State Street Global Advisors, на втором и третьем местах – CSECgm (8 млн KZT; 1 сделка) и CSECfe (6,9 млн KZT; 8 сделок) под управлением АО "Сентрас Секьюритиз" и на четвертом – акции IE_FXBF субфонда FinEx FFIN Kazakhstan Equity ETF (ETF на Индекс KASE; 4,7 млн тенге; 23 сделки).

В разрезе основных категорий инвесторов 60,4 % приходится на физические лица, 24,5 % – на брокеров-дилеров и 15,2 % – на прочих юридических лиц.

Счета физических лиц на рынке ценных бумаг

По состоянию на 01 марта 2019 года в Центральном депозитарии числилось 118 184 лицевых счета, открытых физическими лицами, что на 502 счета больше, чем месяцем ранее и на 1 360 счетов больше чем на начало года.

РЫНОК ИНОСТРАННЫХ ВАЛЮТ

В феврале в торгах на рынке иностранных валют на KASE принимали участие 26 членов KASE.

Объем торгов на рынке иностранных валют достиг 1 007,9 млрд тенге, что выше показателя предыдущего месяца на 30,8 % или на 237,3 млрд тенге. Среднедневной объем торгов составил 50,4 млрд тенге, среднедневное количество сделок – 306, средний объем одной сделки – 164,8 млн тенге.

В условиях отсутствия внешних шоков экономики, национальная валюта в феврале традиционно укрепилась к валютным парам, торгующимся на KASE. Эффект налогового периода, в который экспортеры выплачивали налоги по итогам деятельности за четвертый

квартал 2018 года, выразился в увеличении объема торгов долларом США и укреплении тенге к доллару США на 1,3 %.

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	2 659,8 (+31,6 %)	99,4 % (+0,33 %)	5 959 (+968)	373,56–382,74	374,96 (-1,3 %)
RUB/KZT	531,6 (+11,7 %)	0,3 % (-0,05 %)	96 (+11)	5,6680–5,8308	5,7100 (-1,8 %)
CNY/KZT	21,2 (-25,1 %)	0,1 % (-0,09 %)	49 (-18)	55,1617–56,5789	56,2100 (-0,6 %)
EUR/KZT	3,7 (-41,7 %)	0,2 % (-0,20 %)	13 (-2)	423,13–431,50	426,70 (-2,6 %)

ДЕНЕЖНЫЙ РЫНОК

К концу февраля индикатор TONIA остался неизменным на уровне 8,25 % годовых – 13 торговых дней февраля из 20 завершились для индикатора TONIA на данном уровне. Значение индикатора TWINA (средневзвешенная процентная ставка по сделкам открытия репо сроком на семь рабочих дней) продемонстрировало снижение на 1 б.п. до 8,25 % годовых

Доходность однодневного долларowego свопа SWAP-1D (USD) на конец февраля достигла 7,5 % годовых, увеличившись за месяц на 155 б.п. Доходность двухдневного свопа SWAP-2D (USD) выросла на 77 б.п. до 7,61 % годовых.

В феврале индикатор KazPrime-3M (KZT) продолжил движение на верхней границе базовой ставки Национального Банка на уровне 10,25 % годовых.

Композитный индикатор денежного рынка MM_Index, представляющий собой средневзвешенное через объем сделок значение доходности по операциям валютного свопа USD/KZT и операциями автоматического репо с ГЦБ, открытыми на один рабочий день, к концу февраля вырос на 9 б.п. до 8,24 % годовых.

Рынок операций репо

Объем торгов в данном сегменте составил 6,3 трлн тенге, что выше показателя прошлого месяца на 2,9 %. Среднедневной объем операций в январе составил 315,8 млрд тенге, среднее количество сделок – 358, средний объем одной сделки – 882,9 млн тенге.

98,1 % от общего объема сделок открытия репо пришлось на сделки авторепо с корзиной ГЦБ. Наиболее популярным инструментом на рынке авторепо с корзиной ГЦБ остается операция репо сроком на один день, доля сделок с ним в общем объеме торгов на рынке авторепо с корзиной ГЦБ составила 91,5 %.

Всего в феврале в сделках на рынке репо принимали участие 43 члена Биржи. Более 87 % от общего оборота торгов в данном сегменте заняли банки. Доля участия нерезидентов в отчетном месяце была незначительна и составила 0,5 %.

Рынок валютного свопа

Объем торгов на рынке валютного свопа снизился на 8,4 % до 3 трлн тенге. Среднедневной объем операций составил 147,5 млрд тенге, среднее количество сделок – 50, средний объем одной сделки – 3 млрд тенге. В инструментальной структуре 79,9 % от общего объема торгов (2,4 трлн тенге или 6,2 млрд USD) на рынке валютного свопа пришлось на сделки с двухдневным валютным свопом (USDKZT_0_002).

С 18 февраля 2019 года на KASE открыты торги операциями валютного свопа со сроками исполнения одна неделя, один месяц и три месяца в отношении валютной пары доллар США / казахстанский тенге. 26 февраля были заключены первые сделки с "длинными" валютными свопами – одна сделка со свопами на неделю на сумму 5 млн долларов США (1,9 млрд тенге) и две сделки с недельными свопами на сумму 7 млн долларов США (2,6 млрд тенге). Все сделки были заключены по ставке 7,5 % годовых.

РЫНОК ДЕРИВАТИВОВ

В настоящий момент в данном секторе биржевого рынка к торговле доступны фьючерсы, базовыми активами которых являются доллар США, Индекс KASE и отдельные наименования акций. В феврале сделок с фьючерсами заключено не было. На начало марта открытые позиции участников торгов на рынке деривативов отсутствовали.

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.