

ПРЕСС-РЕЛИЗ

г. Алматы

21 января 2022 года

KASE представляет результаты работы биржевого рынка по итогам 2021 года

АО "Казахстанская фондовая биржа" (KASE или Биржа) информирует об основных итогах деятельности за 2021 год.

- Совокупный объем торгов на KASE в 2021 году составил 174,4 трлн тенге и вырос относительно 2020 года на 47,8 % или 56,5 трлн тенге.
- По итогам 2021 года значение Индекса KASE выросло на 37,4 % до 3 675,28 пунктов
- Капитализация рынка акций выросла за год на 51 % до 28,8 трлн тенге.
- Объем торгуемого на KASE корпоративного долга вырос на 4,8 % до 15,4 трлн тенге.
- В 2021 году процедуру листинга прошли ценные бумаги 55 новых эмитентов: 3 в секторе акции, 33 в секторе KASE Global, 17 в секторе корпоративные облигации и 2 ETF.
- По состоянию на 01 января 2022 года в торговых списках KASE находились негосударственные ценные бумаги 558 наименований 228 эмитентов.
- На 01 января 2022 года в Центральном депозитарии числилось 218 336 лицевых счетов, открытых на 199 306 физических лиц.

КЛЮЧЕВЫЕ ПРОЕКТЫ И МЕРОПРИЯТИЯ

В рамках реализации стратегии развития KASE на 2019–2021 годы за 2021 года Биржа реализовала следующие проекты и провела следующие мероприятия:

- 03 декабря 2021 года Совет директоров Биржи утвердил Стратегию развития KASE на 2022-2024 годы. Основной целью на предстоящий период определено достижение и поддержание статуса ведущей биржевой площадки в регионе и повышение ценности Биржи для стейкхолдеров;
- KASE и Scila AB заключили Соглашение на поставку и внедрение на площадке KASE автоматизированной надзорной системы Scila Surveillance™ в целях противодействия недобросовестным практикам на биржевом рынке;
- В честь 30-летия Независимости Казахстана KASE выпустила второе дополненное издание книги, посвященной истории финансового рынка;
- с 15 ноября KASE запустила новый сектор KASE Global, предназначенный для торговли наиболее ликвидными иностранными акциями. Общее количество акций, доступных к торговле достигло 43 ценных бумаг;
- с 15 сентября KASE начала расчет и публикацию новых индикаторов рынка денег – TONIA Compounded Index и TONIA Compounded Rate;
- KASE запустила новую торгово-клиринговую систему SPECTRA на рынке деривативов. Новая система характеризуется более высоким быстродействием и отказоустойчивостью, а также более функциональным торговым терминалом и возможностью подключения внутренних систем участников посредством современных протоколов обмена данными;
- Агентство Республики Казахстан по регулированию и развитию финансового рынка, Биржа и ТОО "ПрайсуотерхаусКуперс Такс энд Эдвайзори" (PwC Kazakhstan) заключили меморандум о сотрудничестве в целях продвижения принципов устойчивого финансирования;

- KASE подписала меморандумы с АО "Аналитическое Кредитное Рейтинговое Агентство" (АКРА) и АО "Эксперт РА" с целью продвижения финансирования ESG-проектов на казахстанском финансовом рынке и поддержки корпоративного сектора в финансировании проектов в области устойчивого развития.
- 16 июля 2021 года KASE совместно с PwC Kazakhstan и АО "Народный сберегательный банк Казахстана" провели конференцию "Зеленое финансирование и рынок долгового капитала".
- KASE предоставила возможность проведения торгов с использованием омнибус счетов. Благодаря этому проекту участники рынка смогут снизить транзакционные издержки при проведении расчетов с клиринговой организацией за счёт сокращения количества операций с финансовыми инструментами и деньгами;
- с 01 июля 2021 года на Биржа в структуре официального списка открылась новая площадка "Частное размещение", которая предназначена для негосударственных ценных бумаг, подлежащих частному размещению;
- 01 июня 2021 года KASE запустила программу "Зеленый офис" в рамках реализации Политики устойчивого развития, принятой Биржей в 2020 году.
- KASE увеличила срок операций репо, осуществляемых автоматическим способом, с 30 до 90 дней в целях обеспечения наличия инструментов для привлечения финансирования под залог ценных бумаг на более длительные сроки.
- Биржа запустила в эксплуатацию новую версию системы обмена документами с эмитентами и членами Биржи "Issuers to investors" (система is2in), в которой реализован электронный формат предоставления услуг по листингу ценных бумаг, аккредитации аудиторских организаций, предоставлению членства на Бирже профессиональным участникам рынка.
- В январе 2021 года KASE представила для широкого круга пользователей мобильное приложение "KASE Mobile". Приложение дополняет список информационных продуктов Биржи и предназначено прежде всего для упрощения доступа к биржевой информации для розничных и профессиональных инвесторов. В приложении также доступна функция участия в учебных торгах на KASE.

– **Обучающие мероприятия**

В целях повышения осведомленности о деятельности биржевого рынка KASE, а также о возможностях привлечения капитала на казахстанском фондовом рынке, Биржа продолжила выпуск на радио "Business FM" обучающей передачи "Фондовый рынок с KASE" до августа и новостной передачи "Биржевые новости KASE" в течение всего года.

Биржа провела вебинар "Основы фондового рынка" в рамках глобального проекта Global Money Week, направленного на повышение финансовой грамотности школьников и студентов. В вебинаре приняли участие студенты более 10 казахстанских вузов.

Биржа провела обучающий вебинар, посвященный теме экологических, социальных рисков и рисков корпоративного управления (ESG – Environmental, Social, Governance), в ходе которого спикеры рассказали о целях ESG, факторах влияния на рейтинги организации и раскрытии ESG-информации на KASE.

С 01 апреля по 31 января 2022 года Биржа провела конкурс "Биржевой симулятор", в котором приняли участие более 2 000 студентов из 60 вузов. Конкурс состоял из двух этапов. Проект "Биржевой симулятор" реализуется с 2008 года. За 12 лет в нем приняли участие более 8,5 тыс. студентов из 80 вузов Казахстана, а также стран ближнего и дальнего зарубежья.

KASE совместно с обучающим проектом по повышению финансовой грамотности Fingramota.kz Агентства Республики Казахстан по регулированию и развитию финансового рынка (АРРФР) и представительством международной организации Internews Network в Казахстане провела онлайн-семинар для журналистов "Фондовый рынок: освещаем грамотно".

Биржа провела вебинар "Принципы ответственного инвестирования", в рамках продвижения ESG критериев на казахстанском фондовом рынке.

С целью развития стартап-экосистемы Казахстана KASE провела в рамках проекта KASE Startup вебинары с участием основателей стартапов ТОО "1Fit", "Terenoi", "CTOgram" и клубом бизнес-ангелов Umay Angels Club.

Проведены открытые лекции в рамках проекта "KASE Talks" с участием Председателя Правления АО "Jysan Invest" Нурдаулета Айдосова, Председателя Правления АО "Фридом Финанс" Сергея Лукьянова, Председателя Правления АО "Сентрас Секьюритиз" Мурата Акинова, и.о. Председателя Правления АО "BCC Invest" Александра Дронина, Председателя Правления АО "Halyk Finance" Фархада Охонова и Председателя Совета Ассоциации финансистов Казахстана Елены Бахмутовой.

В рамках международной информационной кампании по повышению финансовой грамотности – Международная неделя инвесторов (World Investor Week), инициированной Международной организацией комиссий по ценным бумагам (IOSCO), KASE запустила образовательную программу Fall Sessions of Financial Literacy.

– Мероприятия для бизнеса

В рамках проекта "День эмитента" на KASE были организованы онлайн встречи руководства акимата г. Шымкент, Азиатского Банка Развития, АО "KEGOC", АО "Казахтелеком" и АО "Банк ЦентрКредит", АО "Кселл", ТОО "МФО "КМФ" и Евразийского банка развития с инвесторами, профессиональными участниками рынка ценных бумаг и представителями СМИ, посвященные итогам деятельности компаний за отчетный период.

KASE выступила партнером ежегодного саммита для управленцев и топ-менеджеров финансового блока "CFO Summit – 2021".

KASE для информирования бизнес-сообщества и заинтересованной общественности, совместно с Фондом развития предпринимательства "Даму" и акиматами Туркестанской, Актюбинской, Кызылординской, Акмолинской, Алматинской, Восточно-Казахстанской, Карагандинской, Западно-Казахстанской, Атырауской, Мангистауской, Павлодарской и Жамбылской областей, а также акиматами г. Нур-Султан, Алматы и Шымкент провели онлайн круглый стол по вопросам привлечения капитала на фондовом рынке.

По итогам 2020 года KASE провела награждение членов Биржи, продемонстрировавших наилучшие результаты на биржевых рынках KASE, листинговых компаний – за стремление к прозрачности, а также представителей СМИ – за активное освещение фондового рынка в печатных изданиях и на интернет-ресурсах.

– Международное сотрудничество

В ноябре 2021 года прошел онлайн-тренинг по раскрытию финансовой информации, связанной с изменением климата для участников из Казахстана и Кыргызстана. Тренинг проводился в рамках Инициативы ООН "Устойчивые фондовые биржи" (UN SSE) и сотрудничества KASE с Международной финансовой корпорацией (IFC), Советом по стандартам раскрытия информации о климате (CDSB) и ЗАО "Кыргызская фондовая биржа".

26 ноября 2021 года KASE приняла участие во II Международном финансово-банковском форуме стран СНГ, в рамках которого состоялось общее годовое собрание организаций – членов Международной ассоциации бирж (МАБ) Содружества.

20 октября 2021 года Биржа выступила на онлайн-конференции Федерации Евро-Азиатских фондовых бирж (FEAS), посвященной деятельности Казахстанской фондовой биржи "Meet the Market with FEAS | Kazakhstan Stock Exchange".

28 сентября 2021 года Биржа провела "KASE Day in Tashkent" в Республике Узбекистан. Мероприятие было направлено на ознакомление участников с текущей ситуацией и перспективами развития казахстанского биржевого рынка, финансовыми инструментами и услугами KASE, условиями привлечения капитала на казахстанском фондовом рынке для узбекских компаний и инвестиционным потенциалом.

АО "Казахстанская фондовая биржа" и АО "Узбекская республиканская валютная биржа" (UZCE) заключили Меморандум о взаимном сотрудничестве. Целью Меморандума является развитие взаимовыгодного сотрудничества между KASE и UZCE в области изучения и обмена опытом применения инструментов и технологий биржевой торговли.

09 июня 2021 года KASE совместно с Федерацией евро-азиатских фондовых бирж (FEAS) и Европейским банком реконструкции и развития (ЕБРР) провела вебинар на тему "IPO Workshop" для представителей всех заинтересованных компаний.

В рамках реализации Инициативы ООН "Устойчивые Фондовые Биржи" (Sustainable Stock Exchanges Initiative) в этом году уже в четвертый раз Биржа провела церемонию открытия торгов Ring the Bell for Gender Equality, а также онлайн-мероприятие "Инклюзивное лидерство: новая реальность в бизнесе".

РЫНОК АКЦИЙ

Капитализация рынка акций с начала года выросла на 51,0 % или 9,7 трлн тенге и составила 28,8 трлн KZT (66,6 млрд USD). Основной вклад в рост капитализации рынка акций внесло возобновление сделок на KASE и рост цены простых акций АО Kaspi.kz, а также рост цены большинства компаний индексного списка.

На конец 2021 года в торговых списках Биржи находились акции 164 наименований 150 эмитентов, из них акции трех наименований трех эмитентов допущены к обращению в секторе "Нелистинговые ценные бумаги" и иностранные акции 43 наименований в секторе KASE Global.

С начала года в официальный список Биржи были включены простые акции пяти наименований пяти эмитентов, в том числе три новых, прошедшие листинг на KASE впервые (АО "Жалтырбулак", АО "First Heartland Securities", АО "АзияАгроФуд") и два действующих эмитента (AltynGold PLC, АО "Сентрас Секьюритиз"). В четвертом квартале 2021 года в сектор KASE Global были включены иностранные акции 33 наименований.

Объем торгов акциями в 2021 году относительно 2020 года вырос на 80 % или 190,8 млрд тенге до 429,3 млрд тенге. Среднедневной объем торгов составил 1 751,9 млн тенге, среднее количество сделок – 1 863, средний объем одной сделки – 940,3 тыс. тенге.

Объем первичного рынка оценивается в 0,9 млрд тенге. Весь объем пришелся на размещение в торговой системе KASE простых акций АО "БАСТ" в первом квартале 2021 года. В разрезе инвесторов 87,1 % от объема торгов пришлось на юридические лица и 12,9 % на физические лица. Участие нерезидентов оценивается в 14,9 %.

Объем торгов **на вторичном рынке** акций вырос на 82,4 % или 193,5 млрд тенге и составил 428,4 млрд тенге. В четвертом квартале объем торгов составил 241,7 млрд тенге, из которых 127,2 млрд тенге пришлось на выкуп простых акций АО "Народный сберегательный банк Казахстана" и 67,1 млрд тенге на приобретение простых акций АО "КазАзот", которые состоялись в рамках специализированных торгов 10 декабря 2021 года.

В разрезе основных категорий инвесторов на вторичном рынке наиболее активными остаются физические лица, на счета которых пришлось 45,5 % от брутто-оборота торгов акциями. Участие банков оценивается в 0,1 %, брокеров-дилеров – в 12,1 %, на других институциональных инвесторов пришлось 6 %, на долю прочих юридических лиц – 36,2 %. Участие нерезидентов оценивается в 4,3 %.

KASE GLOBAL

С 15 ноября в секторе KASE Global были открыты торги иностранными акциями 25 наименований, допущенными к обращению на KASE впервые, с 22 ноября в данный сектор переведены акции 12 иностранных эмитентов, ранее находившиеся в категории "стандарт" основной площадки официального списка KASE. В декабре в списки KASE Global были включены еще 6 наименований акций. Таким образом, на конец года, в данном секторе для инвестирования были доступны 43 наименования акций иностранных эмитентов.

С момента начала торгов в секторе KASE Global было заключено 4 167 сделок на общую сумму 6,4 млрд тенге или 14,8 млн долларов США. В среднем в день было заключено 138 сделок на сумму 207,7 млн тенге или 477,7 тыс. долларов США.

ИНДЕКС KASE

С начала года Индекс KASE вырос на 37,4 % до 3 675,28 пунктов, несмотря на исключение из официального списка Биржи акций KAZ Minerals PLC в связи с решением о делистинге. Максимальное значение было зафиксировано 18 ноября – 3 810,7 пунктов. Совокупный объем торгов индексными акциями по итогам 2021 года составил 55,9 млрд тенге, увеличившись на 51,7 % по отношению к аналогичному периоду 2020 года.

Изменение цен акций по последним сделкам, входящих в представительский список Индекса KASE

Эмитент	Код	Цена, тенге за акцию			Объем*, млн тенге		
		на 01.01.22	на 01.01.21	Δ	2021 г.	2020 г.	Δ
АО "Казатомпром"	KZAP	16 890,00	7 150.00	136,2%	2 688,3	653,8	311,2%
АО "Банк ЦентрКредит"	CCBN	398,00	215.64	84,6%	7 034,0	3 458,0	103,4%
АО "Народный сберегательный банк Казахстана"	HSBK	186,99	123.99	50,8%	9 971,0	9 069,0	9,9%
АО "Казахтелеком"	KZTK	35 800,00	26 700.00	34,1%	5 826,3	5 647,4	3,2%
АО "КазТрансОйл"	KZTO	1 094,10	970	12,8%	5 562,8	4 341,2	28,1%
АО "KEGOC"	KEGC	1 870,52	1 697.00	10,2%	1 684,4	2 413,4	-30,2%
АО "Кселл"	KCEL	1 626,91	2 760.00	-41,1%	20 579,0	7 025,5	192,9%

*без учета крупных сделок и сделок нерегулярного характера

Лидером роста среди представителей списка Индекса KASE стали акции **АО "НАК Казатомпром"**. За год их цена выросла на KASE на 136,2 %. В текущем году правительства более 20 стран выразили заинтересованность в переходе к атомной энергетике. На фоне энерго-перехода на фондовых рынках частные инвесторы заинтересовались новым продуктом – трастовыми фондами, инвестирующими в физический уран. На бирже в Торонто 20 июля начал торговаться урановый траст Sprott Physical Uranium Trust. На конец 2021 года в управлении траста находятся активы на сумму 1,77 млрд долларов и 41,3 млн фунтов урана. Это примерно 30 % глобального годового потребления. С его выходом на рынок цены на урановые фьючерсы выросли с 30,3\$ до 50,8\$ за фунт, достигнув уровня 10-летней давности.

Ценные бумаги **АО "Банк ЦентрКредит"** выросли с начала года на 84,6 %. К началу четвертого квартала 2021 года акции банка полностью восстановили потери последних лет и перешли к последовательному обновлению исторических ценовых максимумов. Согласно данным ежемесячных отчетов Национального Банка Республики Казахстан за 11 месяцев ссудный портфель банка вырос на 107 млрд тенге, а доля просроченных кредитов снизилась на 0,3 %. На фоне роста ссудного портфеля процентные доходы банка выросли, а неконсолидированная чистая прибыль за 9 месяцев 2021 года увеличилась на 42,3 % по сравнению с аналогичным периодом прошлого года.

АО "Народный сберегательный банк Казахстана" в 2021 году отчитывалось о рекордной чистой прибыли, выплатил высокие дивиденды, снизил долговую нагрузку, погасив облигации на 1,3 млрд долларов, стал первым в Казахстане частным банком второго уровня, получившим инвестиционный рейтинг и озвучившим о переходе к новой финтех-стратегии.

Акции АО "Кселл" начали 2021 год с обновления исторических ценовых максимумов. Пик пришелся на 13 января, когда акции компании стоили 2 840 тенге за штуку. В начале февраля цена начала падать и к 24 августа снизилась на 57,6 % до 1 203 тенге. С 24 августа акции предпринимали попытку сменить тренд, однако перешли к росту только 10 октября. За неполный месяц ценные бумаги выросли в цене на 45,5 % до 1 751,11 тенге за акцию, а затем снова перешли к плавному снижению и закрыли год на уровне 1 626,91 тенге за штуку.

КОРПОРАТИВНЫЕ ОБЛИГАЦИИ

Объем корпоративного долга в обращении в 2021 году вырос на 4,8 % или 709,3 млрд тенге до 15,4 трлн тенге (35,7 млрд USD).

На конец декабря 2021 года в официальном списке KASE находились корпоративные облигации 318 выпусков 80 эмитентов. За 2021 год в официальный список KASE были включены облигации 85 выпусков 37 эмитентов (17 новых), из них в четвертом квартале – облигации 21 выпуска 19 эмитентов, из которых 9 новых – ТОО "Сейф-Ломбард", ТОО "МФО" Mogo Kazakhstan (Mogo Казахстан), Gaz Finance plc, АО "Казына Капитал Менеджмент", ТОО "МФО "ЮНИКРЕДО", АО "Baiterek Venture Fund", ТОО "ТССП Групп", ТОО "МФО Bravo Business", ТОО "МФО "Rangeld Finance".

Значение индекса доходности корпоративных облигаций KASE_BMY в 2021 году выросло на 15 базисных пунктов до 10,61 % годовых.

Объем торгов корпоративными облигациями на KASE снизился относительно 2020 года на 26,4 % или 710,4 млрд тенге до 1 980,8 млрд тенге. Среднедневной объем торгов составил 8,1 млрд тенге (на вторичном рынке – 3,4 млрд тенге), среднее количество сделок – 36 сделки (на вторичном рынке – 32 сделки), средний объем одной сделки – 224,1 млн тенге (на вторичном рынке – 106,5 млн тенге).

В 2021 году на первичном рынке корпоративных облигаций были размещены облигации 68 выпусков 33 эмитентов на общую сумму 1 143,7 млрд тенге, что ниже показателя 2020 года на 48,9 % или 1 095,7 млрд тенге. В четвертом квартале 2021 года были размещены облигации 27 выпусков 22 эмитентов на общую сумму 460,9 млрд тенге, что выше показателя третьего квартала в 2,1 раза:

- АО "Казахстанский фонд устойчивости" привлекло 89,7 млрд тенге, разместив облигации с доходностью к погашению 9,97–10,40 % годовых (средневзвешенная доходность по выпуску варьировала в диапазоне 9,97–10,40 % годовых) и сроком до погашения один год;
- АО "Аграрная кредитная корпорация" привлекло 35,0 млрд тенге, разместив десятилетние облигации с доходностью к погашению 7,10-11,5 % годовых;
- ТОО "5A OIL (5A OIЛ)" привлекло \$5 млн (2,2 млрд тенге), разместив международные облигации с доходностью к погашению 8 % годовых и сроком до погашения 2,5 года;
- АО "Банк Развития Казахстана" привлекло 55,5 млрд тенге, разместив десятилетние облигации с доходностью к погашению 7,10-11,0 % годовых;
- АО "Национальный управляющий холдинг "Байтерек" привлекло 55 млрд тенге, разместив десятилетние облигации с доходностью к погашению 11 % годовых;
- Дочерняя организация АО Банк ВТБ (Казахстан) привлекла 9,6 млрд тенге, разместив двухлетние облигации с доходностью к погашению 11,25 % годовых;
- АО "Банк ЦентрКредит" привлекло,ло 5,1 млрд тенге, разместив семилетние облигации с доходностью к погашению 12,5 % годовых;
- АО "Евразийский банк" привлекло 6,2 млрд тенге, разместив облигации со средневзвешенной доходностью к погашению 10,85 % годовых и сроком до погашения 4,7 лет;
- АО "Банк "Bank RBK" привлекло 24 млрд тенге, разместив облигации со средневзвешенной доходностью к погашению 10,85 % годовых;
- АО "Казына Капитал Менеджмент" привлекло 12,8 млрд тенге, разместив десятилетние облигации с доходностью к погашению 7,1 % годовых;
- АО "KEGOC" привлекло 16,6 млрд тенге, разместив облигации с доходностью к погашению 11,5 % годовых и сроком до погашения 13,6 лет;
- АО "Казахстанская Жилищная Компания" привлекло 50,0 млрд тенге, разместив десятилетние облигации с доходностью к погашению 7,02 % годовых;
- АО "Лизинг Групп" привлекло 1,8 млрд тенге, разместив годовые облигации под 13,25 % годовых;
- ТОО "Микрофинансовая организация "СиСиЛоун.кз" привлекло на KASE 80 млн тенге, разместив двухлетние облигации под 19 % годовых;
- ТОО "Микрофинансовая организация ОнлайнКазФинанс" привлекло 6,8 млрд тенге, разместив трехлетние облигации с доходностью к погашению 17–18 % годовых;
- АО "Фонд развития промышленности" привлекло 50,0 млрд тенге, разместив семилетние облигации под 12,40 % годовых;
- ТОО "Сейф-Ломбард" привлекло 489 млн тенге, разместив трехлетние облигации с доходностью к погашению 16 % годовых;
- АО "Транстелеком" привлекло 15 млрд тенге, разместив семилетние облигации с доходностью к погашению 13 % годовых;

- ТОО "PartnerInterFreight" (ПартнэрИнтерФрэйт) привлекло 74,2 млн тенге, разместив облигации с доходностью к погашению 11 % годовых и сроком до погашения менее одного года;
- ТОО "МФО "Swiss Capital (Свисс Капитал)" привлекло 41,8 млн тенге и \$120,8 тыс. (51,8 млн тенге), разместив трех- и двухлетние облигации под 20 % и 10 % годовых.

В разрезе основных категорий инвесторов на первичном рынке корпоративных облигаций доля банков составила 28,8 %, брокерско-дилерских организаций – 7 %, других институциональных инвесторов, включая страховых организаций – 22,9 %, прочих юридических лиц – 40,6 %, физических лиц – 0,8 %. Доля участия нерезидентов составила 3,7 %.

Объем торгов на вторичном рынке облигаций относительно 2020 года вырос на 85,3 % или 385,3 млрд тенге до 837 млрд тенге.

В разрезе основных категорий инвесторов на вторичном рынке корпоративных облигаций доля банков составила 2,3 %, брокерско-дилерских организаций – 12,6 %, других институциональных инвесторов – 25,3 %, прочих юридических лиц – 56 %, доля физических лиц – 3,8 %. Доля нерезидентов составила 10,4 %.

ГОСУДАРСТВЕННЫЕ ЦЕННЫЕ БУМАГИ (ГЦБ)

Сумма государственного долга по номиналу, торгуемого на KASE, составила 17,8 трлн тенге (41,3 млрд USD), увеличившись с начала года на 6,5 % или 1,1 трлн тенге.

Суммарный объем торгов ГЦБ на KASE составил 3,6 трлн тенге и снизился относительно 2020 года на 23,1 % или 1,1 трлн тенге. Среднедневной объем торгов составил 14,6 млрд тенге (на вторичном рынке – 3,6 млрд тенге), среднедневное количество сделок – 10 (на вторичном рынке – 7), средний объем одной сделки – 1,4 млрд тенге (средний объем одной сделки на вторичном рынке – 0,5 млрд тенге).

Объем торгов на первичном рынке ГЦБ снизился на 27,7 % или на 1 032,4 млрд тенге до 2 701,5 млрд тенге. Из них 287,5 млрд тенге привлекли акиматы 14-ти областей, г. Алматы, г. Нур-Султан и г. Шымкент. Министерство финансов привлекло 2 414,1 млрд тенге со средневзвешенной доходностью 8,99-10,87 % годовых, разместив 23 выпуска со сроком до погашения 0,9-15 лет.

При этом в четвертом квартале 2021 года объем размещений составил 887,9 млрд тенге, из них 189,1 млрд тенге привлекли акиматы, Министерство финансов – 698,8 млрд тенге. Ставки на аукционах размещений Министерства финансов складывались в диапазоне 10,16–10,85 % годовых в рамках размещений 14-ти выпусков со сроком до погашения 1,7-14,8 лет.

В разрезе основных категорий инвесторов на первичном рынке на долю БВУ пришлось 47,4 %, брокеров-дилеров – 0,7 %, других институциональных инвесторов – 34,9 %, доля прочих юридических лиц составила 16,9 %, физических лиц – 0,1 %. Доля нерезидентов составила 2 %.

Объем торгов на вторичном рынке снизился на 4,6 %, и достиг 874,4 млрд тенге. Доля торгов нотами Национального Банка на вторичном рынке – 34,7 % или 303,1 млрд тенге от общего объема торгов, доля МЕКАМ – 61,5 % или 537,8 млрд тенге, для еврооблигаций Республики Казахстан – 3,4 % или 29,8 млрд тенге. Остальной объем, составляющий менее 1 % (3,6 млрд тенге) пришелся на сделки с ГЦБ иностранных государств.

В четвертом квартале объем торгов ГЦБ на вторичном рынке составил 253,4 млрд тенге, при этом доля торгов нотами Национального Банка на вторичном рынке – 26,5 % или 67,2 млрд тенге от общего объема торгов, доля МЕКАМ – 69,4 % или 176,0 млрд тенге, для еврооблигаций Республики Казахстан – 3,2 % или 8,2 млрд тенге. Остальной объем, составляющий 0,8 % (2 млрд тенге) пришелся на сделки с ГЦБ иностранных государств.

В разрезе основных категорий инвесторов на вторичном рынке на долю БВУ пришлось 41,6 %, на долю брокеров-дилеров – 9,1 %, на долю других институциональных инвесторов – 11,9 %, доля прочих юридических лиц составила 37,0 %, на долю физических лиц пришлось 0,4 %. Участие нерезидентов оценивается в 7,5 %.

ОБЛИГАЦИИ МЕЖДУНАРОДНЫХ ФИНАНСОВЫХ ОРГАНИЗАЦИЙ (МФО)

На конец года в торговых списках KASE находились облигации 46 выпусков четырех международных финансовых организаций: Евразийского банка развития, Европейского банка реконструкции и развития, Международной финансовой корпорации и Азиатского банка развития.

В 2021 году в сектор "Ценные бумаги международных финансовых организаций" официального списка KASE включено 22 выпуска облигаций, из них в четвертом квартале 10 выпусков.

В 2021 году объем торгов составил 155,4 млрд тенге против 274,2 млрд тенге годом ранее, снизившись на 118,8 млрд тенге или на 43 %.

На первичном рынке сектора облигаций международных финансовых организаций в 2021 году были размещены 13 выпусков трех международных финансовых организаций на общую сумму 116,9 млрд тенге, что ниже показателя 2020 года на 56,2 % или 150,1 млрд тенге (представлено ниже).

- девять выпусков Евразийского банка развития на общую сумму 73,6 млрд тенге, средневзвешенная доходность варьировала от 9,50 % до 11,00 % годовых;
- три выпуска Азиатского банк развития на общую сумму 30,8 млрд тенге, средневзвешенная доходность варьировала от 9,95 % до 10,45 % годовых;
- один выпуск Европейского банка реконструкции и развития на общую сумму 12,5 млрд тенге с доходностью на уровне сложной процентной ставки TONIA+0 %.

При этом в четвертом квартале были размещены семь выпусков облигаций на сумму 47,8 млрд тенге.

В разрезе основных категорий инвесторов на первичном рынке доля банков составила 31,4 %, брокеров-дилеров – 8,3 %, других институциональных инвесторов – 27,7 %, прочих юридических лиц – 32,6 %. Доля нерезидентов составила 4,7 %.

На вторичном рынке объем торгов составил 38,5 млрд тенге, что в 5,3 раза или -31,3 млрд тенге выше, чем годом ранее.

В разрезе основных категорий инвесторов на вторичном рынке облигаций международных финансовых организаций доля банков составила 25,4 %, брокеров-дилеров – 21,1 %, других институциональных инвесторов – 30,4 %, прочих юридических лиц – 23,1 %, физических лиц – менее 0,1 %. Доля нерезидентов составила 17,5 %.

ПАИ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ФОНДОВ

На 01 января 2022 года в секторе "Ценные бумаги инвестиционных фондов" находились 19 инструментов паевых инвестиционных фондов под управлением шести управляющих компаний и шесть ETF.

С начала года в официальный список KASE в сектор "Ценные бумаги инвестиционных фондов" были включены девять инструментов: два ETF (Invesco Exchange-Traded Fund Trust и iShares Trust) и семь паевых инвестиционных фондов.

В 2021 году объем торгов составил 38,1 млрд тенге и вырос относительно 2020 года на 87,8 % или 17,8 млн тенге.

Инструмент	Объем, млн тенге	Количество сделок, шт.
RU_UKFFipo	30 078,3	9 700
FFIN_or	2 088,3	846
FHJlag	1 375,5	226
IE_FXBF	713,1	4 610
CSECfe	668,9	102
FHJlpc	495,4	68
CSECgm	437,2	83
US_BIL_	363,9	49
US_SPY_	340,6	1 177
FFINgw	311,8	51
US_PHO_	255,3	37
FHJlds	168,7	4 241
FHJlhm	157,8	3 674
HFINhp	146,4	1
HFINhs	145,4	1
US_ICLN	121,3	115
BCCIrb	120,3	4
FHJllq	66,6	35
BCCI_cc	63,8	4
US_GLD_	10,5	8
RU_UKFFvdo	5,0	12
HFINhv	1,0	25
Общий итог	38 135,2	25 069

В разрезе основных категорий инвесторов 49,0 % приходится на физические лица, 39,1 % – на брокеров-дилеров, 0,8 % – на других институциональных инвесторов, 11,1 % – на прочих юридических лиц. Доля нерезидентов составила 0,9 %.

СЧЕТА ФИЗИЧЕСКИХ ЛИЦ НА РЫНКЕ ЦЕННЫХ БУМАГ

По состоянию на 01 января 2022 года в Центральном депозитарии числилось 218 336 лицевых счетов, открытых на 199 306 физических лиц. По итогам декабря физическими лицами зарегистрировано 6 014 новых лицевых счетов, с начала 2021 года – 87 822 счетов.

РЫНОК ИНОСТРАННЫХ ВАЛЮТ

В 2021 году в торгах на рынке иностранных валют на KASE принимало участие 34 члена KASE. Объем торгов достиг 15,6 трлн тенге, что выше аналогичного показателя прошлого года на 34,1 % или 3 960,9 млрд тенге. Среднедневной объем торгов составил 63,5 млрд тенге, среднее количество сделок – 422, средний объем одной сделки – 150,2 млн тенге.

В нижеследующей таблице приводятся основные характеристики торгуемых на KASE валютных пар (в скобках указано изменение показателя к аналогичному периоду прошлого года, изменение курса отражает номинальное изменение средневзвешенного биржевого курса иностранной валюты к KZT).

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 периода (изм.%)
USD/KZT	35 472,9 (+28,5 %)	97,2 % (-1,1 %)	99 031 (+3,9 %)	414,81 – 436,36	431,80 (+2,6 %)
RUB/KZT	46 703,7 (X 2,6)	1,7 % (+0,9 %)	2 890 (X 2,3)	5,5525 – 6,1176	5,9260 (+4,2 %)
CNY/KZT	1 855,9 (+39,8 %)	0,8 % (+0,1 %)	1 461 (+79,5 %)	64,2429 – 68,6093	67,8487 (+4,9 %)
EUR/KZT	69,1 (X 2,0)	0,2 % (+0,1 %)	250 (+27,6 %)	492,00 – 523,00	492,00 (-3,8 %)

ДЕНЕЖНЫЙ РЫНОК

Совокупный объем торгов на рынке денег достиг 152,7 трлн тенге, увеличившись относительно показателя прошлого года на 55 %, или на 54,2 трлн 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, увеличился на 227 б.п. до 10,52 % годовых с 8,25 % годовых.

Рынок операций репо

Совокупный объем операций репо за 2021 год составил 141,6 трлн тенге, что больше объема операций 2020 года на 53,1 трлн тенге или на 59,9 %. Среднедневной объем операций составил 578,1 млрд тенге, среднее количество ежедневных заключенных сделок – 579, средний объем одной сделки – 997,7 млн тенге. В структуре операций репо 93 % или 131,9 трлн тенге составили операции авторепо с корзиной ГЦБ, авторепо с корзиной ОДГУ – 2 % или 3 трлн тенге, авторепо с иностранными ГЦБ – 2 % или 2,5 трлн тенге, авторепо с НЦБ – 3 % или 4,1 трлн тенге, прямое репо НЦБ – менее 0,1 % или 0,1 трлн тенге.

Индикатор TONIA за 2021 год вырос на 231 б.п. с 8,25 % до 10,56 % годовых, сезонное колебание наблюдалось в период налоговых выплат, а также давление на индикатор усилилось в декабре 2021 года.

Значение индикатора TRION выросло на 228 б.п. с 8,25 % до 10,53 % годовых, значение индикатора TWINA – на 174 б.п. с 8,60% до 10,34% годовых

С 15 сентября KASE приступила к расчету производных индикаторов на основе индикатора денежного рынка TONIA – TONIA Compounded Index (TCI) и TONIA Compounded Rate (TCR). Индикаторы разработаны с участием Европейского банка реконструкции и развития и банков второго уровня Республики Казахстан по аналогии с расчетом эталонных процентных ставок средних значений индекса SOFR (администратором данного индекса является Федеральный резервный Банк США) и ICE SONIA (администратор – Банк Англии). Новые индикаторы TONIA Compounded Index и TONIA Compounded Rate служат ориентиром при формировании цен финансовых продуктов, и дают участникам финансового рынка возможность диверсифицировать продуктовые линейки.

Операции валютного свопа

Совокупный объем операций валютного свопа вырос на 1,1 трлн тенге или на 11 % до 11 трлн тенге с 9,9 трлн тенге в 2020 году. Среднедневной объем операций в 2021 году составил 45 млрд тенге, среднедневное количество сделок – 13, средний объем одной сделки – 3,5 млрд тенге.

В инструментальной структуре 61,6 % от общего объема торгов (6,8 трлн тенге или 15,9 млрд USD) на рынке валютного свопа пришлось на сделки с однодневным валютным свопом (USDKZT_0_001), 32,9 % от общего объема торгов (3,6 трлн тенге или 8,5 млрд USD) на рынке валютного свопа пришлось на сделки с двухдневным валютным свопом (USDKZT_0_002), 5,3 % от общего объема торгов (586,1 млрд тенге или 1,4 млрд USD) – на сделки с месячным валютным свопом (USDKZT_0_01M) и 0,1 % (12,6 млрд тенге или 30 млн USD) – на сделки с недельным валютным свопом, менее 0,1 % (261,8 млн тенге или 45,0 млн рублей) на сделки с однодневным валютным свопом с российским рублем.

Доходность однодневного долларowego свопа SWAP-1D (USD) на конец года достигла 9,47 % годовых и вырос с начала года на 120 б.п. Доходность двухдневного валютного свопа SWAP-2D (USD) увеличилась на 224 б.п. до 10,24 % годовых.

РЫНОК ДЕРИВАТИВОВ

В настоящий момент на рынке деривативов к торговле доступны беспоставочные фьючерсы на курс доллара США к тенге, простые акции АО "Народный сберегательный банк Казахстана", простые акции АО "НАК "Казатомпром" и Индекс KASE.

В 2021 году было заключено 9 сделок на сумму 1,8 млн тенге:

- две сделки с фьючерсом на курс доллара США к тенге с исполнением в июле 2021 года на общую сумму 856 000 тенге;
- одна сделка с фьючерсом на курс доллара США к тенге с исполнением в августе 2021 года на общую сумму 849 600 тенге;
- две сделки с фьючерсом на простые акции АО "Национальная атомная компания "Казатомпром" с исполнением в июле 2021 года на общую сумму 36 336 тенге;
- две сделки с фьючерсом на простые акции АО "Народный сберегательный банк Казахстана" с исполнением в августе 2021 года на общую сумму 64 575 тенге;
- две сделки с фьючерсом на Индекс KASE с исполнением в августе 2021 года на общую сумму 9 286 тенге.

К началу 2022 года 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 пятое место по объему 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.