



## ПРЕСС-РЕЛИЗ

г. Алматы

11 сентября 2019 года

### **KASE представляет итоги работы биржевого рынка в августе 2019 года**

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

- Совокупный объем торгов на KASE в августе 2019 года составил 8,8 трлн тенге и снизился относительно июля 2019 года на 8,9 % или 864,9 млрд тенге.
- На 01 сентября 2019 года в торговых списках KASE находились ценные бумаги 177 эмитентов.
- В официальный список включены глобальные депозитарные расписки, базовым активом которых являются простые акции АО "Кселл".
- По итогам августа капитализация рынка акций снизилась на 2,6 % до 15,5 трлн тенге.
- На 01 сентября объем торгуемого корпоративного долга вырос на 0,8 % до 11,9 трлн тенге.
- В августе 2019 года в официальный список Биржи были включены шесть выпусков облигаций шести эмитентов, один из которых впервые прошел процедуру листинга на KASE.
- В секторе корпоративных облигаций объем первичных размещений составил 106 млрд тенге.
- По состоянию на 01 сентября в Центральном депозитарии числилось 120 070 лицевых счетов, открытых физическими лицами, что на 383 счета больше, чем месяцем ранее и на 3 246 счетов больше чем на начало 2019 года.

### **РЫНОК АКЦИЙ**

По итогам августа капитализация рынка акций снизилась на 2,6 % или на 420 млрд тенге до 15,5 трлн тенге. Снижение произошло за счет падения цен на акции ряда крупных компаний, в том числе входящих в расчет Индекса KASE.

На конец месяца в торговых списках KASE находились акции 138 наименований 123 эмитентов, из них два выпуска допущены к обращению в секторе нелистинговые ценные бумаги.

Объем торгов акциями в августе относительно июля 2019 года снизился на 50,6 % или на 22,6 млрд тенге до 22 млрд тенге. Среднедневной объем торгов составил 1 млрд тенге, среднее количество сделок 417, средний объем одной сделки – 2,5 млн тенге.

На KASE заключены первые сделки с акциями, прошедшими неспонсируемый листинг на Бирже: простые акции Ford Motor Company, Intel Corporation, Pfizer Inc., The Coca-Cola Company, NIKE, Inc., Starbucks Corporation, Exxon Mobil Corporation, ПАО "Лукойл", ПАО "Новолипецкий металлургический комбинат".

Среди основных категорий инвесторов доля физических лиц составила 47,3 % от суммарного объема сделок с акциями. На долю банков второго уровня (БВУ) пришлось 5,5 %, брокеров-дилеров – 30,1 %, других институциональных инвесторов – 3,2 %, доля прочих юридических лиц достигла 13,9 %. Участие нерезидентов оценивается в 12,9 %.

## ИНДЕКС KASE

Индекс KASE завершил август снижением на 4,4 %, или на 99,28 пунктов до 2 174,36 пунктов.

### Изменение цен акций, входящих в представительский список KASE

Эмитент	Торговый код	Изменение цены		
		на 01.08.2019	на 01.09.2019	в августе
АО "Кселл"	KCEL	1 920,00	2 050,00	+6,77%
АО "Банк ЦентрКредит"	CCBN	230,01	233,94	+1,71%
АО "Казахтелеком"	KZTK	24 510,01	24 505,00	-0,02%
АО "KEGOC"	KEGC	1 563,00	1 530,33	-2,09%
АО "Народный сберегательный банк "Казахстана"	HSBK	132,55	128,96	-2,71%
АО "КазТрансОйл"	KZTO	1 049,99	1 012,77	-3,54%
KAZ Minerals PLC	GB_KZMS	2 779,11	1 982,74	-28,66%

Наибольший рост по итогам августа показали акции АО "Кселл", цена которых выросла на 6,8 %. Рынок данных акций в последнее время очень тонкий и волатильный. Поэтому даже небольшой спрос в начале третьей декады августа привел к росту цены с 1 900 до 2 050 тенге за акцию.

Существенное падение в течение месяца продемонстрировали акции KAZ Minerals PLC. Акции медедобывающей компании упали на 28,66 % до отметки 1 982,74 тенге на фоне публикации финансовых результатов за первое полугодие 2019 года. Доходы компании от реализации составили \$1 052 млн против \$1 098 млн в первом полугодии 2018 года. Увеличение производства привело к увеличению объемов реализации меди на 3 %, однако это было компенсировано 11 %-ным снижением цены на медь. Операционный доход составил \$410 млн (\$464 млн в первом полугодии 2018 года).

## РЫНОК КОРПОРАТИВНЫХ ОБЛИГАЦИЙ

На 01 сентября в официальном списке KASE находились 255 выпусков корпоративных облигаций 66 эмитентов. В августе в официальный список Биржи были включены 6 выпусков облигаций 6 эмитентов: ТОО "МеталлИнвестАтырау", АО "Фонд проблемных кредитов", АО "Аграрная кредитная корпорация", АО "Байтерек девелопмент", ТОО "Novacom Corporation", АО "НУХ "Байтерек".

Из торговых списков KASE в августе были исключены пять выпусков корпоративных облигаций четырех эмитентов по причине истечения срока обращения.

Объем корпоративного долга в обращении в августе вырос на 0,8 % или на 95,3 млрд тенге, достигнув отметки 11,9 трлн тенге.

Значение индекса доходности корпоративных облигаций KASE\_BMY выросло в августе на 1 базисный пункт до 10,75 % годовых.

Объем торгов корпоративными облигациями на KASE снизился относительно июля на 27,7 % или на 61,2 млрд тенге до 159,6 млрд тенге. Среднедневной объем торгов составил 7,6 млрд тенге, среднедневное количество сделок – 8, средний объем одной сделки – 907 млн тенге.

В августе на первичном рынке в секторе корпоративных облигаций были размещены семь выпусков на общую сумму 106 млрд тенге, что на 47,8 % или 97 млрд тенге ниже показателя июля.

- АО "Оптово-розничное предприятие торговли" привлекло 06 августа 480,5 млн тенге, разместив семилетние облигации под 10,4975 % годовых;
- АО "Ипотечная организация "Баспана" привлекло 23,6 млрд тенге, разместив облигации со средневзвешенной доходностью 10,3440 % годовых;
- АО "Фонд проблемных кредитов" привлекло 14 августа 10,1 млрд тенге, разместив десятилетние облигации под 9 % годовых;
- АО "Евразийский банк" привлекло 15 августа 2,0 млрд тенге, разместив семилетние облигации под 10,95 % годовых;
- АО "Национальная компания "Қазақстан темір жолы" привлекло 20 августа 40 млрд тенге;
- Дочерняя организация АО Банк ВТБ (Казахстан) привлекла 20 августа 4,9 млрд тенге, разместив двухлетние облигации под 10,42 % годовых;
- АО "Национальный управляющий холдинг "Байтерек" привлекло 29 августа 25 млрд тенге, разместив десятилетние облигации под 9,75 % годовых.

В разрезе основных категорий инвесторов на первичном рынке корпоративных облигаций доля БВУ составила 14,2 %, брокеров-дилеров – менее 0,1 %. На долю других институциональных инвесторов пришлось 45,6 %, прочих юридических лиц – 40,2 %. Нерезиденты в торгах участие не принимали.

Объем торгов на вторичном рынке облигаций вырос в 3 раза или на 35,9 млрд тенге до 53,6 млрд тенге.

В разрезе основных категорий инвесторов на вторичном рынке корпоративных облигаций доля БВУ составила 2,8 %, брокеров-дилеров – 0,5 %, других институциональных инвесторов – 2,9 %, прочих юридических лиц – 93,5 %, доля физических лиц – 0,3 %. Доля нерезидентов – 0,2 %.

## РЫНОК ГЦБ

Номинальная стоимость торгуемого на KASE государственного долга в августе выросла на 3,4 % или на 420,8 млрд тенге до 12,7 трлн тенге.

В августе объем торгов на рынке ГЦБ снизился на 81,7 % или на 311,2 млрд тенге до 69,6 млрд тенге. Среднедневной объем торгов сложился на уровне 3,3 млрд тенге, среднедневное количество сделок – 3, средний объем одной сделки – 1 млрд тенге.

Объем первичного рынка ГЦБ составил 39,9 млрд тенге и снизился относительно июля на 88,5 % или на 308,9 млрд тенге. В рамках реализации государственных программ местные исполнительные органы шести областей, г. Алматы, г. Нур-Султан и г. Шымкент привлекли 11,6 млрд тенге под 0,35 % годовых. Остальной объем – 28,3 млрд тенге что на 91,9 % или на 320,5 млрд тенге, меньше аналогичного показателя июля – привлекло Министерство финансов, разместив семь выпусков облигаций под 8,55–9,75 % годовых.

В структуре инвесторов на первичном рынке на долю БВУ пришлось 18,2 %, на долю других институциональных инвесторов – 52,7 %, доля прочих юридических лиц составила 29,1 %. Нерезиденты в торгах не участвовали.

Объем торгов на вторичном рынке снизился на 7,3 % или на 2,3 млрд тенге до 29,6 млрд тенге. 88,4 % об общего оборота торгов вторичного рынка пришлось на ноты Национального Банка.

В структуре инвесторов на вторичном рынке на долю БВУ пришлось 40,7 %, на долю брокеров-дилеров – 2 %, на долю других институциональных инвесторов – 34,1 %, доля прочих юридических лиц составила 23,2 %. Нерезиденты в торгах не участвовали.

## ОБЛИГАЦИИ МФО

На конец отчетного периода в торговых списках KASE находилось 27 выпусков облигаций пяти международных финансовых организаций: Евразийского банка развития, Европейского банка реконструкции и развития, Европейского инвестиционного банка, Международной финансовой корпорации (IFC) и Азиатского банка развития.

В отчетном месяце в секторе облигаций МФО размещений не было.

Объем торгов на вторичном рынке составил 5 млрд тенге. 50 % пришлось на сделки, заключенных клиентами брокерско-дилерскими компаниями – юридическими лицами и 50 % составила доля институциональных инвесторов.

### ПАИ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ФОНДОВ

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

Объем торгов снизился на 65,4 % и составил 20,2 млн тенге. Лидерами по объему сделок выступили паи US\_SPY\_ (9,8 млн тенге; 15 сделок) под управлением State Street Global Advisors, на втором месте BCCI\_сс (4 млн KZT; 1 сделка) под управлением АО "BCC Invest", на третьем – акции IE\_FXBF субфонда FinEx FFIN Kazakhstan Equity ETF (ETF на Индекс KASE; 3,4 млн тенге; 17 сделок) и четвертом – CSECFE (3 млн KZT; 1 сделка) под управлением АО "Сентрас Секьюритиз".

В разрезе основных категорий инвесторов 57,9 % приходится на физические лица, 32 % – на брокеров-дилеров и 10,2 % – на прочих юридических лиц.

### СЧЕТА ФИЗИЧЕСКИХ ЛИЦ НА ФОНДОВОМ РЫНКЕ

По состоянию на 01 сентября 2019 года в Центральной депозитарии числилось 120 070 лицевых счетов, открытых физическими лицами, что на 383 счета больше, чем месяцем ранее и на 3 246 счетов больше чем на начало 2019 года.

### РЫНОК ИНОСТРАННЫХ ВАЛЮТ

Объем торгов на рынке иностранных валют сложился на уровне 996,1 млрд тенге, что ниже показателя предыдущего месяца на 5,2 % или 54,7 млрд тенге. Среднедневной объем торгов составил 47,4 млрд тенге, среднедневное количество сделок – 383, средний объем одной сделки – 123,7 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	2 557,9 (-6,0 %)	99,3 % (-0,10 %)	7 868 (-385)	385,01 – 387,73	387,44 (+0,8 %)
RUB/KZT	435,7 (+16,2 %)	0,3 % (+0,04 %)	88 (+25)	5,7900 – 6,0571	5,8249 (-3,8 %)
CNY/KZT	48,8 (X 2,1)	0,3 % (+0,15 %)	72 (+8)	53,9869 – 55,7250	54,0750 (-3,1 %)
EUR/KZT	3,6 (-39,6 %)	0,2 % (-0,09 %)	24 (-6)	425,40 – 434,85	430,00 (+0,3 %)

Как следует из приведенных данных тенге оставался стабильным к основным валютам и несколько укрепился к рублю и юаню.

Курс тенге к доллару жил в слабонаклонном ценовом канале шириной около трех тенге. Слабому наклону в сторону ослабления тенге способствовало общее давление на валюты развивающихся стран вследствие рисков замедления темпов экономик мира на фоне торговой войны между Китаем и США, снижения спроса на сырьевые товары вследствие спада мирового производства и снижения занятости населения. Кроме того, стоит отметить сохранение санкционной риторики по отношению к России.

## ДЕНЕЖНЫЙ РЫНОК

К концу августа индикатор TONIA вырос на 139 б.п. до 9,66 % годовых, значение индикатора TWINA также продемонстрировало рост на 102 б.п. до 9,36 % годовых

Доходность однодневного долларowego свопа SWAP-1D (USD) на конец августа достигла 9,83 % годовых, прибавив за месяц на 192 б.п. Доходность двухдневного свопа SWAP-2D (USD) выросла на 185 б.п. до 10,12 % годовых.

В августе индикатор KazPrime-3M (KZT) продолжил свое движение по верхней границе базовой ставки Национального Банка на уровне 10 % 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 августа вырос на 147 б.п. до 9,69 % годовых.

## Рынок операций репо

Объем торгов в данном сегменте составил 4,8 трлн тенге, что ниже показателя прошлого месяца на 8,9 % или на 470,5 млрд тенге. Среднедневной объем операций составил 229,2 млрд тенге, среднее количество сделок – 363, средний объем одной сделки – 631,9 млн тенге.

97,2 % 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 87,8 %.

## Рынок валютного свопа

Объем торгов на рынке валютного свопа вырос на 4,7 % до 2 763 млрд тенге. Среднедневной объем операций составил 131,6 млрд тенге, среднее количество сделок – 45, средний объем одной сделки – 2,9 млрд тенге.

В инструментальной структуре 78,7 % от общего объема торгов (2,2 трлн тенге или 5,6 млрд USD) на рынке валютного свопа пришлось на сделки с двухдневным валютным свопом (USDKZT\_0\_002).

В августе было заключено 17 сделок с "длинными" валютными свопами – 13 сделок с недельными свопами на сумму 145 млн долларов США (56,1 млрд тенге) под 7,8–9,7 % годовых; и четыре сделки со свопами на месяц на сумму 40 млн долларов США (15,5 млрд тенге) под 8–8,5 % 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 августе была заключена одна сделка с недельным фьючерсом на курс доллара США к тенге объемом 387,6 млн тенге. Окончательная расчетная цена фьючерса составила 387,21 тенге за доллар США. К началу сентября 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](mailto:pr@kase.kz).