

ПРЕСС-РЕЛИЗ

г. Алматы

10 августа 2022 года

KASE представляет итоги работы биржевого рынка за июль 2022 года

АО "Казахстанская фондовая биржа" (далее – KASE, Биржа) информирует об основных итогах деятельности за июль 2022 года:

- Совокупный объем торгов на KASE в июле 2022 года составил 15,7 трлн тенге и снизился относительно июня на 37,3 % или 9,4 трлн тенге.
- По итогам июля значение Индекса KASE выросло на 10,4 % и составило 2 953,54 пункта.
- Капитализация рынка акций выросла на 4,4 % до 21,8 трлн тенге, объем торгуемого корпоративного долга повысился на 1,1 % до 15,4 трлн тенге.
- По состоянию на 01 августа 2022 года в торговых списках KASE находились негосударственные ценные бумаги 563 наименований 229 эмитентов.
- По состоянию на 01 августа 2022 года в Центральной депозитарии числилось 383 285 лицевых счетов, открытых на 357 957 физических лиц. За июль физическими лицами было открыто 18 223 новых лицевых счета.

МЕРОПРИЯТИЯ

Биржа провела обучающий вебинар для работников АО «Фонд Развития Предпринимательства «Даму» по выпуску облигаций на KASE. Также прошел обучающий вебинар для работников брокерских организаций по условиям субсидирования облигаций для малого и среднего бизнеса.

Биржа приняла участие в региональном конкурсе-выставке производителей «Лучший товар Казахстана», познакомила представителей крупного, среднего и малого бизнеса с инструментами фондового рынка для привлечения финансирования, в том числе, с государственной программой субсидирования выпусков облигаций.

РЫНОК АКЦИЙ

По итогам июля 2022 года капитализация рынка акций составила 21,8 трлн тенге (45,5 млрд USD), что выше на 0,9 трлн тенге или 4,4 % аналогичного показателя предыдущего месяца. Основная доля роста пришлась на индексные компании за счет корректировки цен их акций.

На конец июля в торговых списках KASE находились акции 118 наименований 103 эмитентов, из них акции трех наименований трех эмитентов допущены к обращению в секторе "Нелистинговые ценные бумаги".

В отчетном месяце в официальный список KASE были включены простые акции АО "Акбакай Голд Ресорсиз" и привилегированные акции АО "СК "Sinoasia B&R (Синоазия БиЭндАр)". Из официального списка Биржи были исключены привилегированные акции АО "Финансовая компания "REAL-INVEST.kz" по инициативе их эмитента.

Объем торгов акциями в июле составил 7,0 млрд тенге, снизившись относительно июня на 20,1 % или 1,8 млрд тенге. При этом количество сделок снизилось на 12,6 % до 18 578. Среднедневной объем торгов составил 348,0 млн тенге, среднедневное количество сделок – 929, средний объем одной сделки – 374,7 тыс. тенге.

В отчетном месяце в рамках подписки АО "СК "Sinoasia B&R (Синоазия БиЭндАр)" разместило 55 000 привилегированных акций KZ1P00014559 (SABRp) на сумму 979,0 млн тенге.

Объем торгов на вторичном рынке акций снизился на 31,4 % или 2,7 млрд тенге и составил 6,0 млрд тенге.

Среди основных категорий инвесторов на долю физических лиц пришлось 40,6 % от суммарного объема сделок с акциями, на долю брокерско-дилерских организаций – 19,8 %, на долю других институциональных инвесторов – 9,0 %, на долю прочих юридических лиц – 30,5 %. Доля нерезидентов составила 2,9 %.

ИНДЕКС KASE

Значение индекса KASE в июле выросло на 10,4 % и к концу месяца составило 2 953,54 пункта. Этому способствовал резкий разворот на ведущих американских и европейских площадках с локальных минимумов, зафиксированных в конце первого полугодия. Основные индексы отыграли по итогам июля от 6 до 8%. Последний раз такой резкий месячный рост на этих площадках был зафиксирован в ноябре 2020 года, когда рынок стоял у начала одного из самых крупных циклов поддержки. На текущий момент фундаментальных причин для роста у рынков не много, однако рынки приветствуют каждую позитивную отчетность и ожидают начала очередной волны поддержки со стороны Центробанков.

Объем сделок с индексными акциями в июле 2022 года составил 2,5 млрд тенге, что на 49,8 % или 2,5 млрд тенге ниже показателя июня 2022 года. Наибольший объем торгов пришелся на простые акции АО "Банк ЦентрКредит" – 911,0 млн тенге (35,8 % от общего объема торгов с индексными акциями).

Эмитент	Торговый код	Цена, тенге за акцию			Объем торгов, млн тенге		
		на 01.08.2022	на 01.07.2022	Δ, %	июль	июнь	Δ
АО "Kcell"	KCEL	1 450,00	1 095,00	+32,4	322,9	2 130,6	-1 807,8
АО "Национальная атомная компания "Казатомпром"	KZAP	14 620,00	12 038,00	+21,4	451,9	370,9	+81,0
АО "КазТрансОйл"	KZTO	821,00	685,00	+19,9	124,1	152,4	-28,3
АО "Банк ЦентрКредит"	CCBN	471,99	430,54	+9,6	911,0	1 643,6	-732,6
АО Kaspi.kz	KSPI	25 548,00	24 240,00	+5,4	361,7	162,7	+199,0
АО "Казахтелеком"	KZTK	27 900,00	26 999,98	+3,3	35,1	43,2	-8,0
АО "КЕГОС"	KEGC	1 597,00	1 605,00	-0,5	52,6	194,7	-142,1
АО "Народный сберегательный банк Казахстана"	HSBK	112,05	114,79	-2,4	286,5	378,4	-91,9

Лидером роста по итогам июля стали простые акции АО "Kcell", выросшие на 32,4 %. 26 июля в рамках Дня эмитента на KASE Кселл объявил, что чистая прибыль компании во втором квартале выросла на 19,4 %, до 10,1 млрд тенге, по итогам полугодия рост составил 23,9 % до 19,4 млрд тенге.

Второе место по темпам роста с результатом 21,4 % за месяц показали простые акции АО "НАК "Казатомпром" на ожиданиях публикации сильных полугодичных финансовых показателей.

Тройку лидеров замыкают восстановившиеся в цене на 19,9 % акции АО "КазТрансОйл". 27 июля транспортная компания отчиталась об операционных результатах за полугодие, согласно которым за шесть месяцев общий объем транспортировки снизился по сравнению с первым полугодием 2021 года всего на 2,3 %, что значительно лучше прогнозов рынка.

Среди индексных представителей банковского сектора лидером роста стали акции АО "Банк ЦентрКредит", прибавившие 9,6 %. 22 июля международное агентство S&P Global Ratings повысило долгосрочный кредитный рейтинг Банка ЦентрКредит с «В» до «В+» с прогнозом "Стабильный", отметив улучшение бизнес-позиции и увеличение запаса капитала.

Простые акции Kaspi.kz восстановили 5,4 %. Компания опубликовала финансовые результаты за второй квартал и первое полугодие 2022 года. Чистая прибыль Kaspi.kz во втором квартале увеличилась на 32 % до 135,2 млрд тенге. За полугодие рост составил 39,4 % до 252,4 млрд

тенге. Основываясь на этих результатах, Совет директоров предложил выплатить дивиденды в размере 500 тенге на одну ГДР.

22 июля закончилась первая программа выкупа ГДР Kaspi.kz. Сумма выкупа составила около 51 млн долларов США или 998,4 тыс. ГДР, что эквивалентно 0,52% от общего количества ГДР в обращении. Совет директоров одобрил вторую трехмесячную программу выкупа ГДР в объеме до 100 млн долларов США.

СЕКТОР "KASE GLOBAL"

На конец июля в торговых списках сектора KASE Global находились акции 46 наименований.

За июль в секторе KASE Global было заключено 1 467 сделок на общую сумму 482,3 млн тенге. Относительно июня объем торгов снизился на 53,7% или 560,2 млн тенге, количество сделок снизилось на 21,5 %. Среднедневной объем торгов составил 24,1 млн тенге, среднее количество сделок – 73, средний объем одной сделки – 328,8 тыс. тенге.

По итогам месяца наибольший объем сделок пришелся на следующие акции:

- US0079031078 (AMD_KZ) Advanced Micro Devices, Inc. – 119 сделок на общую сумму 138,5 млн тенге;
- US67066G1040 (NVDA_KZ) NVIDIA Corp. – 91 сделка на общую сумму 89,7 млн тенге;
- US0378331005 (AAPL_KZ) Apple Inc. – 139 сделок на общую сумму 39,6 млн тенге.

Среди основных категорий инвесторов наибольшая доля пришлась на физических лиц – 54,8%. На долю брокерско-дилерских организаций пришлось 44,2 %, на долю прочих юридических лиц – 1,0 %. Участие нерезидентов составило 2,0 %

КОРПОРАТИВНЫЕ ОБЛИГАЦИИ

Объем корпоративного долга в обращении в июле 2022 года повысился на 1,1 % или 168,6 млрд тенге до 15,4 трлн тенге (32,2 млрд USD).

На конец июля 2022 года в официальном списке KASE находились корпоративные облигации 328 выпусков 82 эмитентов. За июль 2022 года в официальный список KASE были включены семь выпусков облигаций АО "Казахстанский фонд устойчивости" и один выпуск облигаций АО "Национальная компания "Қазақстан темір жолы". В июле 2022 года из официального списка KASE был исключен один выпуск корпоративных облигаций АО "Eco Center Bank" (ДБ АО "Банк ЦентрКредит") в связи с их аннулированием и три выпуска облигаций АО "Банк Развития Казахстана" в связи с истечением срока обращения.

Значение индекса доходности корпоративных облигаций KASE_BMY в июле 2022 года снизилось на 1 базисный пункт до 11,61 % годовых.

Объем торгов корпоративными облигациями на KASE повысился относительно июня на 11,3 % или 24,2 млрд тенге до 238,0 млрд тенге. Среднедневной объем торгов составил 11,9 млрд тенге (на вторичном рынке – 3,2 млрд тенге), среднее количество сделок – 88 сделок (на вторичном рынке – 61 сделка), средний объем одной сделки – 134,8 млн тенге (на вторичном рынке – 52,7 млн тенге).

В июле 2022 года объем первичного рынка корпоративных облигаций составил 173,5 млрд тенге, что выше показателя июня 2022 года в 2,5 раза или на 105,5 млрд тенге:

- АО "Национальная компания "Қазақстан темір жолы" привлекло 118,9 млрд тенге, разместив двухлетние облигации с маржой +3,00 % к процентной ставке TONIA;
- АО "Казахстанский фонд устойчивости" привлекло 32,4 млрд тенге, разместив два выпуска облигаций с доходностью к погашению 14,73–14,78 % годовых со сроком до погашения один год;

- АО "КазАгроФинанс" привлекло 20,1 млрд тенге, разместив семилетние облигации под 16,85 % годовых;
- АО "Казахстанская Жилищная Компания" привлекло 581,9 млн тенге, разместив облигации под 0,1 % годовых и сроком до погашения 28,8 лет;
- ТОО "Микрофинансовая организация ОнлайнКазФинанс" привлекло \$2,8 млн (эквивалент 1,4 млрд тенге), разместив долларовые облигации с доходностью к погашению 9,99 % годовых и сроком до погашения 339 дней;
- ТОО "МФО "Арнур Кредит" привлекло 105,0 млн тенге, разместив двухлетние облигации под 21,0 % годовых.

В разрезе основных категорий инвесторов на первичном рынке корпоративных облигаций доля банков составила 66,5 %, брокерско-дилерских организаций – 6,2 %, других институциональных инвесторов – 12,8 %, прочих юридических лиц – 13,7 %, физических лиц – 0,8 %. Доля нерезидентов на первичном рынке корпоративных облигаций составила 15,2 %.

Объем торгов на вторичном рынке облигаций относительно июня 2022 года снизился на 55,8 % или на 81,3 млрд тенге до 64,5 млрд тенге.

В разрезе основных категорий инвесторов на вторичном рынке корпоративных облигаций доля БВУ составила менее 0,1 %, брокерско-дилерских организаций – 6,6 %, других институциональных инвесторов – 17,2 %, прочих юридических лиц – 74,5 %, физических лиц – 1,8 %. Доля нерезидентов составила 11,2 %.

ГОСУДАРСТВЕННЫЕ ЦЕННЫЕ БУМАГИ (ГЦБ)

Сумма государственного долга по номиналу, торгуемого на KASE, составила 18,9 трлн тенге (39,4 млрд USD), повысившись за июль на 1,8 % или 337,2 млрд тенге.

Суммарный объем торгов ГЦБ на KASE составил 639,8 млрд тенге и повысился относительно июня на 4,7 % или 28,6 млрд тенге. По итогам июля 2022 года средневзвешенный объем торгов составил 32,0 млрд тенге (на вторичном рынке – 4,0 млрд тенге), средневзвешенное количество сделок – 13 (на вторичном рынке – 10), средний объем одной сделки – 2,4 млрд тенге (на вторичном рынке – 0,4 млрд тенге).

Объем торгов на первичном рынке ГЦБ повысился на 8,8% или на 45,2 млрд тенге до 559,9 млрд тенге. Из них 11,9 млрд тенге привлекли акиматы двух областей (в целях финансирования мероприятий, предусмотренных в рамках реализации государственных программ). Министерство финансов привлекло 548,1 млрд тенге, разместив облигации со средневзвешенной доходностью 13,60-14,50 % годовых и сроком до погашения от 9 месяцев до 5 лет.

В разрезе основных категорий инвесторов на первичном рынке на долю банков пришлось 17,0 %, брокерско-дилерских организаций – менее 0,1 %, других институциональных инвесторов – 79,5 %, прочих юридических лиц – 3,5 %, физических лиц менее 0,1 %. Нерезиденты на первичном рынке ГЦБ участие не принимали.

Объем торгов на вторичном рынке снизился на 17,2 % или на 16,7 млрд тенге и составил 79,9 млрд тенге. Доля торгов нотами Национального Банка на вторичном рынке составила 60,7 % или 48,5 млрд тенге от общего объема торгов, доля МЕКАМ – 31,5 % или 25,2 млрд тенге, доля еврооблигаций Республики Казахстан – 5,6 % или 4,5 млрд тенге. Остальной объем, составляющий 2,2 % или 1,7 млрд тенге, пришелся на сделки с ГЦБ иностранных государств (облигации Министерства финансов США, Султаната Оман, Турецкой Республики и Австрийской Республики).

В разрезе основных категорий инвесторов на вторичном рынке на долю банков пришлось 64,9 %, брокерско-дилерских организаций – 3,1 %, других институциональных инвесторов – 2,3 %, прочих юридических лиц – 29,5 %, физических лиц – 0,1 %. Участие нерезидентов оценивается в 4,8 %.

ОБЛИГАЦИИ МЕЖДУНАРОДНЫХ ФИНАНСОВЫХ ОРГАНИЗАЦИЙ (МФО)

На конец июля в торговых списках KASE находились облигации 40 выпусков четырех международных финансовых организаций: Евразийского банка развития, Европейского банка реконструкции и развития, Международной финансовой корпорации и Азиатского банка развития.

В отчетном месяце новые бумаги МФО не включались. В июле из сектора "Ценные бумаги международных финансовых организаций" исключен один выпуск облигаций Евразийского банка развития в связи с истечением срока обращения.

В отчетном месяце весь объем торгов пришелся на вторичный рынок и составил 2,8 млрд тенге против 11,2 млрд тенге месяцем ранее, снизившись на 8,4 млрд тенге или 75,1 %. Среднедневной объем торгов составил 140,0 млн тенге, средний объем одной сделки – 96,6 млн тенге.

В разрезе основных категорий инвесторов на вторичном рынке облигаций международных финансовых организаций 19,2 % пришлось на долю банков, менее 0,1 % - на долю брокерско-дилерских организаций, 57,5 % - на долю других институциональных инвесторов, 21,5 % - на долю прочих юридических лиц, 1,8 % – на счета физических лиц. Участие нерезидентов оценивается в 0,2 %.

ПАИ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ФОНДОВ

На 01 августа 2022 года в секторе "Ценные бумаги инвестиционных фондов" находилось 20 инструментов паевых инвестиционных фондов под управлением семи управляющих компаний и шесть ETF.

В отчетном месяце объем торгов составил 778,7 млн тенге и увеличился относительно июня 2022 года в 4,2 раза или 592,7 млн тенге. В разрезе основных категорий инвесторов 49,3 % пришлось на счета физических лиц, 4,3 % – на брокерско-дилерские организации, 46,4 % – на прочие юридические лица. Доля нерезидентов составила 1,2 %.

ПРОИЗВОДНЫЕ ЦЕННЫЕ БУМАГИ

По состоянию на 01 августа 2022 года в официальном списке KASE находились глобальные депозитарные расписки (ГДР) пяти выпусков, базовыми активами которых являются простые акции АО "Национальная атомная компания "Казатомпром", АО "Народный сберегательный банк Казахстана", АО Kaspersky, АО "Казахтелеком" и АО "ForteBank".

Объем торгов в июле 2022 года составил 487,3 млн тенге и снизился относительно июня 2022 года на 22,9 % или 145,0 млн тенге. В разрезе основных категорий инвесторов 9,4 % пришлось на счета физических лиц, 11,7 % – на брокерско-дилерские организации, 62,0% - на других институциональных инвесторов и 17,0 % – на прочих юридических лиц. Доля нерезидентов составила 10,4 %.

СЧЕТА ФИЗИЧЕСКИХ ЛИЦ НА РЫНКЕ ЦЕННЫХ БУМАГ

По состоянию на 01 августа 2022 года в Центральной депозитарии числилось 383 285 лицевых счетов, открытых на 357 957 физических лиц. По итогам июля физическими лицами зарегистрировано 18 223 новых лицевых счета.

РЫНОК ИНОСТРАННЫХ ВАЛЮТ

В июле текущего года в торгах на рынке иностранных валют на KASE принимали участие 29 членов KASE.

Объем торгов на рынке иностранных валют повысился относительно июня на 12,0% до 1,5 трлн тенге. Среднедневной объем торгов увеличился с 61,6 до 75,9 млрд тенге, среднее количество сделок выросло с 264 до 320, соответственно средний объем одной сделки вырос с 233,6 до 237,3 млн тенге.

В таблице ниже 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 мая (изм. %)
USD/KZT	2 634,96 (+14,1 %)	82,8 % (+6,7 %)	5 499 (+492)	460,00 – 487,30	477,07 (+1,5 %)
RUB/KZT	17 087,48 (-38,2 %)	9,1 % (-7,2 %)	621 (+90)	7,5500 – 8,8800	7,8700 (-11,5 %)
CNY/KZT	1 628,56 (+94,8 %)	7,6 % (+3,4 %)	264 (+59)	68,7800 – 71,7000	70,7414 (+0,7 %)
EUR/KZT	0,35 (-99,4 %)	0,0 % (-1,9 %)	5 (-44)	474,60 – 474,60	474,60 (-1,9 %)
EUR/USD*	16,00 (-65,2 %)	0,5 % (-1,0 %)	6 (-2)	1,0010 – 1,03400	1,0139 (-3,9 %)

* проводились сделки исключительно с инструментами EUR/USD_TOM, EUR/USD_SPT

ДЕНЕЖНЫЙ РЫНОК

Совокупный объем торгов на рынке денег в июле составил 13,3 трлн тенге, снизившись относительно показателя июня на 41,8 %, или на 9,6 трлн тенге.

26 июля Комитетом по денежно-кредитной политике Национального Банка Республики Казахстан была повышена базовая ставка с 14,0 до 14,5 % годовых с процентным коридором +/- 1,00 п.п. Соответственно, ставка по операциям постоянного доступа по предоставлению ликвидности составила 15,5%, а по операциям постоянного доступа по изъятию ликвидности – 13,5 %.

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, остался на уровне 13,55 % годовых.

РЫНОК ОПЕРАЦИЙ РЕПО

Совокупный объем операций репо в июле составил 12,0 трлн тенге, что меньше объема июня на 7,2 трлн тенге или на 37,3 %. В средненежном выражении объем операций снизился с 871,9 до 600,9 млрд тенге, средний объем сделки – с 983,4 млн до 685,0 млн тенге, средненежное количество сделок изменилось незначительно – с 887 до 877.

Объем операций авторепо с ГЦБ составил 9 029,3 млрд тенге, или 75,1 %, авторепо с НЦБ – 2 983,0 млрд тенге, или 24,8 %, прямое репо НЦБ – 5,0 млрд тенге, или 0,04 %, прямое репо ГЦБ – 1,2 млрд тенге, или 0,01 %.

По итогам июля индикатор TONIA вырос на 10 б.п. с 13,39 до 13,49 % годовых, значение индикатора TRION – на 5 б.п. с 13,45 до 13,50 % годовых, значение индикатора TWINA, представляющего собой средневзвешенную процентную ставку по сделкам открытия репо сроком на семь рабочих дней - на 22 б.п. с 13,17 до 13,39 % годовых.

ОПЕРАЦИИ ВАЛЮТНОГО СВОПА

Совокупный объем операций валютного свопа в июле составил 1,3 трлн тенге, что ниже объемов июня на 2,4 трлн тенге или на 64,7 %. Средненежной объем операций снизился с 170,4 до 66,2 млрд тенге, средненежное количество ежедневных заключенных сделок - с 26 до 12, средний объем сделки - с 6,5 до 5,4 млрд тенге.

В инструментальной структуре 1 313,6 млрд тенге, или 99,3 % от объема торгов своп, пришлось на свопы USDKZT, 9,8 млрд тенге, или 0,7 %, – на RUBKZT. В инструментальной структуре 90,8 % от общего объема на рынке валютного свопа пришлось на операции с однодневным валютным свопом (USDKZT_0_001), 6,9 % от общего объема торгов на рынке валютного свопа пришлось на операции с двухдневным валютным свопом (USDKZT_0_002), 1,6 % от общего объема торгов с месячным валютным свопом (USDKZT_01M), 0,7 % от общего объема торгов на рынке валютного свопа пришлось на операции с однодневным валютным свопом (RUBKZT_0_001).

Доходность однодневного долларowego свопа SWAP-1D (USD) на конец июля составила 14,00% годовых и снизилась за июль на 48 б.п. Доходность двухдневного валютного свопа SWAP-2D (USD) за месяц снизилась на 171 б.п. до 14,00 % годовых.

РЫНОК ДЕРИВАТИВОВ

В июле 2022 года в данном секторе биржевого рынка к торговле были 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 июле 2022 года в данном секторе сделок заключено не было. К началу августа открытые позиции участников торгов на рынке деривативов отсутствовали.