

АО "КАЗАХСТАНСКАЯ ФОНДОВАЯ БИРЖА"

ПРЕСС-РЕЛИЗ

г. Алматы

08 ноября 2017 года

KASE представляет итоги работы биржевого рынка в октябре 2017 года

АО "Казахстанская фондовая биржа" (KASE или Биржа) информирует об основных итогах работы биржевого рынка в октябре 2017 года.

- Совокупный объем торгов на KASE в октябре вырос на 8 % относительно предыдущего месяца до 10 954,0 млрд тенге. Рост продемонстрировали рынок ценных бумаг (в 6 раз) за счет значительного роста объема торгов в секторе корпоративных облигаций (в 9 раз) и в секторе ГЦБ (в 3 раза), а также рынок денег (+4 %).
- Объем первичных размещений на рынке корпоративных облигаций вырос в 14 раз и достиг 381 млрд тенге, объем торгов на вторичном рынке вырос в 2 раза до 45,9 млрд тенге.
- Объем специализированных торгов на первичном рынке ГЦБ вырос в 24 раза до 169,1 млрд тенге.
- Процедуру листинга прошли пять выпусков облигаций и один выпуск акций.

Общий объем торгов ценными бумагами в октябре достиг 642,5 млрд тенге, что выше результата предыдущего месяца на 527,6 млрд тенге или в 6 раз. Рост показателя связан с размещением субординированных облигаций тремя банками (АО "АТФБанк", АО "Евразийский банк", АО "Цеснабанк") на общую сумму 350 млрд тенге в рамках Программы повышения финансовой устойчивости банковского сектора, реализуемой Национальным Банком Республики Казахстан.

Рынок акций

На 01 ноября 2017 года в торговых списках Биржи находились акции 129 наименований 111 эмитентов. В отчетном месяце листинг прошли простые акции АО "Exploration Production АЛМЭКС", основная деятельность которого связана с проведением геологической разведки и изысканий углеводородного сырья.

Индекс KASE

Значение Индекса KASE по итогам октября снизилось на 0,3 % до 2 043,1 пунктов. Акции, входящие в корзину Индекса KASE показали разнонаправленную динамику.

Изменение цен акций, входящих в представительский список KASE

Эмитент	Торговый код	Цена, тенге за акцию			Изменение цены, тенге	
		на 01.01.17	на 01.10.17	на 01.11.17	в октябре	в 2017 году
АО "Казахтелеком"	KZTK	14 522,97	19 099,98	19 860,00	+4,0	+36,7
АО "KEGOC"	KEGC	1 192,15	1 380,00	1 431,99	+3,8	+20,1
KAZ Minerals PLC	GB_KZMS	1 511,00	3 481,00	3 603,01	+3,5	+138,5
АО "Банк ЦентрКредит"	CCBN	168,41	158,50	162,53	+2,5	-3,5
АО "КазТрансОйл"	KZTO	1 231,00	1 325,00	1 320,35	-0,4	+7,3
АО "Разведка Добыча "КазМунайГаз"	RDGZ	15 270,00	20 480,00	20 388,35	-0,4	+33,5
АО "Народный сберегательный банк Казахстана"	HSBK	50,34	81,07	77,43	-4,5	+53,8
АО "Кселл"	KCEL	1 102,01	1 920,00	1 817,00	-5,4	+64,9

Лидером роста стали акции АО "Казхателеком", стоимость которых увеличилась на 4,0 % до 19 860 тенге за акцию. Причинами роста цены являются публикация финансовой отчетности компании за 9 месяцев 2017 года, а также повышение агентством Standard & Poor's кредитного рейтинга АО "Казхателеком" с ВВ прогноз "Позитивный" до уровня ВВ+ прогноз "Стабильный".

Наибольшее снижение цены в октябре продемонстрировали акции АО "Кселл", стоимость которых снизилась на 5,4 % до 1 817,0 тенге. Цена акций скорректировалась после бурного роста в сентябре на фоне спекуляций инвесторов о возможной покупке компании турецким телекоммуникационным гигантом Turkcell у нынешнего владельца – TeliaSonera.

Капитализация рынка акций в октябре выросла на 0,8 % или 138,3 млрд тенге до 16 748,1 млрд тенге. Рост показателя обеспечили компании секторов "Финансы" (+168,7 млрд тенге или 8,8 %), что связано с размещением 1,3 млрд простых акций АО "Казкоммерцбанк" по праву преимущественной покупки, "Материалы" (+9,1 млрд тенге или 0,5 %) и "Здравоохранение" (6,2 млрд тенге или 44,2 %).

Объем торгов акциями в октябре составил 15,2 млрд тенге и вырос относительно сентября на 3,8 млрд тенге или 32,7 %. Среднедневной объем торгов равен 0,8 млрд тенге, против 0,6 млрд тенге в предшествующем месяце. Все сделки были заключены на вторичном рынке.

В разрезе основных категорий инвесторов в октябре наиболее активными в секторе акций остаются физические лица, на счета которых приходится 46,6 % оборота акций. Доля брокеров-дилеров составила 23,1 %, доля банков второго уровня (БВУ) сложилась на уровне 0,02 %, других институциональных инвесторов – 1,6 %, прочих юридических лиц – 28,7 %. Участие нерезидентов оценивается в 16 %, из которых 12,2 % пришлось на юридических лиц, не являющихся институциональными инвесторами, 3,1 % на брокеров и 0,6 % на физических лиц.

Рынок корпоративных облигаций

На конец октября в торговых списках KASE находились облигации 269 наименований 68 эмитентов. В отчетный период листинг прошли пять выпусков долговых ценных бумаг АО "АТФБанк", АО "Евразийский банк", АО "Банк ЦентрКредит", АО "Цеснабанк" и АО "Национальная компания "Қазақстан темір жолы".

Объем торгуемого корпоративного долга в октябре вырос на 1 % и достиг 8 846,9 млрд тенге.

Суммарный объем торгов корпоративными облигациями в отчетном месяце сложился на уровне 426,9 млрд тенге и вырос относительно предыдущего месяца на 379,7 млрд тенге или в 9 раз. Среднедневной объем торгов составил 19 405,1 млн тенге, увеличившись в 8 раз относительно сентября.

Объем первичного рынка корпоративных облигаций достиг 381,0 млрд тенге, увеличившись на 353 млрд тенге или в 13,6 раз. В рамках специализированных торгов на первичном рынке корпоративных облигаций были размещены следующие выпуски:

- АО "АТФБанк", АО "Евразийский банк", АО "Цеснабанк" разместили 15-летние субординированные облигации с доходностью к погашению 4,00 % годовых на общую сумму 350 млрд тенге в рамках Программы повышения финансовой устойчивости банковского сектора, реализуемой Национальным Банком Республики Казахстан;
- ТОО "Компания Фазтон" привлекло 1,1 млрд тенге, разместив семилетние облигации с доходностью к погашению 13,49 % годовых;
- Дочерний банк АО "Хоум Кредит энд Финанс Банк" привлек 5,0 млрд тенге, разместив двухлетние облигации под 13 % годовых.

АО "Национальная компания "Қазақстан темір жолы" привлекло 25,0 млрд тенге, разместив свои облигации под 11,0 % годовых посредством подписки на них.

Объем торгов на вторичном рынке корпоративных облигаций вырос в 2,4 раза или на 26,7 млрд тенге до 45,9 млрд тенге. Более 60 % от данного объема пришлось на выкуп облигаций

АО "Казакхтелеком". Ранее компания сообщила о решении Совета директоров о досрочном выкупе 12 136 865 облигаций второго выпуска.

Значения индикаторов доходности KASE_BMY и KASE_BAY снизились за месяц на 9 б.п. до 10,17 % годовых и на 1 б.п. до 11,13 % годовых соответственно. Тренд снижения доходности корпоративных облигаций связан с достижением нижней границы коридора по базовой ставке на безрисковой кривой доходности. В конце сентября доходность семидневных нот Национального Банка достигла значения 9,2509 %, что отразилось на уровне доходности корпоративных облигаций в октябре.

В разрезе основных категорий инвесторов в секторе корпоративных облигаций 24,5 % пришлось на брокерско-дилерские компании, 1,7 % – на БВУ, 13,3 % – на других институциональных инвесторов, 56,8 % – на другие юридические лица, 3,8 % – на физические лица. Доля нерезидентов составила 3,3 % от общего объема торгов корпоративными облигациями.

Рынок государственных ценных бумаг (ГЦБ)

В октябре объем торгов на рынке ГЦБ вырос в 3 раза до 180,3 млрд тенге относительно сентября по причине увеличения первичных размещений. Объем первичного рынка составил 169,1 млрд тенге, что выше показателя сентября в 24 раза. В октябре в целях финансирования строительства жилья в рамках реализации государственных и правительственных программ Акиматы восьми областей и г. Астаны разместили свои муниципальные облигации на сумму 30,7 млрд тенге под 0,35 % годовых.

На размещения Министерством финансов казначейских облигаций трех выпусков пришлось 138,5 млрд тенге.

В структуре инвесторов при размещении ГЦБ на БВУ пришлось 8 %, на других институциональных инвесторов – 56,3 %, 35,7 % выкупили другие юридические лица.

Объем торгов на вторичном рынке снизился на 77,1 % до 11,2 млрд тенге с 48,9 млрд тенге в сентябре. На сделки с нотами Национального Банка пришлось 9,4 млрд тенге или 83,8 % от общего объема торгов вторичного рынка.

В октябре в структуре инвесторов на вторичном рынке наиболее активными участниками были БВУ, на долю которых приходится 74,9 %, на долю других институциональных инвесторов – 23,9 %, брокеров-дилеров – 1,2 %. Другие юридические, а также физические лица не принимали участие в торгах государственными ценными бумагами.

Облигации МФО

На конец отчетного периода в торговых списках Биржи находилось девять выпусков облигаций двух международных финансовых организаций – Евразийского банка развития и Европейского банка реконструкции и развития. В отчетном месяце Евразийский банк развития привлек 20,0 млрд тенге, разместив свои трехлетние облигации с доходностью к погашению 9,40 % годовых.

Счета физических лиц на рынке ценных бумаг

На конец октября в системе учета Центрального депозитария ценных бумаг числилось 108 644 лицевых счетов, открытых на физических лиц, что на 222 счета меньше, чем на конец предыдущего месяца, и на 3 325 счетов больше, чем на начало 2017 года.

Рынок иностранных валют

Объем торгов иностранными валютами в октябре составил 1,22 трлн тенге, что ниже результата предыдущего месяца на 4,4 % или 56,7 млрд тенге.

В нижеследующей таблице приводятся основные характеристики торгуемых на KASE в отчетном месяце 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, тенге за ед. валюты	Курс на конец месяца (изм. %)
USD/KZT	3 599,34 (+5,7 %)	71,6 % (+57,4 %)	11 104 (+3 823)	319,00–342,14	334,48 (-2,0 %)
EUR/KZT	2,4 (+4,4 %)	0,05 % (+4 б.п.)	15 (-1)	365,55–406,50	388,55 (-3,4 %)
RUB/KZT	1 423,9 (-93,1 %)	28,3 % (-57,7 %)	238 (-86)	5,3910–5,9600	5,7684 (-2,0 %)
CNY/KZT	4,1 (-53,2 %)	0,08 % (+4 б.п.)	33 (-39)	47,4600–52,3400	50,3000 (-1,7 %)

Рынок денег (операции репо и валютного свопа)

В течение октября ставки денежного рынка оставались на прежнем уровне, вблизи нижней границы коридора базовой ставки, сохраненной Национальным Банком 10 октября на уровне 10,25 (+/-1%). За месяц значения MM_Index и индикатора TONIA незначительно снизились на 7 и на 6 б.п. соответственно, до 9,26 % годовых. Индикатор TWINA напротив продемонстрировал рост на 3 б.п. с 9,24 до 9,27 % годовых. Сохранение ставок на денежном рынке в прежнем коридоре можно расценивать как нахождение рынка справедливой стоимости заимствования денег под залог ГЦБ и иностранной валюты. Объемы заимствований Национального Банка в октябре достигли 5 379 млрд тенге, при этом ставки привлечения варьировали от 8,72 до 9,33 % годовых.

Доходность однодневного долларowego свопа на конец октября осталась на уровне 9,27 %, доходность двухдневного свопа выросла на 7 б.п. до 9,35 % годовых. В течение последних 30 дней ставки на рынке валютного свопа колебались в коридоре 8,75 – 9,6 % годовых.

Индикатор KazPrime-3M (KZT), который представляет собой показатель стоимости денег при размещении их на депозитах межбанковского рынка среди банков, участников Соглашения о формировании данного индикатора, в течение месяца оставался неизменным.

Совокупный объем торгов за октябрь на рынке денег вырос на 4 % и достиг 9,1 трлн тенге. На долю рынка операций репо пришлось около 70 %.

Объем торгов сложился на уровне сентября – 6,5 трлн тенге, -0,4 % относительно показателя предыдущего месяца. Среднедневной объем операций равен 324,9 млрд тенге (-0,4 %).

Более 90 % от общего объема открытия репо приходится на авторепо с ГЦБ. Наиболее популярным инструментом остается репо сроком на один день, доля этого инструмента в общем объеме торгов на рынке авторепо с ГЦБ составляет 96,7 %.

Всего в сделках на рынке репо принимали участие 43 члена Биржи. Более 50 % от общего оборота торгов в данном сегменте приходится на банки второго уровня. Доля участия нерезидентов в данном секторе незначительна, и равна 0,02 %.

Объем торгов на рынке валютных свопов вырос на 17 % до 2,6 трлн тенге. Предметом операций валютного свопа являлся только доллар США. Более 90 % от общего объема торгов составляют сделки с инструментом USDKZT_0_002. Среднедневной объем операций – 129,6 млрд тенге, что на 17 % больше чем в предыдущем месяце.

Фьючерсы

В настоящий момент в данном секторе биржевого рынка к торговле доступны фьючерсы, базовыми активами которых являются доллар США, Индекс KASE, отдельные наименования акций. Всего 17 инструментов. В октябре сделок в данном сегменте заключено не было. Число открытых на KASE позиций к началу ноября составило 25 000 контрактов на сумму 8,6 млрд тенге.

Для справки

АО "Казахстанская фондовая биржа" (KASE) является ведущей фондовой биржей в Центрально-Азиатском регионе и единственной биржей в Казахстане, осуществляющей свою деятельность на финансовом рынке. Это универсальная торговая площадка для инструментов рынка репо, иностранных валют, государственных и корпоративных ценных бумаг, облигаций международных финансовых институтов, а также производных инструментов.

KASE является членом Международной федерации бирж (WFE), Федерации Евро-Азиатских фондовых бирж (FEAS) и других международных и отечественных профессиональных объединений.

В 2015 году KASE присоединилась к инициативе ООН "Устойчивые фондовый биржи". KASE занимает второе место среди бирж СНГ по объему торгов ценными бумагами, а также занимает шестое место по уровню капитализации рынка акций бирж FEAS.

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