

ПРЕСС-РЕЛИЗ

г. Алматы

09 февраля 2023 года

KASE представляет итоги работы биржевого рынка за январь 2023 года

АО "Казахстанская фондовая биржа" (далее – KASE, Биржа) информирует об основных итогах деятельности за январь 2023 года:

- Совокупный объем торгов на KASE в январе 2023 года составил 23,7 трлн тенге и снизился относительно декабря на 9,2 % или 2,4 трлн тенге.
- По итогам января значение Индекса KASE выросло на 1,5 % и составило 3 299,91 пункта.
- По итогам января капитализация рынка акций выросла на 2,5 % до 21,7 трлн тенге, объем торгуемого корпоративного долга снизился на 0,3 % до 14,4 трлн тенге.
- По состоянию на 01 февраля 2023 года в торговых списках KASE находились негосударственные ценные бумаги 579 наименований 228 эмитентов.
- По состоянию на 01 февраля 2023 года в Центральной депозитарии числилось 578 673 лицевых субсчета, открытых на 545 431 физическое лицо. По итогам января физическими лицами зарегистрировано 38 972 новых лицевых субсчета.

КЛЮЧЕВЫЕ ПРОЕКТЫ И МЕРОПРИЯТИЯ

В январе текущего года на KASE прошел первый конкурс "Green bond competition" для компаний и местных исполнительных органов, планирующих получить финансирование за счет выпуска "зеленых" облигаций.

Кроме того, в отчетном месяце Биржей проведен круглый стол с представителями Союза промышленников и предпринимателей "Ел тірегі" на тему "Привлечение финансирования на KASE". На онлайн-встрече сотрудники Биржи рассказали о KASE, инструментах Биржи по привлечению финансирования, программе финансирования МСБ и листинге на KASE.

РЫНОК АКЦИЙ

По итогам января 2023 года капитализация рынка акций составила 21,7 трлн тенге (47,2 млрд USD), что на 524,0 млрд тенге или 2,5 % выше показателя предыдущего месяца. Основная доля роста пришлась на капитализацию АО "Национальная атомная компания "Казатомпром", АО "Национальная компания "КазМунайГаз" и АО Kaspi.kz за счет повышения цены их акций.

На конец января в торговых списках KASE находились акции 113 наименований 99 эмитентов, из них акции четырех наименований четырех эмитентов допущены к обращению в секторе "Нелистинговые ценные бумаги". В январе из официального списка KASE по инициативе эмитента были исключены простые акции АО "Казбургаз".

Объем торгов акциями в январе составил 19,0 млрд тенге, снизившись относительно декабря на 90,4 % или 179,3 млрд тенге.

В отчетном месяце в рамках подписки АО "AMF Group" разместило 561 678 простых акции по цене 258,00 тенге за акцию на общую сумму 144,9 млн тенге.

На вторичном рынке объем торгов составил 18,9 млрд тенге. Среднедневной объем торгов составил 944,0 млн тенге, среднее количество сделок – 2 990, средний объем одной сделки – 315,7 тыс. тенге.

Среди основных категорий инвесторов на долю физических лиц пришлось 48,2 % от суммарного объема сделок с акциями, на долю банков – 2,4 %, на долю брокерско-дилерских организаций – 7,7 %, на долю других институциональных инвесторов – 2,7 %, на долю прочих юридических лиц – 38,9 %. Доля нерезидентов составила 32,9 %.

ИНДЕКС KASE

Значение Индекса KASE в январе выросло на 1,5 % и к концу месяца составило 3 299,91 пункта. Максимальное значение было зафиксировано 25 января – 3 334,03 пункта.

С 03 февраля 2023 года в расчет Индекса KASE включены простые акции АО "Национальная компания "КазМунайГаз". Ценные бумаги АО "Национальная компания "КазМунайГаз" закрыли январь ростом на 1 %.

Объем сделок с индексными акциями в январе 2023 года составил 3,3 млрд тенге, что на 616 млн тенге выше показателя декабря 2022 года. Наибольший объем торгов пришелся на простые акции АО "Kcell" – 1 247,7 млн тенге (38,0 % от общего объема торгов с индексными акциями).

Эмитент	Торговый код	Цена, тенге за акцию			Объем торгов, млн тенге		
		на 01.02.23	на 01.01.23	Δ, %	январь	декабрь	Δ
АО "НАК "Казатомпром"	KZAP	14 214,64	12 874,00	+10,4	828,3	474,1	+354,2
АО "Казактелеком"	KZTK	29 190,00	28 362,32	+2,9	339,7	324,9	+14,9
АО "Kcell"	KCEL	1 750,00	1 725,00	+1,4	1 247,7	444,0	+803,7
АО Kасpi.kz	KSPI	33 557,22	33 196,5	+1,1	125,3	119,4	+5,9
АО "KEGOC"	KEGC	1 622,00	1 620,02	+0,1	43,7	291,2	-247,5
АО "Банк ЦентрКредит"	CCBN	634,69	640,00	-0,8	83,5	181,2	-97,7
АО "Народный сберегательный банк Казахстана"	HSBK	122,95	126,47	-2,8	488,3	537,2	-49,0
АО "КазТрансОйл"	KZTO	710,00	734,00	-3,3	127,8	296,0	-168,2

Простые акции **АО "Национальная атомная компания "Казатомпром"** по итогам января выросли в цене на 10,4%. С начала года до 25 января цена акций последовательно росла на позитивных корпоративных новостях: 05 января компания объявила о подтверждении международных рейтингов агентствами Fitch и Moody's на уровне BBB- Стабильный и Baa2 Стабильный соответственно. Также компания сообщила о продлении Министерством энергетики контрактов недропользования двух дочерних предприятий и о завершении к 2025 году инвестиционной стадии совместного проекта с канадской урановой компании Cameco. С 27 января после объявления производственных итогов за 2022 год цена акций начала корректироваться вниз. По итогам года объем производства компании снизился на 3 % до 21,2 тыс. тонн, объем продаж снизился на 1 % до 16,4 тыс. тонн, при этом средняя цена реализации выросла на 31 % до 43,46 долларов за унцию урана. В 2023 году компания планирует оставить производство на уровне 20,5-21,5 тыс. тонн и при этом снизить объем реализации до 15,4-15,9 тыс. тонн.

На втором и третьем месте по итогам месяца расположились акции **АО "Казактелеком"** и **АО "Kcell"** с результатами +2,9 % и +1,4 % соответственно. 11 января АО "Казактелеком" объявило о том, что планирует возобновить работу по прокладке волоконно-оптической связи по дну Каспия совместно с AzerTelecom и закончить работы в течение полутора-двух лет.

Из индексных представителей финансового сектора в зеленой зоне завершить месяц смогли только простые акции **АО Kасpi.kz**, прибавившие 1,1 %. В середине месяца Михаил Ломтадзе увеличил свою долю в финтех-гиганте с 23,42% до 24,55%, также продолжается выкуп ГДР на Лондонской Фондовой Бирже: согласно отчетам, размещенным на сайте Биржи, в январе было

выкуплено 187 173 ГДР на сумму 13,7 млн долларов США. корпоративные результаты Группа объявит 27 февраля.

Наибольшим снижением завершили месяц акции **АО "КазТрансОйл"**, потерявшие в цене 3,3 %. 13 января было получено подтверждение Министерством энергетики РФ на транспортировку в первом квартале 2023 года 300 тыс. тонн казахстанской нефти по системе магистральных нефтепроводов ПАО "Транснефть" по направлению пункта сдачи нефти "Адамова застава" для дальнейшей поставки в Германию. 26 января АО "КазТрансОйл" объявило производственные итоги за 2022 год. Объем транспортировки нефти по системе магистральных нефтепроводов сократился на 1,4% до 40,7 млн тонн, при этом объем поставок на нефтеперерабатывающие заводы РК и консолидированный грузооборот, выросли на 5,5 % и 0,5 % соответственно.

СЕКТОР KASE GLOBAL

На конец января в секторе KASE Global находились акции 46 наименований и шесть ETF иностранных эмитентов.

За отчетный месяц в секторе KASE Global было заключено 4 520 сделок на общую сумму 2,0 млрд тенге. Относительно декабря объем торгов вырос на 16,8 % или на 287,3 млн тенге. Среднедневной объем торгов составил 100,0 млн тенге, среднедневное количество сделок – 226, средний объем одной сделки – 442,7 тыс. тенге.

По итогам месяца наибольший объем сделок пришелся на следующие акции:

- Apple Inc. (AAPL_KZ) – 541 сделка на общую сумму 449,4 млн тенге;
- Intel Corporation (INTC_KZ) – 535 сделок на общую сумму 201,0 млн тенге;
- Advanced Micro Devices, Inc. (AMD_KZ) – 272 сделки на общую сумму 177,3 млн тенге.

В разрезе основных категорий инвесторов 52,1 % приходится на физические лица, 17,7 % – на брокеров-дилеров, 30,2 % – на прочих юридических лиц. Доля нерезидентов составила 3,0 %.

КОРПОРАТИВНЫЕ ОБЛИГАЦИИ

Объем корпоративного долга в обращении в январе 2023 года снизился на 0,3 % или 42,0 млрд тенге до 14,4 трлн тенге (31,3 млрд USD).

На конец января 2023 года в официальном списке KASE находились корпоративные облигации 342 выпусков 82 эмитентов. За январь в официальный список KASE был включен один выпуск облигаций ТОО "МФО "Кредит Тiме". В январе из официального списка KASE были исключены пять выпусков облигаций: по одному выпуску АО "Казахстанский фонд устойчивости", АО "НАК "Казатомпром", АО "КазАгроФинанс" и АО "Kaspi Bank" в связи с истечением срока обращения и один выпуск АО "Национальная компания "Казахстан инжиниринг" по инициативе эмитента.

Значение индекса доходности корпоративных облигаций KASE_BMY в январе повысилось на 19 б.п. и на конец месяца составило 12,85 % годовых.

Объем торгов корпоративными облигациями на KASE снизился относительно декабря 2022 года на 66,3 % или на 362,8 млрд тенге до 184,3 млрд тенге. Среднедневной объем торгов составил 9,2 млрд тенге (на вторичном рынке – 1,9 млрд тенге), среднедневное количество сделок – 108 сделок (на вторичном рынке – 107 сделок), средний объем одной сделки – 85,5 млн тенге (на вторичном рынке – 18,1 млн тенге).

В январе 2023 года объем первичного рынка корпоративных облигаций составил 145,7 млрд тенге, что ниже показателя декабря на 64,4 % или на 263,6 млрд тенге. В отчетном месяце состоялись размещения трех выпусков – АО "Казахстанский фонд устойчивости" привлекло 43,9 млрд тенге, разместив облигации со средневзвешенной доходностью к погашению 18,12-18,53 % годовых и со сроком до погашения от трех до семи лет.

В разрезе основных категорий инвесторов на первичном рынке корпоративных облигаций доля брокеров-дилеров составила 0,3 %, других институциональных инвесторов – 75,7 %, прочих юридических лиц – 24,1 %. Нерезиденты на первичном рынке корпоративных облигаций участие не принимали.

Объем торгов на вторичном рынке облигаций относительно декабря 2022 года снизился на 72,0 % или на 99,3 млрд тенге до 38,6 млрд тенге.

В разрезе основных категорий инвесторов на вторичном рынке корпоративных облигаций доля брокерско-дилерских организаций составила 4,2 %, других институциональных инвесторов – 33,9 %, прочих юридических лиц – 59,8 %, доля физических лиц – 2,2 %. Доля нерезидентов составила 21,8 %.

ГОСУДАРСТВЕННЫЕ ЦЕННЫЕ БУМАГИ (ГЦБ)

Сумма государственного долга по номиналу, торгуемого на KASE, составила 21,7 трлн тенге (47,2 млрд USD), увеличившись с начала года на 0,9 % или 188,5 млрд тенге.

Суммарный объем торгов ГЦБ на KASE составил 515,6 млрд тенге и снизился по сравнению с декабрем прошлого года на 22,8 % или 152,7 млрд тенге. По итогам января 2023 года средневзвешенный объем торгов составил 25,8 млрд тенге (на вторичном рынке – 3,3 млрд тенге), средневзвешенное количество сделок – 17 (на вторичном рынке – 11), средний объем одной сделки – 1,6 млрд тенге (на вторичном рынке – 0,3 млрд тенге).

Объем торгов на первичном рынке ГЦБ снизился на 21,8 % или на 125,4 млрд тенге до 449,6 млрд тенге. Весь объем пришелся на размещение казначейских обязательств Министерства финансов Республики Казахстан. Всего было размещено 12 выпусков облигаций со средневзвешенной доходностью 11,50-16,70 % годовых (под 11,50-17,00 % годовых), разместив облигации со сроком до погашения от года до 25 лет.

В разрезе основных категорий инвесторов на первичном рынке на долю банков пришлось 66,5 %, на долю брокеров – 2,6 %, на долю других институциональных инвесторов – 20,3 %, на долю прочих юридических лиц – 10,5 %, на долю физических лиц – 0,1 %. Доля нерезидентов на первичном рынке ГЦБ составила менее 0,1%.

Объем торгов на вторичном рынке снизился на 29,3 % на 27,3 млрд тенге и составил 66,0 млрд тенге. Доля торгов нотами Национального Банка на вторичном рынке составила 54,9 % или 36,3 млрд тенге от общего объема торгов, доля МЕКАМ – 43,7 % или 28,9 млрд тенге, доля еврооблигаций Республики Казахстан – 0,2 % или 150,9 млн тенге. Остальной объем, составляющий 1,1 % или 745,9 млн тенге, пришелся на сделки с ГЦБ иностранных государств (облигации Министерства финансов США, Турции и Австрии).

В разрезе основных категорий инвесторов на вторичном рынке на долю банков пришлось 27,6 %, на долю брокеров-дилеров – 1,7 %, на долю других институциональных инвесторов – 4,4 %, на долю прочих юридических лиц – 65,7 %, на долю физических лиц – 0,6 %. Участие нерезидентов оценивается в 10,7 %.

ОБЛИГАЦИИ МЕЖДУНАРОДНЫХ ФИНАНСОВЫХ ОРГАНИЗАЦИЙ (МФО)

На конец января 2023 года в торговых списках KASE находились облигации 40 выпусков четырех международных финансовых организаций: Евразийского банка развития, Европейского банка реконструкции и развития, Евразийского банка развития, Международной финансовой корпорации и Азиатского банка развития.

За январь 2023 года в официальный список KASE был включен один выпуск зеленых облигаций Азиатского банка развития. В январе из сектора "Ценные бумаги международных финансовых организаций" исключен один выпуск облигаций Азиатского банка развития в связи с истечением срока обращения.

В январе объем торгов облигациями международных финансовых организаций по сравнению с предыдущим месяцем вырос на 67,0 % или на 3,7 млрд тенге и составил 9,1 млрд тенге. Средневзвешенный объем торгов составил 456,8 млн тенге (на вторичном рынке – 11,8 млн тенге), средневзвешенное количество сделок – одна сделка, средний объем одной сделки – 365,4 млн тенге (на вторичном рынке – 11,8 млн тенге).

На первичном рынке сектора облигаций международных финансовых организаций был размещен один выпуск Азиатского банка развития на общую сумму 8,9 млрд тенге под 16,65 % годовых.

В разрезе основных категорий инвесторов на первичном рынке доля банков составила 50,6 %, доля институциональных инвесторов – 49,4 %. Нерезиденты на первичном рынке МФО участие не принимали.

В январе 2023 года объем торгов на вторичном рынке снизился по сравнению с декабрем 2022 года на 95,7 % или на 5,2 млрд тенге и составил 235,4 млн тенге.

В разрезе основных категорий инвесторов на вторичном рынке облигаций международных финансовых организаций весь объем пришелся на счета юридических лиц.

ЦЕННЫЕ БУМАГИ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ФОНДОВ

На 01 февраля 2023 года в секторе "Ценные бумаги инвестиционных фондов" находился 21 инструмент паевых инвестиционных фондов под управлением шести управляющих компаний и шесть ETF.

В отчетном месяце объем торгов составил 302,2 млн тенге и снизился относительно декабря 2022 года на 14,2 % или на 50,1 млн тенге. В разрезе основных категорий инвесторов 40,6 % приходится на физические лица, 11,0 % – на брокеров-дилеров, 48,4 % – на прочих юридических лиц. Доля нерезидентов составила 10,8 %.

ПРОИЗВОДНЫЕ ЦЕННЫЕ БУМАГИ

По состоянию на 01 февраля 2023 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 Kaspi.kz, АО "Казахтелеком" и АО "ForteBank".

Объем торгов в январе 2023 года составил 153,2 млн тенге и снизился относительно декабря 2022 года на 87,3% или на 1,1 млрд тенге. В разрезе основных категорий инвесторов 33,4 % пришлось на долю брокерско-дилерских организаций, 56,8 % – на других институциональных инвесторов, 9,7 % – на физических лиц. Нерезиденты на торгах участие не принимали.

СЧЕТА ФИЗИЧЕСКИХ ЛИЦ НА РЫНКЕ ЦЕННЫХ БУМАГ

По состоянию на 01 февраля 2023 года в Центральной депозитарии числилось 578 673 лицевых субсчетов, открытых на 545 431 физических лиц. По итогам января физическими лицами зарегистрировано 38 972 новых лицевых субсчетов

РЫНОК ИНОСТРАННЫХ ВАЛЮТ

В январе текущего года в торгах на рынке иностранных валют на KASE принимали участие 31 член KASE.

Объем торгов в январе на рынке иностранных валют понизился относительно декабря 2022 года на 6,2 % или на 112,8 млрд тенге до 1,7 трлн тенге. Среднедневной объем торгов уменьшился с 87,0 до 85,8 млрд тенге, среднедневное количество сделок уменьшилось с 440 до 347, средний объем одной сделки повысился с 198,0 до 247,4 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 мес. (изм. %)
USD/KZT	2 411,57 (-28,9 %)	65,0 % (-21,5 %)	5 908 (-2 009)	459,20 – 467,00	460,52 (-0,5 %)
RUB/KZT*	13 478,07 (-56,5 %)	5,2 % (-6,5 %)	692 (-398)	6,3994 – 6,8900	6,5304 (+1,9 %)
CNY/KZT	298,50 (-14,4 %)	1,2 % (-0,1 %)	133 (-40)	67,4000 – 68,9800	68,1548 (+3,2 %)
EUR/KZT*	22,28 (+56,6 %)	0,6 % (+0,3 %)	73 (+30)	492,64 – 503,65	498,03 (+1,2 %)
EUR/USD**	954,05 (x436 раз)	27,9 % (+27,8 %)	128 (+120)	1,0503 – 1,0897	1,0829 (+1,9 %)

* сделки проводились преимущественно с инструментами RUBKZT_TOM и EURKZT_TOM

** сделки проводились с инструментом EURUSD_TOM

ДЕНЕЖНЫЙ РЫНОК

Совокупный объем торгов на рынке денег в январе составил 21,2 трлн тенге, понизившись относительно показателя декабря на 7,1 % или на 1,6 трлн тенге.

13 января Комитет по денежно-кредитной политике Национального Банка Республики Казахстан принял решение оставить базовую ставку на уровне 16,75 % годовых с процентным коридором +/- 1,0 п.п. Соответственно, ставка по операциям постоянного доступа по предоставлению ликвидности составила 17,75 %, а по операциям постоянного доступа по изъятию ликвидности – 15,75 %.

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, уменьшился за месяц на 169 б.п. с 17,85 % до 16,16 % годовых.

РЫНОК ОПЕРАЦИЙ РЕПО

Совокупный объем операций репо в январе составил 17,8 трлн тенге, что меньше объемов декабря на 1,4 трлн тенге или на 7,2 %. В средненежном выражении объем операций понизился с 911,5 до 888,5 млрд тенге, средненежное количество ежедневных заключенных сделок повысилось с 1 164 до 1 229, средний объем сделки понизился с 783,3 до 723,1 млн тенге.

Объем операций авторепо с ГЦБ составил 13,1 трлн тенге, или 73,8 %, авторепо с НЦБ – 4,6 трлн тенге, или 26,2 %, прямое репо ГЦБ – 130,1 млн тенге, или менее 0,1 %, прямое репо НЦБ – 3,8 млрд тенге, или менее 0,1 %.

По итогам января 2023 года индикатор TONIA снизился на 147 б.п. с 17,63 % до 16,16 % годовых, значение индикатора TRION – на 133 б.п. с 17,56 % до 16,23 % годовых, значение индикатора TWINA, представляющего собой средневзвешенную процентную ставку по сделкам открытия репо сроком на семь рабочих дней – на 108 б.п. с 17,04 % до 15,96 % годовых.

ОПЕРАЦИИ ВАЛЮТНОГО СВОПА

Совокупный объем операций валютного свопа в январе составил 3,5 трлн тенге, что ниже объема декабря на 240,5 млрд тенге или на 6,5 %. Средненежной объем операций понизился с 177,1 до 173,9 млрд тенге, средненежное количество ежедневных заключенных сделок незначительно повысилось с 24 до 25, средний объем сделки понизился с 7,4 до 7,0 млрд тенге.

В инструментальной структуре 36,1 % от общего объема на рынке валютного свопа (1 256,1 млрд тенге или 2 713,9 млн USD) пришлось на операции с однодневным валютным свопом (USDKZT_0_001), 63,1 % от общего объема торгов на рынке валютного свопа (2 196,0 млрд тенге или 4 747,9 млн USD) пришлось на операции с двухдневным валютным свопом (USDKZT_0_002), 0,8 % от общего объема торгов на рынке валютного свопа (26,5 млрд тенге или 4,0 млрд RUB) пришлось на операции с двухдневным валютным свопом (RUBKZT_0_002).

Доходность однодневного долларowego свопа SWAP-1D (USD) на конец января составила 16,18 % годовых, уменьшившись за месяц на 244 б.п. Доходность двухдневного валютного свопа SWAP-2D (USD) понизилась в январе на 196 б.п. до 16,72 % годовых.

РЫНОК ДЕРИВАТИВОВ

В настоящий момент в данном секторе биржевого рынка к торговле доступны беспоставочные фьючерсы на курс доллара США к тенге, курс российского рубля к тенге, простые акции АО "Народный сберегательный банк Казахстана", простые акции АО "НАК "Казатомпром" и Индекс KASE.

В январе 2023 года было заключено четыре сделки с фьючерсами на курс российского рубля к тенге на сумму 6,8 млрд тенге. На 01 февраля открытые позиции участников торгов на рынке деривативов составили 1 000 000 фьючерсов.

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.