

ПРЕСС-РЕЛИЗ

г. Алматы

10 декабря 2020 года

KASE представляет итоги работы биржевого рынка за ноябрь 2020 года

АО "Казахстанская фондовая биржа" (KASE, Биржа) информирует об основных итогах деятельности за ноябрь 2020 года.

- Совокупный объем торгов на KASE в ноябре 2020 года составил 10,2 трлн тенге и вырос относительно октября на 3,2 % или на 319,5 млрд тенге.
- Значение Индекса KASE выросло на 5,3 % или на 129,41 пункт до 2 586,34 пунктов.
- Капитализация рынка акций увеличилась на 2,7 % или 482,3 млрд тенге и составила 18,4 трлн тенге.
- Листинг прошли 8 эмитентов негосударственных ценных бумаг, при этом ценные бумаги 2 компаний впервые были включены в официальный список Биржи.
- По состоянию на 01 декабря 2020 года в торговых списках KASE находились негосударственные ценные бумаги 460 наименований 186 эмитентов.
- По состоянию на 01 декабря 2020 года в Центральной депозитарии числилось 129 267 лицевых счетов, открытых на физические лица, что на 1 948 счетов больше, чем месяцем ранее и на 11 572 счета больше чем на начало 2020 года.

КЛЮЧЕВЫЕ ПРОЕКТЫ И МЕРОПРИЯТИЯ

В течение ноября 2020 года KASE провела следующие мероприятия и проекты:

- С 30 ноября 2020 года Биржа ввела в эксплуатацию новую торгово-клиринговую систему ASTS+ на валютном рынке. С указанной даты торги всеми финансовыми инструментами валютного рынка, включая пять валютных пар (USDKZT, RUBKZT, CNYKZT, EURKZT, EURUSD) со сроками осуществления расчетов T+0, T+1 и T+2, операции валютного свопа в отношении доллара США, российского рубля, китайского юаня, евро с расчетами в тенге и поставочный фьючерс на курс доллара к тенге, проводятся в ASTS+.
- 30 ноября 2020 года KASE завершился конкурс розничных инвесторов на рынке акций, который направлен на популяризацию биржевой торговли акциями в Казахстане. В конкурсе приняли участие 634 инвестора, которые суммарно заключили 3 561 сделку на сумму 150 млн тенге. Победители конкурса были награждены ценными призами.
- 18 ноября 2020 года Биржа совместно с АО "NGDEM Finance" провела онлайн встречу с инвесторами о ценных бумагах инвестиционных фондов (ETF), торгуемых на KASE.
- 16 ноября 2020 года стартовали учебные торги в рамках образовательного проекта "Биржевой симулятор", организованного для студентов высших учебных заведений Казахстана и других стран. Завершится конкурс 15 декабря 2020 года.
- 12 ноября 2020 года KASE совместно с Национальной палатой предпринимателей Республики Казахстан "Атамекен" и АО "Фонд развития предпринимательства "Даму" провела онлайн круглый стол по основам фондового рынка для работников финансовых и юридических подразделений компаний.

- 09 ноября 2020 года KASE провела онлайн семинар на тему "Взаимодействие с инвесторами в новых реалиях". На семинаре были представлены ключевые аспекты раскрытия информации для повышения интереса инвесторов к компании и ключевые каналы связи с инвесторами.

РЫНОК АКЦИЙ

По итогам ноября капитализация рынка акций увеличилась на 2,7 % или на 482,3 млрд тенге и составила 18,4 трлн тенге (43,5 млрд USD).

На конец ноября в торговых списках KASE находились акции 141 наименования 125 эмитентов, из них пять выпусков допущены к обращению в секторе нелистинговые ценные бумаги. В отчетном месяце новые акции в официальный список не включались.

Объем торгов акциями в ноябре относительно октября 2020 года вырос в 3 раза или на 27,4 млрд тенге до 42,6 млрд тенге. Среднедневной объем торгов составил 2 млрд тенге, среднедневное количество сделок составило 1 063, средний объем одной сделки – 1,9 млн тенге.

Среди основных категорий инвесторов на долю физических лиц пришлось 38,1 % от суммарного объема сделок с акциями. Доля брокеров-дилеров составила – 19,6 %. На долю других институциональных инвесторов пришлось 3,3 %, прочих юридических лиц – 39,1 %. Участие нерезидентов оценивается в 15,6 %.

ИНДЕКС KASE

Индекс KASE по итогам ноября вырос на 5,3 % или на 129,41 пункт до 2 586,34 пунктов. Объем сделок с индексными акциями в ноябре (без учета специализированных торгов) составил 21,8 млрд тенге, что на 54,1 % больше показателя октября.

Изменение цен акций, входящих в представительский список Индекса KASE

| Эмитент | Торговый код | Изменение цены | | |
|--|--------------|----------------|---------------|----------|
| | | на 01.11.2020 | на 01.12.2020 | в ноябре |
| АО "КазТрансОйл" | KZTO | 800,00 | 900,10 | +12,5% |
| АО "Народный сберегательный банк Казахстана" | HSBK | 109,17 | 122,00 | +11,8% |
| KAZ Minerals PLC | GB_KZMS | 3 271,00 | 3 515,00 | +7,5% |
| АО "Казхателеком" | KZTK | 25 112,00 | 26 130,00 | +4,1% |
| АО "Казатомпром" | KZAP | 6 050,00 | 6 273,00 | +3,7% |
| АО "KEGOC" | KEGC | 1 676,59 | 1 699,00 | +1,3% |
| АО "Кселл" | KCEL | 2 720,00 | 2 730,00 | +0,4% |
| АО "Банк ЦентрКредит" | CCBN | 218,00 | 217,90 | -0,05% |

Лидерами роста среди акций представительского списка Индекса KASE по итогам отчетного месяца стали простые акции АО "КазТрансОйл", которые подорожали на 12,5 % – до 900,1 тенге. Существенная часть роста котировок нефтяной компании пришлась на вторую половину ноября.

В пользу акций КазТрансОйла сыграло подтверждение рейтинговым агентством Fitch долгосрочного рейтинга дефолта эмитента в иностранной валюте на уровне "BBB-", прогноз "Стабильный". Согласно ожиданиям агентства, компания сохранит сильный операционный и финансовый профиль. Бизнес-профиль КазТрансОйла поддерживается доминирующей позицией компании как национального оператора нефтепроводов в Казахстане, а также ее стратегической значимостью для экономики страны. Отсутствие долговой нагрузки подкрепляет ожидания агентства в отношении сильных показателей кредитоспособности.

Помимо этого, поддержку котировкам компании оказали финансовые результаты за девять месяцев 2020 года. Согласно сообщению компании, консолидированная чистая прибыль КазТрансОйла в январе–сентябре 2020 года составила 51,9 млрд тенге, что на 38 % больше показателя аналогичного периода 2019 года. Консолидированная выручка сократилась на 2 % и

составила 177 млрд тенге. Прибыль до налогообложения выросла на 29,3 % до 63,7 млрд тенге, операционная прибыль на 36,6 % – до 54,3 млрд тенге.

Высокий рост в 11,8 % показали также акции Народного банка, увеличившись в цене за месяц до 122,0 тенге за акцию.

23 ноября 2020 года рейтинговое агентство Fitch Ratings подтвердило долгосрочный рейтинг дефолта эмитента ("РДЭ") Банка на уровне "BB+", а также изменило прогноз с "Негативного" на "Стабильный". Рейтинговое агентство также подтвердило рейтинг по старшим необеспеченным долговым обязательствам Банка на уровне "BB+" (ISIN: XS0867478124, XS0867573890, XS0583796973, US46627JAB08, KZ2C00003077, KZ2C00002855, KZ2C00003069).

РЫНОК КОРПОРАТИВНЫХ ОБЛИГАЦИЙ

Объем корпоративного долга в обращении в ноябре уменьшился на 2,6 % или на 382,2 млрд тенге до 14,4 трлн тенге (34,1 млрд USD).

На конец ноября в официальном списке KASE находились 271 выпуска корпоративных облигаций 68 эмитентов. В отчетном месяце в официальный список KASE включены двенадцать выпусков корпоративных облигаций шести эмитентов (двух новых): четыре выпуска АО "Казахстанский фонд устойчивости", три выпуска АО "Национальный управляющий холдинг "Байтерек", два выпуска АО "Ипотечная организация "Казахстанская Ипотечная Компания" и по одному выпуску АО "Фонд национального благосостояния "Самрук-Қазына", АО "Фонд развития промышленности" и ПК "СПК "ДАМУ АГРО".

В отчетном месяце из официального списка исключены пять выпусков корпоративных облигаций: два выпуска международных облигаций АО "Национальная компания "КазМунайГаз" и выпуск международных облигаций АО "АТФБанк" в связи с их досрочным погашением, выпуск ТОО "ARLAN WAGONS" по инициативе их эмитента и выпуск АО "AMF Group" в связи с истечением срока обращения.

Значение индекса доходности корпоративных облигаций KASE_BMY выросло в ноябре на 6 базисных пунктов до 10,99 % годовых.

Объем торгов корпоративными облигациями на KASE снизился относительно октября на 60,8 % или на 305,3 млрд тенге до 196,7 млрд тенге. Среднедневной объем торгов составил 9,4 млрд тенге, среднедневное количество сделок – 16, средний объем одной сделки – 585,3 млн тенге.

На первичном рынке корпоративных облигаций были размещены пять выпусков облигаций трех эмитентов на общую сумму 157,3 млрд тенге:

- АО "Казахстанский фонд устойчивости" привлекло 57,3 млрд тенге, разместив три выпуска облигаций со средневзвешенной доходностью к погашению 10,87–11,09 % годовых;
- АО "Национальный управляющий холдинг "Байтерек" привлекло 50 млрд тенге, разместив десятилетние облигации KZ2C00007052 (BTRKb4) под 11,3 % годовых;
- АО "Фонд развития промышленности" привлекло 50 млрд тенге, разместив десятилетние облигации KZ2C00007011 (IDFRb2) под 11,8 % годовых.

В разрезе основных категорий инвесторов на первичном рынке корпоративных облигаций доля БВУ составила 30 %, доля брокеров-дилеров – 7,9 %. На долю других институциональных инвесторов пришлось 30,4 %, прочих юридических лиц – 31,8 %.

На вторичном рынке облигаций в ноябре объем торгов снизился на 36,3 % или 22,4 млрд тенге до 39,3 млрд тенге в сравнении с октябрём.

В разрезе основных категорий инвесторов на вторичном рынке корпоративных облигаций доля БВУ составила 11,1 %, брокеров-дилеров – 18,4 %, других институциональных инвесторов – 41 %, прочих юридических лиц – 27,7 %, доля физических лиц – 1,8 %. Доля нерезидентов составила 24,3 %.

РЫНОК ГОСУДАРСТВЕННЫХ ЦЕННЫХ БУМАГ (ГЦБ)

Номинальная стоимость торгуемого на KASE государственного долга по итогам ноября выросла на 1,9 % или 308,1 млрд тенге до 16,5 трлн тенге (39 млрд USD).

В ноябре объем торгов на рынке ГЦБ снизился на 66,6 % или на 429,3 млрд тенге до 215,7 млрд тенге. Среднедневной объем торгов сложился на уровне 10,3 млрд тенге (на вторичном рынке – 2,3 млрд тенге), среднедневное количество сделок – 6 (на вторичном рынке – 2), средний объем

одной сделки – 1,8 млрд тенге (средний объем одной сделки на вторичном рынке – 1,1 млрд тенге).

Объем первичного рынка составил 167 млрд тенге, что на 72,5 % или 441,1 млрд тенге ниже результата октября. Из них 6,2 млрд тенге привлекли акиматы двух областей в целях финансирования мероприятий, предусмотренных в рамках реализации государственной программы "Дорожная карта занятости на 2020–2021 годы". Министерство финансов привлекло 160,8 млрд тенге, это ниже показателя октября на 60,4 %. Всего в ноябре было размещено 7 выпусков облигаций со средневзвешенной доходностью 10,07–10,50 % годовых (под 10,00–10,50 % годовых).

В качестве покупателей на первичном рынке ГЦБ выступили БВУ, их доля составила 88,1 %, другие институциональные инвесторы с долей 0,7 %, прочие юридические лица с долей участия 11,2 %. Участие нерезидентов оценивается в 14,4 %.

Объем торгов на вторичном рынке по итогам ноября вырос на 31,8 % или на 11,7 млрд тенге до 48,7 млрд тенге. 80,7 % или 39,3 млрд тенге об общего оборота торгов вторичного рынка пришлось на сделки с МЕКАМ, 7,6 % или 3,7 млрд тенге – на ноты Национального Банка. Остальной объем, составляющий менее 11,7 % (5,7 млрд тенге), пришелся на сделки с еврооблигациями Республики Казахстан и с ГЦБ иностранных государств.

В структуре инвесторов на вторичном рынке на БВУ пришлось 44 %, на брокеров-дилеров – 6,1 %, на долю других институциональных инвесторов – 38,2 %, на долю прочих юридических лиц – 11,6 %, участие физических лиц не превысило 1 %. Участие нерезидентов оценивается в 1,1 %.

ОБЛИГАЦИИ МФО

На конец отчетного периода в торговых списках KASE находилось 32 выпуска облигаций четырех международных финансовых организаций: Евразийского банка развития, Европейского банка реконструкции и развития, Международной финансовой корпорации (IFC) и Азиатского банка развития.

В ноябре в сектор облигации МФО включены три выпуска облигаций: выпуск международных облигаций Европейского банка реконструкции и развития и два выпуска "зеленых" международных облигаций Азиатского банка развития.

В ноябре объем торгов составил 95,1 млрд тенге против 2,6 млрд тенге месяцем ранее.

На первичном рынке облигаций МФО были размещены три выпуска облигаций двух эмитентов на общую сумму 94 млрд тенге:

- Европейский банк реконструкции и развития привлек через подписку 80 млрд тенге, разместив четырехлетние международные облигации XS2252216937 (EBRDe12) с маржой к полугодовому купону 1 %;
- Азиатский банк развития привлек через подписку 14 млрд тенге, разместив двухлетние "зеленые" международные облигации под 10,10 % и 10,12 % годовых.

В разрезе основных категорий инвесторов на первичном рынке облигаций МФО доля БВУ составила 5,8 %, других институциональных инвесторов – 88,8 %, прочих юридических лиц – 5,4 %.

На вторичном рынке объем торгов составил 1,1 млрд тенге, что на 59,1 % или 1,5 млрд тенге ниже, чем месяцем ранее. В торгах участвовали счета юридических лиц.

ПАИ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ФОНДОВ

На 01 декабря в секторе "Ценные бумаги инвестиционных фондов" находились 13 инструментов под управлением десяти компаний.

В отчетном месяце объем торгов составил 3,1 млрд тенге и увеличился относительно октября на 12,3 % или на 340 млн тенге.

| Инструмент | Объем, млн KZT | Кол-во сделок |
|------------|----------------|---------------|
| RU_UKFFipo | 2 115,9 | 668 |
| CSECfe | 757,6 | 15 |
| IE_FXBF | 103,3 | 68 |

| Инструмент | Объем, млн KZT | Кол-во сделок |
|------------|----------------|---------------|
| CSECgm | 98,3 | 9 |
| US_SPY_ | 21,8 | 77 |
| US_BIL_ | 6,7 | 3 |
| FFIN_or | 5,5 | 53 |
| FHJlpc | 2,2 | 2 |
| FHJlq | 2,2 | 2 |
| | 3 113,4 | 897 |

В разрезе основных категорий инвесторов 43,6 % приходится на физические лица, 32,1 % – на брокеров-дилеров, 22,7 % – на прочие юридические лица и 1,6 % – на другие институциональные инвесторы.

СЧЕТА ФИЗИЧЕСКИХ ЛИЦ НА РЫНКЕ ЦЕННЫХ БУМАГ

По состоянию на 01 декабря 2020 года в Центральной депозитарии числилось 129 267 лицевых счетов, открытых на физические лица, что на 1 948 счетов больше, чем месяцем ранее и на 11 572 счета больше чем на начало 2020 года.

РЫНОК ИНОСТРАННЫХ ВАЛЮТ

В ноябре 2020 года в торгах на рынке иностранных валют на KASE принимали участие 30 членов KASE. В отчетном месяце на рынке принимали участие два брокера АО "Freedom Finance" и АО "CAIFC INVESTMENT GROUP", доля их участия в брутто обороте составила 0,1 %.

Объем торгов на рынке иностранных валют в ноябре сложился на уровне 1,04 трлн тенге, что ниже показателя предыдущего месяца на 1,7 % или 17,7 млрд тенге. Среднедневной объем торгов составил 49,4 млрд тенге, среднедневное количество сделок – 366, средний объем одной сделки – 135,1 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 | 2 344,12 (-2,4%) | 96,7 % (-0,9 %) | 7 364 (-349) | 422,60 – 434,62 | 425,07 (-1,8 %) |
| RUB/KZT | 5 054,95 (+45,6%) | 2,7 % (+0,9 %) | 228 (+84) | 5,4134 – 5,6330 | 5,5840 (+2,1 %) |
| CNY/KZT | 65,72 (-19,0%) | 0,4 % (-0,1 %) | 69 (+18) | 64,3870 – 65,7131 | 64,7473 (-0,2 %) |
| EUR/KZT | 2,68 (x3,3) | 0,1 % (0,09%) | 21 (+9) | 504,40 – 511,30 | 507,95 (+0,4 %) |

ДЕНЕЖНЫЙ РЫНОК

К концу ноября индикатор TONIA (средневзвешенная процентная ставка по сделкам открытия репо сроком на один рабочий день) увеличилась на 130 б.п. с 8,6 % до 9,9 % годовых.

Индикатор TWINA (средневзвешенная процентная ставка по сделкам открытия репо сроком на семь рабочих дней) продемонстрировал снижение на 29 б.п. с 9,32 % до 9,03 % годовых в ноябре.

С 30 ноября 2020 года прекращен расчет индикаторов рынка межбанковских депозитов KIBOR, KIBID и KIMEAN.

Значение однодневного долларового свопа SWAP-1D (USD) на конец ноября увеличилось на 212 б.п. с 7,68 % до 9,8 % годовых. Доходность двухдневного свопа SWAP-2D (USD) увеличилась на 249 б.п. с 7,51 % до 10 % годовых.

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 138 б.п. с 8,52 % до 9,90 % годовых, средневзвешенная ставка в ноябре составила 8,92 %.

С 30 ноября 2020 года прекращен расчет индикаторов рынка межбанковских депозитов KIBOR, KIBID и KIMEAN.

Рынок операций РЕПО

Объем торгов в данном сегменте составил 8,28 трлн тенге, что больше показателя прошлого месяца на 941,3 млрд тенге или на 12,8 %. Среднедневной объем операций составил 394,5 млрд тенге, среднее количество ежедневных заключенных сделок – 358, средний объем одной сделки – 1,1 млрд тенге.

Объем операций авторепо с ГЦБ составил 66 %, авторепо НЦБ – 33,9 %, прямое репо НЦБ – 0,06 %.

Рынок операций валютного свопа

Объем торгов в ноябре на рынке операции валютного свопа составил 346,8 млрд тенге, что больше на 8,2 млрд тенге или на 2,4 % объемов в октябре. Объемы операций валютного свопа в октябре на 99,7 % производились в паре тенге–доллар США, 0,03 % – EURKZT.

Среднедневной объем операций в ноябре составил 16,5 млрд тенге, среднее количество сделок – 5, средний объем одной сделки – 3,7 млрд тенге.

В инструментальной структуре 65,5 % от общего объема на рынке валютного свопа пришлось на сделки с однодневным валютным свопом (USDKZT_0_001), 28,9 % от общего объема торгов на рынке валютного свопа пришлось на сделки с двухдневным валютным свопом (USDKZT_0_002), 5,6 % от общего объема торгов на сделки одномесячного валютного свопа (USDKZT_01M), 0,03 % от общего объема торгов с однодневным валютным свопом (EURKZT_0_001).

Рынок деривативов

В секторе биржевого рынка доступны фьючерсы, базовыми активами которых являются доллар США, индекс KASE и отдельные наименования акций. К началу декабря открытые позиции участников торгов на рынке деривативов отсутствовали, операции в ноябре не производились.

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, обладает современными технологиями и оказывает полный спектр торговых и пост-торговых услуг в соответствии с принятыми международными стандартами.

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".

KASE активно содействует экономическому росту Казахстана путем обеспечения прозрачной инвестиционной среды для локальных и зарубежных участников.

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