

ПРЕСС-РЕЛИЗ

г. Алматы

11 марта 2021 года

KASE представляет итоги работы биржевого рынка за февраль 2021 года

АО "Казахстанская фондовая биржа" (KASE, Биржа) информирует об основных итогах деятельности за февраль 2021 года.

- Совокупный объем торгов на KASE в феврале 2021 года составил 12,9 трлн тенге и вырос относительно января на 14,4 % или 1,6 трлн тенге.
- Значение Индекса KASE выросло на 5,6 % и составило 2 957,76 пунктов.
- Капитализация рынка акций выросла на 5,2 % или 1 трлн тенге до 20,8 трлн тенге.
- Процедуру листинга прошел один новый эмитент.
- По состоянию на 01 марта 2021 года в торговых списках KASE находились негосударственные ценные бумаги 470 наименований 186 эмитентов.
- По состоянию на 01 марта 2021 года в Центральной депозитарии числилось 140 664 лицевых счетов, открытых на физические лица, что на 3 979 счетов больше, чем месяцем ранее и на 7 803 счета больше, чем на начало 2021 года.

КЛЮЧЕВЫЕ ПРОЕКТЫ И МЕРОПРИЯТИЯ

17 февраля 2021 года KASE провела ежегодное награждение по итогам 2020 года: членов Биржи, продемонстрировавших наилучшие результаты, листинговых компаний – за стремление к прозрачности, а также представителей средств массовой информации (СМИ) – за активное освещение фондового рынка в печатных СМИ и интернет-ресурсах.

В феврале KASE проводила в рамках проекта "День эмитента" встречи руководства акимата г. Шымкент, Азиатского Банка Развития и ТОО "1Fit" с инвесторами, профессиональными участниками рынка ценных бумаг и представителями СМИ, посвященные выпуску ценных бумаг.

РЫНОК АКЦИЙ

По итогам февраля капитализация рынка акций увеличилась на 5,2 % или на 1 трлн тенге и составила 20,8 трлн тенге (50,2 млрд USD).

На конец февраля в торговых списках KASE находились акции 139 наименований 123 эмитентов, из них акции трех наименований допущены к обращению в секторе "нелистинговые ценные бумаги".

В отчетном месяце в официальный список KASE были включены простые акции нового эмитента АО "Жалтырбулак". Из официального списка Биржи были исключены простые акции АО "Fincraft Capital" (JSCP) по инициативе их эмитента.

Объем торгов акциями в феврале относительно января снизился на 34,9 % или на 7,1 млрд тенге до 13,3 млрд тенге. Среднедневной объем торгов составил 666,3 млн тенге, среднедневное количество сделок – 1 316, средний объем одной сделки – 506,2 тыс. тенге.

Среди основных категорий инвесторов на долю физических лиц пришлось 42,5 % от суммарного объема сделок с акциями. Доля брокеров-дилеров составила – 24,1 %, на долю других институциональных инвесторов пришлось 4,9 %, прочих юридических лиц – 28,5 %. Участие нерезидентов оценивается в 3,9 %.

ИНДЕКС KASE

Индекс KASE по итогам февраля вырос на 5,6 % или 157,84 пункта до 2 957,76 пунктов. В феврале Индекс KASE впервые с середины 2007 года обновил исторический максимум и в течение месяца достигал значения 3 000,45.

Объем сделок с индексными акциями в феврале составил 5,8 млрд тенге. Наибольший объем торгов пришелся на простые акции АО "Казактелеком" – 2,4 млрд тенге (41,7 % от общего объема торгов с индексными акциями).

Изменение цен акций, входящих в представительский список KASE

Эмитент	Торговый код	Изменение цены		
		на 01.02.2021	на 01.03.2021	в феврале
АО "Казатомпром"	KZAP	7 499,99	9 289,00	+23,9 %
KAZ Minerals PLC	GB_KZMS	4 100,00	4 800,00	+17,1 %
АО "Казактелеком"	KZTK	26 015,07	26 999,00	+3,8 %
АО "Народный сберегательный банк Казахстана"	HSBK	134,00	138,00	+3,0 %
АО "КазТрансОйл"	KZTO	996,00	1 023,97	+2,8 %
АО "Банк ЦентрКредит"	CCBN	210,00	214,00	+1,9 %
АО "KEGOC"	KEGC	1 690,00	1 679,99	-0,6 %
АО "Кселл"	KCEL	2 839,90	2 456,00	-13,5 %

Лидерами роста стали простые акции АО "Казатомпром", их цена выросла на 23,9 % до 9 289 тенге за акцию. Основным фактором, поддерживающим динамику роста, стало ожидание рынка по снижению мирового предложения урана, вызванное, с одной стороны, заявлением канадской горнорудной компании Cameco о приостановлении на неопределенный срок повторного ввода в эксплуатацию Cigar Lake, – крупнейшего уранового рудника в мире, и с другой стороны, завершение деятельности одного из старейших в мире урановых рудников Ranger в Австралии. Одновременно рынок отыгрывал ожидание роста мирового спроса на урановую руду за счет подключения к сети новых атомных энергоблоков в Китае, России и Белоруссии.

ГДР компании, торгуемые на Лондонской фондовой бирже (LSE), за отчетный период выросли на 26,2 % до \$21,70, что эквивалентно 9 000,51 тенге за акцию по официальному курсу Нацбанка на 26 февраля. Между тем, на фоне опасений по возможному переизбытку предложения урана, цены на урановый фьючерс на NYMEX показывают отрицательный тренд и торгуются по цене \$29 за фунт, что ниже четырехлетнего максимума – \$34 за фунт, наблюдавшегося в мае 2020 года.

Цена на акции еще одного представителя добывающего сектора – медного холдинга KAZ Minerals PLC, за отчетный месяц поднялась на 17,1 % до 4 800 тенге за акцию, продолжая стабильный восходящий тренд, наблюдаемый с марта 2020 года. Главным драйвером роста стало увеличение цены на медь на Лондонской бирже металлов (LME), которая впервые с августа 2011 года превысила \$4,3 за фунт. В свою очередь, поддержкой цен на цветной металл послужил дефицит поставок меди из-за ограничений, введенных в связи с пандемией, а также стимулирующие меры правительств и центробанков. Согласно последним данным International Copper Study Group, в январе-октябре 2020 года дефицит меди в мире составлял около 480 тыс. тонн, при этом производство увеличилось на 1,5 %, а потребление – на 2 % относительно того же периода годом ранее. Кроме того, прогноз объемов производства от 25 крупнейших производителей меди указывает на то, что в этом году рынок может испытать значительный дефицит, сообщает Trading Economics.

В конце февраля компания предоставила производственный отчет за четвертый квартал 2020 года, согласно которому в 2020 году объем производства меди на 2 % превысил плановый диапазон – 305,7 тыс. тонн. При этом по сравнению с 2019 годом наблюдается одновременно

снижение объема производства на 1,8 % и снижение объем реализации на 5,5 % из-за задержек отгрузки на казахстанско-китайской границе в конце года. Одновременно с производственным отчетом, KAZ Minerals предоставила неаудированные результаты деятельности за 2020 год, согласно которым показатель EBITDA за отчетный период вырос на 5,6 % – до \$1,431 млрд. Кроме того, чистая задолженность группы снизилась на 5,7 % до \$2,601 млрд благодаря высокому денежному потоку от операционной деятельности во втором полугодии и более низкому, чем ожидалось, уровню капитальных затрат за весь год – \$584 млн. Компания также отметила, что некоторые проекты, которые планировалось реализовать в 2020 году, были отложены до 2021 года из-за COVID-19.

Наибольшее снижение цен наблюдалось на простые акции АО "Кселл", которые потеряли в цене за первую неделю февраля 13,4 %, несмотря на выход оптимистичной финансовой отчетности за 2020 год, согласно которому чистая прибыль в 2020 году в 1,8 раза превысила значение 2019 года. Чистый объем продаж вырос на 11,5 % и составил 174,7 млрд тенге, при этом численность абонентской базы сократилась на 2,7 % до 8,055 млн абонентов. Продажи мобильных телефонов выросли в 2020 году на 81,4 % по сравнению с 2019 годом, при этом в IV квартале рост составил 75,5 %. Компания отмечает, что дополнительным стимулом роста продаж мобильных телефонов в IV квартале стал выпуск iPhone 12, что привело к увеличению общей доли Kcell на рынке мобильных телефонов. Доход от услуг увеличился на 1,8 % до 140,1 млрд тенге.

24 февраля Kcell сообщила о внеочередном общем собрании акционеров, запланированном на 09 апреля, в рамках которого планируется утвердить планы делистинга ценных бумаг компании с Лондонской фондовой биржи и AIX. В случае положительного решения, акции мобильного оператора останутся только на Казахстанской фондовой биржи. В заявлении компании указано, что уменьшение количества рынков, на которых торгуются ценные бумаги, приведет к улучшению уровня ликвидности и торговых тенденций движения соответствующих инструментов.

РЫНОК КОРПОРАТИВНЫХ ОБЛИГАЦИЙ

Объем корпоративного долга в обращении в феврале снизился на 0,8 % или 110 млрд тенге до 14,4 трлн тенге.

На конец февраля в официальном списке KASE находились 275 выпусков корпоративных облигаций 70 эмитентов. Из официального списка KASE были исключены четыре выпуска корпоративных облигаций: два выпуска АО "Казахстанская Жилищная Компания" и выпуск ТОО "Амангельды Газ" – в связи с их аннулированием, выпуск международных облигаций ТОО "Исткомтранс" – в связи с их досрочным погашением. В отчетном месяце новые выпуски облигаций в официальный список Биржи не включались.

Значение индекса доходности корпоративных облигаций KASE_BMY снизилось на 7 базисных пунктов до 10,77 % годовых.

Объем торгов корпоративными облигациями на KASE снизился относительно января на 31,8 % или 74,7 млрд тенге до 160,1 млрд тенге. Среднедневной объем торгов составил 8 млрд тенге (на вторичном рынке – 3,9 млрд тенге), среднедневное количество сделок – 16 сделок (на вторичном рынке – 14 сделок), средний объем одной сделки – 505 млн тенге (на вторичном рынке – 278,3 млн тенге).

В феврале на первичном рынке в секторе корпоративных облигаций были размещены шесть выпусков облигаций четырех эмитентов на общую сумму 82,2 млрд тенге, что на 16,7 % или 11,7 млрд тенге выше показателя января:

- АО "Казахстанский фонд устойчивости" привлекло 62,9 млрд тенге, разместив три выпуска облигаций (KFUSb8, KFUSb9, KFUSb10) с доходностью к погашению 10,00–10,60 % годовых (средневзвешенная доходность по выпускам варьировала в диапазоне 10,12–10,57 % годовых);
- АО "Казахстанская Жилищная Компания" привлекло 14,3 млрд тенге, разместив пятилетние облигации с доходностью к погашению 11 % годовых;

- АО "Аграрная кредитная корпорация" привлекло 4,6 млрд тенге, разместив облигации со средневзвешенной доходностью 10,23% годовых и сроком до погашения 295 дней;
- ТОО "Микрофинансовая организация "R-Finance" привлекло на KASE 400,7 млн тенге, разместив трехлетние облигации с доходностью к погашению 20 % годовых.

В разрезе основных категорий инвесторов на первичном рынке корпоративных облигаций доля БВУ составила 44,9 %, брокерско-дилерских организаций – 6,9 %, других институциональных инвесторов – 10,8 %, прочих юридических лиц – 36,9 %, физических лиц – 0,5 %.

Объем торгов на вторичном рынке облигаций снизился на 52,6 % или 86,5 млрд тенге до 77,9 млрд тенге.

В разрезе основных категорий инвесторов на вторичном рынке корпоративных облигаций доля БВУ составила 7,7 %, брокерско-дилерских организаций – 1 %, других институциональных инвесторов – 86,3 %, прочих юридических лиц – 3,9 %, доля физических лиц – 1,2 %. Доля нерезидентов составила 2,1 %.

РЫНОК ГОСУДАРСТВЕННЫХ ЦЕННЫХ БУМАГ (ГЦБ)

Номинальная стоимость торгуемого на KASE государственного долга по итогам февраля выросла на 3,1 % или 541,6 млрд тенге до 17,9 трлн тенге (43,1 млрд USD).

В феврале объем торгов на рынке ГЦБ снизился на 12,7 % или 43,4 млрд тенге до 299 млрд тенге. Среднедневной объем торгов составил 14,9 млрд тенге (на вторичном рынке – 3 млрд тенге), среднедневное количество сделок – 11 (на вторичном рынке – 5 сделок), средний объем одной сделки – 1,4 млрд тенге (на вторичном рынке – 587 млн тенге).

На первичном рынке ГЦБ объем торгов составил 238,5 млрд тенге, что ниже показателя января на 13 % или 35,8 млрд тенге. Весь объем пришелся на размещение казначейских обязательств Министерства финансов Республики Казахстан. Всего было проведено одиннадцать размещений под 8,99–10,12 % годовых (средневзвешенная доходность – 9,11–10,12 % годовых).

В структуре инвесторов на первичном рынке ГЦБ на долю БВУ пришлось 73,8 %, на долю брокерско-дилерских организаций – менее 0,1 %, на долю других институциональных инвесторов – 10,4 %, доля прочих юридических лиц составила 15,8 %. Участие нерезидентов оценивается в 5,1 %.

Объем торгов на вторичном рынке снизился на 11,2 % или 7,6 млрд тенге до 60,5 млрд тенге. 55,9 % или 33,8 млрд тенге об общего оборота торгов вторичного рынка пришлось на сделки с нотами Национального Банка, 40,3 % или 24,4 млрд тенге – на сделки с МЕКАМ. Остальной объем, составляющий 3,8 % (2,3 млрд тенге), пришелся на сделки с еврооблигациями Республики Казахстан и с ГЦБ иностранных государств.

В структуре инвесторов на вторичном рынке на долю БВУ пришлось 49,4 %, на долю брокерско-дилерских организаций – 3,2 %, на долю других институциональных инвесторов – 33,3 %, доля прочих юридических лиц составила 13,7 %, доля физических лиц – 0,3 %. Участие нерезидентов оценивается в 0,5 %.

ОБЛИГАЦИИ МЕЖДУНАРОДНЫХ ФИНАНСОВЫХ ОРГАНИЗАЦИЙ

На конец отчетного периода в торговых списках KASE находилось 35 выпусков облигаций четырех международных финансовых организаций: Евразийского банка развития, Европейского банка реконструкции и развития, Международной финансовой корпорации (IFC) и Азиатского банка развития.

В феврале в сектор "Ценные бумаги международных финансовых организаций" официального списка KASE включены два выпуска облигаций Азиатского банка развития, целевым назначением которых является инвестирование проектов, нацеленных на снижение гендерного неравенства и содействие расширению прав и возможностей женщин и девочек.

В течение февраля из официального списка KASE в связи с истечением срока обращения был исключен выпуск облигаций Международной финансовой корпорации.

Объем торгов в секторе "Ценные бумаги международных финансовых организаций" составил 17,4 млрд тенге. Весь объем пришелся на размещения Азиатского банка развития, который в рамках подписки разместил два выпуска своих облигаций под 9,95 % и 10,15 % годовых со сроком до погашения 5,1 лет и 9,8 лет соответственно.

В разрезе основных категорий инвесторов на первичном рынке облигаций международных финансовых организаций доля БВУ составила 13 %, других институциональных инвесторов – 50,3 %, прочих юридических лиц – 36,7 %.

ПАИ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ФОНДОВ

На 01 марта в секторе "Ценные бумаги инвестиционных фондов" находились 17 инструментов под управлением десяти компаний.

В отчетном месяце объем торгов составил 7,6 млрд тенге и вырос относительно января на 39,8 % или 2,2 млрд тенге.

Инструмент	Объем, млн KZT	Кол-во сделок
RU_UKFFipo	7 164,3	1 465
BCClrb	109,8	2
CSECfe	83,6	5
CSECgm	69,0	7
FFIN_or	49,7	68
FHJlag	46,9	6
US_SPY_	20,2	78
US_BIL_	18,2	4
FHJlpc	9,5	4
IE_FXBF	3,4	203
FHJlds	0,7	31
FHJlhm	0,5	18
	7 575,7	1 891

В разрезе основных категорий инвесторов 50,4 % приходится на физические лица, 44,2 % – на брокерско-дилерские организации и 5,5 % – на прочих юридических лиц.

СЧЕТА ФИЗИЧЕСКИХ ЛИЦ НА РЫНКЕ ЦЕННЫХ БУМАГ

По состоянию на 01 марта 2021 года в Центральной депозитарии числилось 140 664 лицевых счетов, открытых на физические лица, что на 3 979 счетов больше, чем месяцем ранее и на 7 803 счета больше чем на начало 2021 года.

РЫНОК ИНОСТРАННЫХ ВАЛЮТ

В феврале 2021 года в торгах на рынке иностранных валют на KASE принимали участие 29 членов KASE. В отчетном месяце на рынке принимали участие три брокера АО "Казпочта", АО "Freedom Finance" и АО "CAIFC INVESTMENT GROUP", доля их участия в брутто-обороте торгов составила 0,2 %.

Объем торгов на рынке иностранных валют достиг 990,8 млрд тенге, что выше показателя января на 3,8 % или 36,7 млрд тенге. Среднедневной объем торгов в феврале составил 49,5 млрд тенге, среднедневное количество сделок – 360, средний объем одной сделки – 137,7 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	2 319,1 (+4,2 %)	97,9 (-0,1 %)	6 815 (-181)	414,81 – 424,32	417,09 (-1,7 %)
RUB/KZT	1 006,8 (-32,9 %)	0,6 (-0,3 %)	210 (+48)	5,5685 – 5,6819	5,6039 (+0,1%)
CNY/KZT	104,6 (+1,2 %)	0,7 (-0,02 %)	140 (+62)	64,2531 – 65,6606	64,3038 (-1,9 %)
EUR/KZT	16,3 (x 2,4)	0,8 (+0,5 %)	28 (+7)	504,15 – 514,10	504,70 (-1,3 %)

ДЕНЕЖНЫЙ РЫНОК

Совокупный объем торгов на рынке денег составил 11,5 трлн тенге, увеличившись относительно показателя прошлого месяца на 17,4 % или на 1,7 трлн тенге.

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 151 б.п. с 8,24 % до 9,75 % годовых.

Рынок операций РЕПО

Объем торгов в данном сегменте в феврале 2021 года составил 10,2 трлн тенге, что больше объема прошлого месяца на 1,7 трлн тенге или на 19,5 %. Среднедневной объем операций составил 508,9 млрд тенге, среднее количество сделок – 424, средний объем одной сделки – 1,2 млрд тенге.

Объем операций авторепо с ГЦБ составил 6,3 трлн тенге или 61,8 % от общего объема операций репо, авторепо с НЦБ – 3,9 трлн тенге или 38,1 %, прямое репо с НЦБ – 6,6 млрд тенге или 0,07 %, прямое репо с ГЦБ – 6 млн тенге.

К концу февраля индикатор TONIA (средневзвешенная процентная ставка по сделкам открытия репо сроком на один рабочий день, заключенным на Бирже в секторе автоматического репо с ценными бумагами Корзины ГЦБ) вырос на 169 б.п. с 8,25 % до 9,94 % годовых.

Индикатор TRION (средневзвешенная процентная ставка по сделкам открытия репо сроком на один рабочий день, заключенным на Бирже в течение дня в секторе автоматического репо с ценными бумагами Корзины ГЦБ, по которым Биржа осуществляет клиринговую деятельность использованием услуг Центрального контрагента) увеличился на 168 б.п. с 8,26 % до 9,94 % годовых.

Индикатор TWINA (средневзвешенная процентная ставка по сделкам открытия репо сроком на семь рабочих дней, заключенным на Бирже в секторе автоматического репо с ценными бумагами Корзины ГЦБ, по которым Биржа осуществляет клиринговую деятельность использованием услуг Центрального контрагента) увеличился на 105 б.п. с 8,35 % до 9,40 % годовых в феврале.

Волатильность индикаторов операций репо TONIA, TRION и TWINA в феврале динамично колебалась в рамках коридора базовой ставки Национального банка Республики Казахстан, в дальнейшем увеличивались с началом налоговой недели с понижательным трендом к концу месяца.

Рынок операций валютного свопа

Объем торгов в феврале 2021 года на рынке операций валютного свопа составил 1,3 трлн тенге, что выше на 41,2 млрд тенге или на 3,3 % объема торгов в январе.

Среднедневной объем операций в феврале составил 63,6 млрд тенге, среднее количество сделок – 12, средний объем одной сделки – 5,5 млрд тенге.

В инструментальной структуре 54,9 % от общего объема на рынке валютного свопа пришлось на сделки с однодневным валютным свопом (USDKZT_0_001), 42,2 % от общего объема торгов на рынке валютного свопа пришлось на сделки с двухдневным валютным свопом (USDKZT_0_002), 3 % от общего объема торгов с месячным валютным свопом (USDKZT_0_01M).

Индикатор однодневного долларowego свопа SWAP-1D (USD) к концу февраля увеличился на 35 б.п. с 7,93 % до 8,28 % годовых. Доходность двухдневного валютного свопа SWAP-2D (USD) увеличился на 78 б.п. с 7,95 % до 8,73 % годовых.

Рынок деривативов

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