



ПРЕСС-РЕЛИЗ

г. Алматы

13 февраля 2019 года

KASE представляет итоги работы биржевого рынка в январе 2019 года

АО "Казахстанская фондовая биржа" (KASE, Биржа) представляет итоги работы биржевого рынка в январе 2019 года.

- Совокупный объем торгов на KASE в январе 2019 года составил 10 534,1 млрд тенге и вырос относительно предыдущего месяца на 10,4 % или 993,3 млрд тенге. Положительную динамику обеспечил рынок денег, рост объема на котором составил 16,7 %.
- Капитализация рынка акций выросла на 0,4 % до 15,6 трлн тенге.
- По итогам января значение Индекса KASE снизилось на 1,2 % до 2 278,33 пункта.
- Объем корпоративного долга в обращении вырос на 1,7 %, достигнув отметки 11 трлн тенге.
- Объем первичных размещений на рынке корпоративных облигаций составил 6 млрд тенге.
- Азиатский банк развития привлек 30,5 млрд тенге, разместив семилетние и пятилетние облигации с маржой 1,3 % и 1 % годовых над уровнем инфляции соответственно.
- На 01 февраля 2019 года в Центральной депозитарии числилось 117 682 лицевых счета, открытых физическим лицами, что на 858 счетов больше, чем на конец предыдущего месяца.

РЫНОК АКЦИЙ

На конец месяца в торговых списках Биржи находились акции 129 наименований 113 эмитентов, из них три выпуска допущены к обращению в секторе нелистинговые ценные бумаги. С 09 января из официального списка KASE исключены привилегированные акции АО Kaspi.kz в связи с их обменом на простые акции.

Капитализация рынка акций KASE в январе выросла на 0,4 % или 64 млрд тенге до 15,6 трлн тенге.

Индекс KASE прервал трехмесячный рост, начав год со снижения на 1,2 % или на 26,6 пунктов до 2 278,33 пунктов. Три наименования акций представительского списка оказались в красной зоне, два продемонстрировали двузначное в процентном выражении изменение цены.

Изменение цен акций, входящих в представительский список KASE

Эмитент	Торговый код	Изменение цены		
		на 01.01.2019	на 01.02.2019	в январе
KAZ Minerals PLC	GB_KZMS	2 530,00	2 899,50	14,60%
АО "КазТрансОйл"	KZTO	1 342,00	1 405,50	+4,73%
АО "Банк ЦентрКредит"	CCBN	234,21	241,99	+3,32%
АО "KEGOC"	KEGC	1 600,64	1 611,59	+0,68%
АО "Народный сберегательный банк Казахстана"	HSBK	100,41	99,91	-0,50%
АО "Кселл"	KCEL	1 850,00	1 824,60	-1,37%
АО "Казахтелеком"	KZTK	33 499,00	25 000,00	-25,37%

Лидером роста стали долевыми инструментами KAZ Minerals PLC, которые выросли в цене на 14,6 % до 2 899,5 тенге за акцию. При этом основной рост пришелся на последние четыре торговых дня месяца, котировки акций прибавили 13,6 %. Такому росту предшествовали публикация производственного отчета компании за 2018 год и сложившийся положительный макроэкономический фон. Согласно пресс-релизу от 24 января производство меди Группой KAZ Minerals по итогам 2018 года выросло за год на 14 % до 294,7 тыс. тонн, что соответствует верхней границе запланированного годового диапазона 270-300 тыс. тонн. Рост медного производства обусловлен высокими результатами Актогайского ГОКа. В то же время котировки меди на Лондонской бирже металлов выросли с 25 января на 4,4 % до 6 146 тыс. долларов США за тонну к концу отчетного месяца. 22 января KAZ Minerals сообщила о первоначальном завершении сделки по приобретению медного проекта Баимская после получения регуляторных согласований и удовлетворения других отлагательных условий в соответствии с соглашением, о котором компания сообщала 02 августа 2018 года.

Наибольшее падение продемонстрировали простые акции АО "Казахтелеком", которые потеряли более четверти своей цены и стали главной причиной падения Индекса KASE по итогам января. Котировки простых акций национальной телекоммуникационной компании отошли от своих более чем 10-летних максимумов, снизившись на 25,4 % до 25 000 тенге, что является минимальным значением с 06 марта 2018 года. Падение цены акций компании началось в середине января на фоне разбирательств с ее миноритарными акционерами.

Объем торгов акциями в январе 2019 года относительно декабря 2018 года вырос на 17 % или 1,6 млрд тенге до 11,4 млрд тенге. Среднедневной объем торгов составил 568,4 млн тенге. Среднедневное количество сделок составило 389, средний объем одной сделки – 1,5 млн тенге.

31 января 2019 года АО "Разведка Добыча "КазМунайГаз" завершила программу обратного выкупа привилегированных акций RDGZp. В отчетном месяце было выкуплено 70 757 акций по 12 800 тенге за акцию на сумму 905,7 млн тенге. Всего в рамках программы обратного выкупа АО "Разведка Добыча "КазМунайГаз" выкупило на KASE 1 194 462 акций на сумму 15,3 млрд тенге.

В разрезе основных категорий инвесторов наиболее активными были физические лица, на счета которых пришлось 42,2 % от суммарного объема сделок с акциями. Доля брокеров-дилеров составила 31,9 %, доля других институциональных инвесторов – 7,1 %, доля прочих юридических лиц достигла 18,8 %. Банки второго уровня (БВУ) в торгах акциями участия не принимали. Доля нерезидентов оценивается в 25,4 %.

РЫНОК КОРПОРАТИВНЫХ ОБЛИГАЦИЙ

Объем корпоративного долга в обращении вырос на 1,7 %, достигнув отметки 11 трлн тенге.

На 01 февраля 2019 года в официальном списке KASE находились 247 выпусков облигаций 62 эмитентов. В январе в официальный список KASE были включены облигации АО "Нурбанк" и АО "Фонд проблемных кредитов", исключены – два выпуска облигаций: АО "Фридом Финанс" и АО "Евразийский банк" в связи с истечением срока обращения.

Индекс доходности корпоративных облигаций основной площадки KASE_BMY в январе снизился на 13 б.п. и составил 11,01 % годовых.

Объем торгов корпоративными облигациями сложился в отчетном месяце на уровне 220,4 млрд тенге и снизился относительно предыдущего месяца на 33,5 % раза или на 111 млрд тенге, за счет снижения размещений на первичном рынке на 97,9 %, при этом объем торгов на вторичном рынке вырос в 5 раз. Среднедневной объем торгов составил 11 млрд тенге. Среднедневное количество сделок – 16, средний объем одной сделки – 678,1 млн тенге.

В течение месяца состоялось три размещения облигаций на общую сумму 6 млрд тенге:

- Дочерний Банк АО "Сбербанк России" привлек 812 млн тенге, разместив облигации со сроком до погашения 2,9 года под 11 % годовых;
- ТОО "Компания Фаэтон" привлекло 130,2 млн тенге, разместив облигации со сроком до погашения 6,5 лет под 10,9991 % годовых;
- АО "Ипотечная организация "Баспана" привлекло 5 млрд тенге, разместив облигации сроком до одного года под 9,7499 % годовых.

В разрезе основных категорий инвесторов на первичном рынке корпоративных облигаций доля БВУ составила 45,8 %, доля брокеров-дилеров – 0,5 %, других институциональных инвесторов – 38,9 %, прочих юридических лиц – 14,8 %.

Объем торгов на вторичном рынке составил 214,4 млрд тенге, что значительно превышает результат предыдущего месяца – 46,0 млрд тенге.

В разрезе основных категорий инвесторов на вторичном рынке корпоративных облигаций доля БВУ составила 48,3 %, брокеров-дилеров – 0,7 %, других институциональных инвесторов – 4,7 %, прочих юридических лиц – 45,4 %, доля физических лиц – 0,8 %. Участие нерезидентов оценивается в 2,9 %.

РЫНОК ГОСУДАРСТВЕННЫХ ЦЕННЫХ БУМАГ (ГЦБ)

Сумма государственного долга, торгуемого на KASE, в номинальном выражении составила 11,6 трлн тенге, увеличившись с начала года на 285,9 млрд тенге или 2,5 %.

Совокупный объем торгов ГЦБ на KASE достиг в январе 139,6 млрд тенге, что выше результата предыдущего месяца на 14,1 % или на 17,2 млрд тенге. Среднедневной объем торгов составил 7 млрд тенге. Среднедневное количество сделок составило 3, средний объем одной сделки 2,5 млрд тенге.

Объем торгов на первичном рынке вырос на 26,7 % до отметки 115,9 млрд тенге. Министерство финансов разместило на рынке четыре выпуска долгосрочных облигаций под 8,6–8,82 % годовых.

Объем вторичного рынка ГЦБ снизился на 23,1 % или 7,1 млрд тенге, до 23,8 млрд тенге. 95,8 % торгового оборота вторичного рынка пришлось на ноты Национального Банка, на долю еврооблигаций и облигаций Министерства финансов относится 1,1 % и 3,4 % соответственно.

В разрезе основных категорий инвесторов на вторичном рынке ГЦБ 70,9 % брутто-оборота пришлось на БВУ, 2,1 % – на брокеров-дилеров, 22,6 % – на других институциональных инвесторов, 3,8 % – на прочих юридических лиц и 0,6 % освоили физические лица. Доля нерезидентов составила 1,6 %.

ОБЛИГАЦИИ МФО

На конец отчетного периода в торговых списках находилось 16 выпусков облигаций четырех международных финансовых организаций. В январе совокупный объем торгов данными инструментами достиг 30,6 млрд тенге.

В течение месяца Азиатский банк развития привлек 30,5 млрд тенге, разместив семилетние и пятилетние облигации, установив маржу 1,3 % и 1 % годовых над уровнем инфляции соответственно.

Объем вторичного рынка сложился на уровне 123,2 млн тенге. Всего в данном секторе в разрезе основных категорий инвесторов на счета БВУ пришлось 0,4 %, брокеров-дилеров – 0,4 %, других институциональных инвесторов – 99,2 %.

Паи инвестиционных фондов

На 01 февраля 2019 года в секторе ценные бумаги инвестиционных фондов находилось семь инструментов под управлением шести компаний.

За истекший период объем торгов составил 19,3 млн KZT, что ниже результата декабря 2018 года на 77,1 %. Лидерами по объему выступают паи US_SPY_ (13,3 млн тенге; 18 сделок) под управлением State Street Global Advisors, на втором месте – CSECfe (5,1 млн KZT; 5 сделок) под управлением АО "Сентрас Секьюритиз" и на третьем – акции IE_FXBF субфонда FinEx FFIN Kazakhstan Equity ETF (ETF на Индекс KASE; 891,2 тыс. тенге; 22 сделки).

В разрезе основных категорий инвесторов 43,2 % приходится на физические лица, 35,3 % – на брокеров-дилеров и 21,5 % на прочие юридические лица.

Счета физических лиц на рынке ценных бумаг

По состоянию на 01 февраля 2019 года в Центральной депозитарии числилось 117 682 лицевых счета, открытых физическими лицами, что на 858 счетов больше, чем на конец предыдущего месяца.

РЫНОК ИНОСТРАННЫХ ВАЛЮТ

В январе в торгах на рынке иностранных валют на KASE принимали участие 26 членов KASE.

Объем торгов на рынке иностранных валют достиг 770,6 млрд тенге, что ниже показателя предыдущего месяца на 26,8 % или 282,5 млрд тенге. В сравнении с январем прошлого года снижение объема торгов достигло 38,1 % или 474,2 млрд тенге. Среднедневной объем торгов составил 38,5 млрд тенге, среднедневное количество сделок – 258, средний объем одной сделки – 149,4 млн тенге.

В январе внешний новостной фон для национальной валюты был умеренно положительным. Котировки нефти марки Brent постепенно росли в первой половине месяца. Рост в первые десять дней достиг 14,6 % до 61,68 долларов США за баррель, после чего движение цены проходило в узком диапазоне 59–62,7 долларов США за баррель. В то же время рубль в паре с долларом укрепился за месяц более чем на 6 %. В конце января Комитет по операциям на открытом рынке ФРС США объявил о сохранении ставки по федеральным фондам на прежнем уровне 2,25–2,5 % годовых. Тем временем, к концу отчетного месяца тенге ослаб к рублю на 4,8 %, а курс доллара скорректировался на 1,1 % от своего исторического пика, достигнутого в последний торговый день прошлого года.

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	2 020,9 (-28,1 %)	99,1 % (-0,27 %)	4 991 (-763)	373,66 – 381,38	380,06 (-1,1 %)
RUB/KZT	475,9 (-26,6 %)	0,4 % (+0,01 %)	85 (-21)	5,6029 – 5,8125	5,8125 (+5,0 %)
CNY/KZT	28,3 (+11,0 %)	0,2 % (+0,07 %)	67 (+16)	54,2815 – 56,5400	56,5400 (+2,3 %)
EUR/KZT	6,4 (+51,2 %)	0,4 % (+0,19 %)	15 (+3)	427,15 – 438,10	438,10 (+2,7 %)

ДЕНЕЖНЫЙ РЫНОК

Национальный Банк по итогам заседания 14 января принял решение сохранить базовую ставку на уровне 9,25 % годовых с симметричным коридором +/- 1 п.п. Годовая инфляция в декабре 2018 года составила 5,3 % годовых, что соответствует нижней границе целевого коридора

5–7 %. В январе текущего года она продолжила свое снижение до 5,2 % годовых, а новый ориентир установлен на уровне 4–6 % на конец 2019 года.

К концу января индикатор TONIA снизился на 1 б.п. до 8,25 % годовых. Значение индикатора TWINA также продемонстрировало снижение на 1 б.п. до 8,26 % годовых. Стоит отметить стабильность краткосрочных ставок заимствования в сегменте репо с ГЦБ. Так, индикатор TONIA девять торговых дней из 20-ти находился на уровне 8,25 % годовых, при этом максимально он доходил до 8,35 %.

Доходность однодневного долларowego свопа SWAP-1D (USD) на конец января достигла 5,95 % годовых, снизившись за месяц на 148 б.п. Доходность двухдневного свопа SWAP-2D (USD) также продемонстрировала снижение на 55 б.п. до 6,84 % годовых.

В январе индикатор KazPrime-3M (KZT) продолжил движение на верхней границе базовой ставки Национального Банка на уровне 10,25 % годовых.

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, к концу января снизился на 11 б.п. до 8,15 % годовых.

Рынок операций репо

Объем торгов в данном сегменте составил 6,1 трлн тенге, что выше показателя прошлого месяца на 7,7 %, но ниже показателя января прошлого года на 11,8 % или на 821,5 млрд тенге. Среднедневной объем операций в январе составил 307 млрд тенге, среднее количество сделок – 373, средний объем одной сделки – 823 млн тенге.

98,1 % от общего объема сделок открытия репо пришлось на сделки авторепо с корзиной ГЦБ. Наиболее популярным инструментом на рынке авторепо с корзиной ГЦБ остается операция репо сроком на один день, доля сделок с ним в общем объеме торгов на рынке авторепо с корзиной ГЦБ составила 88 %.

Всего в январе в сделках на рынке репо принимали участие 43 члена Биржи. Более 84 % от общего оборота торгов в данном сегменте заняли банки. Доля участия нерезидентов в отчетном месяце была незначительна и держалась на уровне 0,6 %, однако в три раза выше привычного уровня 0,2 %.

Рынок валютного свопа

Объем торгов на рынке валютного свопа вырос на 38,8 % до 3,2 трлн тенге. Среднедневной объем операций составил 161,1 млрд тенге, среднее количество сделок – 49, средний объем одной сделки – 3,3 млрд тенге. В инструментальной структуре 83,1 % от общего объема торгов (2,7 трлн тенге или 7,1 млрд USD) на рынке валютного свопа пришлось на сделки с двухдневным валютным свопом (USDKZT_0_002).

РЫНОК ДЕРИВАТИВОВ

В настоящий момент в данном секторе биржевого рынка к торговле доступны фьючерсы, базовыми активами которых являются доллар США, Индекс KASE и отдельные наименования акций. В январе сделок с фьючерсами заключено не было. К началу февраля открытые позиции участников торгов на рынке деривативов отсутствовали.

Для справки

АО "Казахстанская фондовая биржа" (KASE) является ведущей фондовой биржей в Центрально-Азиатском регионе. 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. В 2015 году KASE присоединилась к инициативе ООН "Фондовые биржи за устойчивое развитие". KASE занимает второе место среди бирж СНГ по объему торгов ценными бумагами, и шестое место по уровню капитализации рынка акций бирж FEAS.

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