

АО "КАЗАХСТАНСКАЯ ФОНДОВАЯ БИРЖА"

ПРЕСС-РЕЛИЗ

г. Алматы

06 марта 2018 года

АО "Казахстанская фондовая биржа" (KASE, Биржа) информирует об основных итогах деятельности за февраль 2018 год.

- Совокупный объем торгов на KASE в феврале составил 11 259,3 млрд тенге и снизился относительно января на 9,3 % или 1 159,4 млрд тенге.
- Все сектора биржевого рынка ценных бумаг продемонстрировали рост: рынок акций – на 45,3 %; корпоративных облигаций – в 7 раз; ГЦБ – в 2 раза, ЦБ инвестиционных фондов – на 46,3 %.
- По итогам февраля Индекс KASE обновил свой девятилетний максимум и достиг 2 362,21 пункта.
- С 01 февраля в представительский список Индекса KASE включены акции АО "Банк Астаны" и АО "Банк ЦентрКредит", исключены простые акции АО "Разведка Добыча "КазМунайГаз".
- АО "Разведка Добыча "КазМунайГаз" выкупило 320,7 тыс. своих простых акций по цене \$84,00 за акцию и 61,3 млн глобальных депозитарных расписок по цене \$14,00.
- На 01 февраля 2018 года в Центральной депозитарии числилось 109 937 лицевых счетов, открытых физическим лицам, что на 326 счетов больше, чем на конец предыдущего месяца, и на 692 счета больше, чем на начало 2018 года.

Рынок акций

На конец месяца в торговых списках Биржи находились акции 126 наименований 110 эмитентов, в том числе на нелистинговой площадке торгуются акции четырех наименований четырех компаний. В отчетном месяце из официального списка KASE были исключены простые акции АО "Altyn Bank" (ДБ АО "Народный Банк Казахстана") по инициативе эмитента.

Капитализация рынка акций в феврале снизилась на 0,08 % или 15,5 млрд тенге до 18,5 трлн тенге.

Значение Индекса KASE по итогам февраля выросло на 1,4 % до 2 362,21 пункта, обновив в очередной раз девятилетний максимум. Рост Индекса замедлился в сравнении с предыдущими двумя месяцами, однако устойчивый "бычий" тренд на рынке все еще сохраняется.

С 01 февраля 2018 года представительский список Индекса KASE пополнился сразу акциями двух наименований, которые представляют банковский сектор – акциями АО "Банк Астаны" и АО "Банк ЦентрКредит". При этом из расчета Индекса KASE были исключены акции АО "Разведка Добыча КазмунайГаз", что связано с проведением на KASE со 02 февраля 2018 года выкупа названных акций эмитентом.

Акции, входящие в представительский список Индекса KASE, показали разнонаправленную динамику.

Изменение цен акций, входящих в представительский список KASE

Эмитент	Торговый код	Цена, тенге за акцию			Изменение цены, %	
		на 01.01.2018	на 01.02.2017	на 01.03.2018	в феврале	в 2018 году
АО "Банк ЦентрКредит"	CCBN	197,24	247,90	278,05	+12,2%	+41,0%
АО "КазТрансОйл"	KZTO	1 337,00	1 477,93	1 590,00	+7,6%	+18,9%
АО "Народный Банк"	HSBK	82,59	104,53	108,20	+3,5%	+31,0%
АО "Казактелеком"	KZTK	20 505,00	23 700,00	24 000,00	+1,3%	+17,0%
АО "KEGOC"	KEGC	1 389,00	1 407,03	1 415,79	+0,6%	+1,9%
АО "Кселл"	KCEL	1 784,00	1 660,00	1 625,02	-2,1%	-8,9%
KAZ Minerals PLC	GB_KZMS	3 800,00	3 937,92	3 834,92	-2,6%	+0,9%
АО "Банк Астаны"	ABBN	1 270,00	1 236,00	1 181,50	-4,4%	-7,0%

Лидером роста среди ценных бумаг Индекса выступили акции АО "Банк ЦентрКредит", стоимость которых увеличилась на 12,2 % до 278,05 тенге. Ралли по акциям началось с конца января 2018 года, после преодоления уровня канала, который формировался более двух с половиной месяцев. Рост котировок не подкреплялся фундаментальными факторами, и сопровождался увеличенным объемом сделок. В числе драйверов роста Индекса KASE также оказались акции "КазТрансОйл" (+7,6 %), АО "Народный сберегательный банк Казахстана" (+3,5 %) и АО "Казактелеком" (+1,3 %).

Лидером падения стали акции АО "Банк Астаны", которые подешевели на 4,4 % до 1 181,50 тенге. Акции банка после достижения максимальных значений в конце ноября, перешли к коррекции и находятся в нисходящем канале.

Несмотря на публикацию сильных финансовых результатов за 2017 год, акции KAZ Minerals PLC показали отрицательную динамику, снизившись по итогам месяца на 2,6 % до 3 834,92 тенге. Коррекция акций была не столь значительной и скорее всего, связана с волатильностью цен на сырьевых рынках.

Объем торгов акциями в январе 2018 года относительно предыдущего месяца вырос на 45,3 % или 4,8 млрд тенге до 15,3 млрд тенге. Среднедневной объем сделок составил 764,8 млн тенге против 501,3 млн тенге в предшествующем месяце. Значительный рост объемов связан с проведенным выкупом простых акций АО "Разведка Добыча "КазМунайГаз".

Специализированные торги по выкупу глобальных депозитарных расписок и простых акций АО "Разведка Добыча "КазМунайГаз" (далее – Компания) проводились на KASE с 02 по 19 февраля 2018 года. По итогам, торгов Компания выкупила на KASE 320 688 своих простых акций по цене \$84,00 за акцию. Всего было удовлетворено 185 заявок на общую сумму 26,9 млн долларов США (8,6 млрд тенге). Компания также произвела выкуп 61,3 млн своих глобальных депозитарных расписок (ГДР) по цене \$14,00 на общую сумму 857,9 млн долларов. Объемы по выкупу ГДР не входят в объемы торгов акциями, и относятся к сектору "Производные ценные бумаги".

В структуре инвесторов наиболее активными остаются физические лица, на долю которых по итогам февраля приходится 49,5 %, доля брокеров-дилеров составила 16,4 %, доля банков второго уровня (БВУ) – 2,4 %, доля других институциональных инвесторов сложилась на уровне 17,4 %, доля прочих юридических лиц – на уровне 14,3 %. Нерезиденты в общем брутто-обороте торгов акциями контролировали 1,3 % оборота, против 7,7 % в январе.

Рынок корпоративных облигаций

На конец февраля в торговых списках KASE находились облигации 251 наименования, выпущенные 65 эмитентами. В отчетном месяце из официального списка были исключены облигации АО "Kaspi Bank" (CSBNb13) в связи с истечением срока обращения,

АО "Казкоммерцбанк" (KKGBe24) и ТОО "Жаикмунай" (ZHMNe2, ZHMNe3) в связи с их досрочным погашением, АО "Алматинские электрические станции" (ALESb12) в связи с аннулированием выпуска.

Объем торгуемого корпоративного долга в феврале снизился на 3,9 % до 8 391,3 млрд тенге.

Суммарный объем торгов корпоративными облигациями сложился в отчетном месяце на уровне 59,1 млрд тенге и вырос относительно января в 7 раз или на 50,8 млрд тенге. Среднедневной объем торгов составил 3,0 млрд тенге (в январе – 394,5 млн тенге). На первичном рынке объем сделок достиг 50,9 млрд тенге, что в 10 раз или на 45,9 млрд тенге выше предыдущего месяца. В отчетном месяце были размещены четыре выпуска облигаций:

- АО "Ипотечная организация "Казахстанская Ипотечная Компания" привлекло 6,0 млрд тенге, разместив 10-летние облигации под 10,50 % годовых, сроком до погашения 9,8 лет;
- ТОО "Компания Фаэтон" привлекло 1,0 млрд тенге, разместив 7-летние облигации под 13,49 % годовых, сроком до погашения 6,3 лет;
- АО "Банк ЦентрКредит" привлекло 10,2 млрд тенге, разместив 10-летние облигации под 11,75 % годовых, сроком до погашения 9,9 лет;
- в рамках Программы повышения финансовой устойчивости банковского сектора АО "Банк "Bank RBK" привлекло 33,7 млрд тенге, разместив 15-летние субординированные облигации под 4,08 % годовых, сроком до погашения 14,8 лет.

Значение индикатора KASE_BMY, отражающего средневзвешенную доходность корпоративных облигаций основной площадки, в феврале снизилось на 18 б.п. до 10,17 % годовых. Тем временем, расчет индекса KASE_BAY, который отражает средневзвешенную доходность корпоративных облигаций альтернативной площадки, был приостановлен в связи с отсутствием представительской выборки.

В разрезе основных категорий инвесторов на вторичном рынке корпоративных облигаций на счета БВУ пришлось 6,8 %, брокеров-дилеров – 10,4 %, других институциональных инвесторов – 73 %, прочих юридических лиц – 7,5 %. Доля физических лиц в данном сегменте рынка составила 2,3 %. Участие нерезидентов оценивается в 0,2 %.

Рынок государственных ценных бумаг (ГЦБ)

Номинальная стоимость торгуемого на KASE государственного долга достигла 10,7 трлн тенге, что на 0,4 % или 45,8 млн тенге выше, чем по итогам января.

В феврале совокупный объем торгов на рынке ГЦБ вырос в 2 раза до 32,5 млрд тенге с 15,8 млрд тенге в январе.

На первичном рынке ГЦБ наблюдалось снижение активности: объем сделок упал на 63,9 % или 3,4 млрд тенге до 1,9 млрд тенге. Весь объем размещений пришелся на Акимат г. Астаны, который в рамках реализации государственных программ разместил двухлетние облигации под 0,35 % годовых.

Объем торгов на вторичном рынке вырос в 3 раза до отметки 30,6 млрд тенге. Более 80 % от общего оборота торгов вторичного рынка пришлось на ноты Национального Банка. Среднедневной объем торгов составил 1 529,6 млн тенге против 501,4 млн тенге в предыдущем месяце. Рост объема торгов на вторичном рынке сопровождался активизацией БВУ, объем брутто-оборота которых вырос до 44,5 млрд тенге против 9,4 млрд тенге в январе.

В разрезе основных категорий инвесторов на вторичном рынке ГЦБ на долю БВУ пришлось 72,8 %, на долю брокеров-дилеров – 1,0 %, на долю других институциональных инвесторов – 18,7 %, на прочих юридических лиц – 2,2 %, на физических лиц – 5,3 %. Участие нерезидентов оценивается в 0,1 %.

Паи инвестиционных фондов (ПИФ)

За истекший период в секторе "Ценные бумаги инвестиционных фондов" находились шесть инструментов под управлением пяти компаний. Объем торгов составил 27,8 млн тенге, что выше результата января на 46,3 %. В разрезе основных категорий инвесторов доля физических лиц составила 33,6 %, брокеров-дилеров – 33,6 %, прочих юридических лиц – 32,8 %.

Счета физических лиц на рынке ценных бумаг

На конец февраля в системе учета Центрального депозитария ценных бумаг числилось 109 937 лицевых счетов, открытых на физических лиц, что на 326 счетов больше, чем на конец предыдущего месяца, и на 692 счета больше, чем на начало 2018 года.

Рынок иностранных валют

В феврале в торгах на рынке иностранных валют на KASE принимали участие 32 члена KASE.

Объем торгов на рынке иностранных валют сложился на уровне 1 081,2 млрд тенге, что ниже результата предыдущего месяца на 13,1 % или 163,6 млрд 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, KZT за ед. валюты	Курс на конец месяца (изм.%)
USD/KZT	3 334,7 (-12,2 %)	75,0 % (-11,0 %)	6 834 (-604)	318,68–327,32	320,30 (-0,8 %)
RUB/KZT	1 102,0 (+87,8 %)	24,8 % (+11,5 %)	102 (+9)	5,5996–5,7463	5,6914 (-0,9%)
CNY/KZT	6,3 (-76,1 %)	0,1 % (-0,5 %)	24 (-23)	50,6000–51,9000	50,6183 (-0,7 %)
EUR/KZT	3,0 (+3,4 %)	0,1 % (+0,0 %)	12 (-9)	392,60–402,35	393,45 (-2,1 %)

Денежный рынок

На денежном рынке продолжает сохраняться профицит ликвидности тенге, о чем свидетельствует преимущественное нахождение индикатора TONIA (средневзвешенная процентная ставка по сделкам открытия репо сроком на один рабочий день) вблизи нижней границы базовой ставки. Так, из 20 торговых дней в феврале 12 дней значение TONIA держалось на уровне 8,75 % годовых. К концу февраля индикатор TONIA вырос на 3 б.п. до 8,78 % годовых, что является максимальным значением месяца. Индикатор TWINA (средневзвешенная процентная ставка по сделкам открытия репо сроком на семь рабочих дней) был более волатильным, и дважды опускался ниже границы базовой ставки на 1 и 2 б.п. до 8,74 % и 8,73 % годовых, соответственно. Однако февраль для TWINA завершился почти аналогичным с TONIA увеличением на 3 б.п. до 8,79 % годовых.

Доходность однодневного долларowego свопа SWAP-1D (USD) на конец февраля составила 8,97 % годовых и снизилась за месяц на 20 б.п. Доходность двухдневного свопа SWAP-2D (USD) опустилась лишь на 2 б.п. до 8,92 % годовых. Минимальное значение индикатора SWAP-1D (USD) было зафиксировано на уровне 8,0 % годовых.

После идентичного с базовой ставкой снижения на 50 б.п. в январе индикатор KazPrime-3M (KZT) оставался неизменным на протяжении всего февраля на уровне 10,75 % 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 февраля опустился на 2 б.п. до 8,79 % годовых.

Рынок операций репо

Объем торгов в данном сегменте не превысил 5,8 трлн тенге, что ниже показателя прошлого месяца на 17 %. Среднедневной объем операций в феврале составил 288,8 млрд тенге (-42,7 млрд тенге или -12,9 % к аналогичному показателю января 2018).

Более 98 % от общего объема торгов по сделкам открытия репо пришлось на сделки авторепо с ГЦБ. Наиболее популярным инструментом на рынке авторепо с ГЦБ остается операция репо

сроком на один день, доля сделок с ним в общем объеме торгов на рынке авторепо с ГЦБ составила 88,7 %.

Всего в сделках на рынке репо принимали участие 45 членов Биржи. Более 84,5 % от общего оборота торгов в данном сегменте заняли банки второго уровня. Доля участия в отчетном месяце была незначительна и составила 0,1 %.

Рынок валютного свопа

Объем торгов на рынке валютных свопов снизился на 3,7 % до 4,0 трлн тенге (-3,7 % к аналогичному показателю января 2018 года). Среднедневной объем операций составил 201,1 млрд тенге, что выше аналогичного показателя января на 2,1 млрд тенге или +1,1 %. В инструментальной структуре более 80 % от общего объема торгов (3,3 трлн тенге или 10,2 млрд USD) на рынке валютного свопа пришлось на сделки с двухдневным валютным свопом (USDKZT_0_002).

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 "Фондовые биржи за устойчивое развитие". 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