

ПРЕСС-РЕЛИЗ

г. Алматы

10 сентября 2020 года

KASE представляет итоги работы биржевого рынка за август 2020 года

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

- Совокупный объем торгов на KASE в августе 2020 года составил 7 995 млрд тенге и снизился относительно июля на 6,8 % или 586,2 млрд тенге.
- Значение Индекса KASE выросло на 1,2 % или на 29,90 пунктов до 2 475,71 пунктов.
- Капитализация рынка акций увеличилась на 1,9 % или 332,4 млрд тенге и составила 17,9 трлн тенге.
- Объем торгуемого корпоративного долга увеличился на 4,1 % или 561,4 млрд тенге, достигнув отметки 14,3 трлн тенге.
- В августе 2020 года листинг на KASE прошли три новых эмитента, в том числе ТОО "Микрофинансовая организация ОнлайнКазФинанс" – первая микрофинансовая компания, облигации которой включены в списки KASE.
- По состоянию на 01 сентября 2020 года в торговых списках KASE находились ценные бумаги 446 наименований 182 эмитентов.
- По состоянию на 01 сентября 2020 года в Центральном депозитарии числилось 124 436 лицевых счетов, открытых на физические лица, что на 1 158 счетов больше, чем месяцем ранее и на 6 741 счет больше чем на начало 2020 года.

КЛЮЧЕВЫЕ ПРОЕКТЫ И МЕРОПРИЯТИЯ

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

- 27 августа 2020 года KASE провела региональную онлайн-конференцию "Рынки капитала Центральной Азии и Азербайджана: вызовы и перспективы" с участием шести бирж из пяти стран.
- KASE запустила электронный способ оплаты для клиентов информационного продукта Биржи "Web-Quotes" – просмотр торгов в режиме реального времени на сайте Биржи.
- KASE запустила комплексную обучающую программу для студентов ВУЗов "Торговля на KASE: от А до Я", состоящую из теоретического и практического блоков.
- 05 августа 2020 года KASE совместно с обучающим проектом по повышению финансовой грамотности Fingramota.kz Агентства Республики Казахстан по регулированию и развитию финансового рынка (АРРФР) и в партнерстве с ресурсом Factcheck.kz и Медиа-школой МЦЖ "MediaNet" провела онлайн-семинар "Фондовый рынок: освещаем грамотно" для представителей средств массовой информации.
- 04 августа 2020 года KASE в рамках проекта "День эмитента" провела онлайн-встречу с руководством АО "Кселл" для инвесторов, профессиональных участников рынка ценных бумаг и представителей СМИ.

- 03 августа 2020 года KASE перевела биржевую торговлю на фондовом рынке в новую торгово-клиринговую систему ASTS+ и стала центральным контрагентом для всех финансовых инструментов фондового рынка.

РЫНОК АКЦИЙ

По итогам августа капитализация рынка акций увеличилась на 1,9 % или 332,4 млрд тенге и составила 17,9 трлн тенге (42,6 млрд USD). Наибольшее снижение капитализации (-25,4 %) произошло у компании NOSTRUM OIL & GAS PLC, наибольший рост (+127,5 %) у АО "БАСТ".

На конец августа в торговых списках KASE находились акции 139 наименований 123 эмитентов, из них три выпуска допущены к обращению в секторе нелистинговые ценные бумаги. В августе в официальный список KASE были включены простые акции АО "Страховая Компания "Sinoasia B&R (Синоазия БиЭндАр)" (новый эмитент).

Объем торгов акциями в августе относительно июля 2020 года вырос в 4,3 раза или на 37,2 млрд тенге до 48,5 млрд тенге. Среднедневной объем торгов составил 2,4 млрд тенге, среднедневное количество сделок составило 859, средний объем одной сделки – 2,8 млн тенге.

Среди основных категорий инвесторов наиболее активными были физические лица, на счета которых пришлось 68 % от суммарного объема сделок с акциями. Доля брокеров-дилеров составила 11,7 %, доля других институциональных инвесторов – 0,5 %, доля прочих юридических лиц достигла 19,7 %. На банки второго уровня (БВУ) пришлось 0,2 %. Участие нерезидентов оценивается в 9,2 %.

ИНДЕКС KASE

Индекс KASE по итогам августа вырос на 1,2 % или на 29,90 пункта до 2 475,71 пунктов (максимальное значение в 2020 году, максимальное значение с 16 апреля 2019 года). С начала года изменение показателя составило +4,7 %. Объем сделок с индексными акциями в августе составил 17,9 млрд тенге, что на 133,4 % выше показателя июля.

Изменение цен акций, входящих в представительский список KASE

Эмитент	Торговый код	Изменение цены		
		на 01.08.2020	на 01.09.2020	в августе
KAZ Minerals PLC	GB_KZMS	2 913,99	3 089,00	+6,0%
АО "Народный сберегательный банк Казахстана"	HSBK	116,78	120,50	+3,2%
АО "Казатомпром"	KZAP	6 019,00	6 100,00	+1,3%
АО "Кселл"	KCEL	2 529,99	2 525,00	-0,2%
АО "KEGOC"	KEGC	1 710,00	1 704,92	-0,3%
АО "КазТрансОйл"	KZTO	814,87	810,50	-0,5%
АО "Банк ЦентКредит"	CCBN	230,00	228,15	-0,8%
АО "Казактелеком"	KZTK	26 990,00	26 500,00	-1,8%

Главным драйвером роста Индекса KASE стали простые акции KAZ Minerals PLC, которые за отчетный месяц подорожали на 6 % до 3 089 тенге. В последний торговый день месяца акция меднодобывающей компании в очередной раз удалось обновить максимум значения цены за 2020 год, тем самым продемонстрировав рост с начала года на 17,4 %, а рост с минимальной отметки 2020 года (16 марта) составил 101,9 %. Стоимость акции эмитента на Лондонской фондовой бирже (LSE) за отчетный период выросла на 7,3 % до 580,60 британских пенсов. Триггерами роста бумаги компании, скорее всего, выступают активное восстановление котировок меди и потенциальные дивидендные выплаты за 2019 год. Помимо этого, положительный эффект могли оказать данные о росте экспорта Китая в июле на 7,2 % по сравнению с тем же месяцем прошлого года, что может свидетельствовать о более быстром восстановлении экономики КНР – главного потребителя меди в мире. Котировки меди на бирже

COMEX за отчетный период выросли на 6 %, что позволило им вернуться на уровни до мартовского обвала.

18 августа компания предоставила финансовые результаты за первое полугодие 2020 года, согласно которым показатель EBITDA за январь-июнь 2020 года снизился на 9,8 % до \$559 млрд. В сообщении компании отмечается, что компании удалось снизить общую денежную себестоимость до \$0,137 за фунт и сохранить лидирующую позицию в отрасли по чистой денежной себестоимости, сократив показатель до \$0,68 за фунт. Вследствие локального снижения цен на медь весной текущего года операционный доход группы за этот же период уменьшился на 12,9 % до \$357 млн. Чистая прибыль KAZ Minerals в январе-июне 2020 года уменьшилась на 13,2 %, до \$197 млн. В сообщении эмитента также отмечается, что риски COVID-19 сохраняются, но после отличных показателей по добыче за первое полугодие KAZ Minerals находится на пути к достижению планового объема производства. Также, группа KAZ Minerals 18 августа сообщила, что планирует выплатить промежуточные дивиденды по итогам первого полугодия 2020 года в размере \$0,04 на акцию, что практически идентично размеру выплат за аналогичный период прошлого года.

Второй лучший результат за август продемонстрировали простые акции АО "Народный сберегательный банк Казахстана", подорожавшие за месяц на 3,2 % до 120,50 тенге. На протяжении почти всего месяца акции банка находились в боковом тренде, но в последние несколько дней наблюдался резкий скачок в цене в районе 6 %. Стоимость акций на локальном рынке, скорее всего, стремилась нивелировать разницу с ГДР банка на LSE, цена которых за отчетный период выросла на 5,4 % до 11,70 британских пенсов (122,49 тенге за акцию по официальному курсу Нацбанка на 28 августа). 17 августа АО "Народный сберегательный банк Казахстана" сообщило консолидированные финансовые результаты за первые шесть месяцев 2020 года, согласно которым чистая прибыль банка уменьшилась на 16,5 % до 74,9 млрд тенге в основном за счёт увеличения расходов по кредитным убыткам. Процентные доходы банка в первом полугодии увеличились на 1,1 %, до 359,9 млрд тенге, процентные расходы, напротив, снизились на 8,7 %, до 151,4 млрд тенге. Чистая процентная маржа увеличилась до 5,2 % годовых за январь-июнь 2020 года в сравнении с 5,1 % годовых за аналогичный период 2019 года. 19 августа Halyk Bank сообщил, о выплате дивидендов по простым акциям банка за 2019 год из нераспределенного чистого дохода прошлых лет в размере 17,08 тенге на одну простую акцию в соответствии с решением, принятым на внеочередном общем собрании акционеров, прошедшим 23 июля.

РЫНОК КОРПОРАТИВНЫХ ОБЛИГАЦИЙ

Объем корпоративного долга в обращении в августе увеличился на 4,1 % или 561,4 млрд тенге, достигнув отметки 14,3 трлн тенге (34 млрд USD).

На конец августа в официальном списке KASE находились 262 выпуска корпоративных облигаций 70 эмитентов. В отчетном месяце в официальный список KASE включены три выпуска корпоративных облигаций трех эмитентов, один из которых прошел процедуру листинга на KASE впервые: выпуск АО "Транстелеком", ТОО "Микрофинансовая организация ОнлайнКазФинанс" (новый эмитент), АО "Аграрная кредитная корпорация".

В отчетном месяце из официального списка исключены два выпуска корпоративных облигаций в связи с истечением срока обращения: АО "ЭКОТОН+" и ТОО "Актобе нефтепереработка".

Значение индекса доходности корпоративных облигаций KASE_BMY выросло в августе на 7 базисных пунктов до 10,99 % годовых.

Объем торгов корпоративными облигациями на KASE вырос относительно июля в 2,3 раза или 147,7 млрд тенге до 257,5 млрд тенге. Среднедневной объем торгов составил 12,9 млрд тенге, среднедневное количество сделок – 34, средний объем одной сделки – 379,7 млн тенге.

На первичном рынке корпоративных облигаций были размещены шесть выпусков облигаций шести эмитентов на общую сумму 251,7 млрд тенге, что выше показателя июля в 2,6 раза или 154,4 млрд тенге.

- АО "Ипотечная организация "Казахстанская Ипотечная Компания" привлекло 480,0 млн тенге, разместив тридцатилетние облигации KZ2C00004349 (KZIKb29);

- АО "Казахстанский фонд устойчивости" привлекло 17,1 млрд тенге, разместив облигации KZ2C00006484 (BASPb8) со средневзвешенной доходностью к погашению 10,9871 % годовых и сроком до погашения 2,6 лет;
- АО "КазАгроФинанс" привлекло 1,6 млрд тенге, разместив облигации KZ2C00006781 (KAFIb10) с доходностью к погашению 12,7 % годовых и сроком до погашения 4,4 года;
- АО "Байтерек девелопмент" привлекло 200,0 млрд тенге, разместив одиннадцатилетние облигации KZ2C00006815 (BTDVb5) с доходностью к погашению 6,0200 % годовых;
- ТОО "Микрофинансовая организация ОнлайнКазФинанс" привлекло 1,9 млрд тенге, разместив двухлетние облигации KZ2P00006877 (MFOKb1) под 19,0 % год;
- АО "Аграрная кредитная корпорация" привлекло 30,5 млрд тенге, разместив десятилетние облигации KZ2C00006922 (AGKKb14) со средневзвешенной доходностью к погашению 10,7500 % годовых.

В разрезе основных категорий инвесторов на первичном рынке корпоративных облигаций доля БВУ составила 5,5 %, доля брокеров-дилеров – 0,2 %. На долю других институциональных инвесторов пришлось 13,8 %, прочих юридических лиц – 80,1 %. Доля нерезидентов оценивается в 0,5 %.

На вторичном рынке облигаций в августе объем торгов снизился на 53,4 % или на 6,6 млрд тенге до 5,8 млрд тенге в сравнении с июлем.

В разрезе основных категорий инвесторов на вторичном рынке корпоративных облигаций доля БВУ составила менее 0,1 %, брокеров-дилеров – 28,2 %, других институциональных инвесторов – 56,8 %, прочих юридических лиц – 3,4 %, доля физических лиц – 11,6 %. Доля нерезидентов составила 2,4 %.

РЫНОК ГОСУДАРСТВЕННЫХ ЦЕННЫХ БУМАГ (ГЦБ)

Номинальная стоимость торгуемого на KASE государственного долга по итогам августа выросла на 3,5 % или 529 млрд тенге до 15,6 трлн тенге (37,2 млрд USD).

В августе объем торгов на рынке ГЦБ снизился на 37 % или на 238,7 млрд тенге до 406,5 млрд тенге. При этом объем рынка ГЦБ за 8 месяцев текущего года более чем в 2 раза превышает суммарный показатель за 2019 год. Рост относительно предыдущего года демонстрируют как первичный, так и вторичный рынки ГЦБ.

Среднедневной объем торгов сложился на уровне 20,3 млрд тенге (на вторичном рынке – 2,4 млрд тенге), среднее количество сделок – 6 (на вторичном рынке – 3), средний объем одной сделки – 3,7 млрд тенге (средний объем одной сделки на вторичном рынке – 757,3 млн тенге).

Объем первичного рынка составил 358 млрд тенге, что на 23,1 % ниже результата июля. Из них 203 млрд тенге привлекли акиматы 14-ти областей, г. Алматы и г. Нур-Султан и г. Шымкент в целях финансирования мероприятий, предусмотренных в рамках реализации государственной программы "Дорожная карта занятости на 2020–2021 годы". Министерство финансов привлекло 155 млрд тенге, это ниже показателя июля на 65,6 %. Всего в августе было размещено четыре выпуска облигаций со средневзвешенной доходностью 10,52–10,79 % годовых. В качестве покупателей выступили брокеры-дилеры, их доля составила 0,9 %, другие институциональные инвесторы с долей 41,8 %, прочие юридические лица с долей участия 57,3 %. Доля нерезидентов составила 0,6 %.

Объем торгов на вторичном рынке по итогам августа снизился на 73,1 % или на 131,4 млрд тенге до 48,5 млрд тенге с 358 млрд тенге. 62,4 % или 30,2 млрд тенге об общего оборота торгов вторичного рынка пришлось на сделки с МЕКАМ, 36,9 % или 17,9 млрд тенге – на ноты Национального Банка. Остальной объем, составляющий менее 1 % (343,2 млн тенге), пришелся на сделки с еврооблигациями Республики Казахстан и с ГЦБ иностранных государств.

В структуре инвесторов на вторичном рынке на БВУ пришлось 36,5 %, на брокеров-дилеров – 5,4 %, на долю других институциональных инвесторов – 35,9 %, на долю прочих юридических лиц – 22,3 %, участие физических лиц не превысило 1 %. Участие нерезидентов оценивается в 8,2 %.

ОБЛИГАЦИИ МФО

На конец отчетного периода в торговых списках KASE находилось 30 выпусков облигаций четырех международных финансовых организаций: Евразийского банка развития, Европейского банка реконструкции и развития, Международной финансовой корпорации (IFC) и Азиатского банка развития.

За отчетный период в официальный список KASE были включены два выпуска облигаций: выпуск Евразийский банк развития и Европейского банка реконструкции и развития, которые были успешно размещены в торговой системе KASE на сумму 40 млрд тенге под 11 % годовых и 60 млрд тенге с маржой к полугодовому купону 1 % соответственно. Общий объем размещений составил 100 млрд тенге.

В разрезе основных категорий инвесторов на первичном рынке облигаций МФО доля БВУ составила 19 %, доля других институциональных инвесторов – 74 %, прочих юридических лиц – 7,1 %. Нерезиденты в торгах не участвовали.

В течение августа на вторичном рынке была заключена одна сделка на сумму 15,2 млн тенге между юридическим и физическим лицами.

ПАИ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ФОНДОВ

На 01 сентября в секторе "Ценные бумаги инвестиционных фондов" находились 12 инструментов под управлением девяти компаний.

В августе в указанный сектор были включены паи RU000A101NK4 закрытого паевого инвестиционного фонда рыночных финансовых инструментов "Фонд первичных размещений" под управлением ООО "Управляющая компания "Восток-Запад" (новый эмитент).

В отчетном месяце объем торгов составил 525,2 млн тенге и снизился относительно июля на 18,4 % или на 118,4 млн тенге.

Инструмент	Объем, млн KZT	Кол-во сделок
FFIN_or	423,3	8
CSECfe	38,0	9
US_SPY_	31,9	61
CSECgm	25,6	9
IE_FXBF	6,4	64
	525,2	151

В разрезе основных категорий инвесторов 49,7 % приходится на физические лица, 42,5 % – на прочих юридических лиц, 4,8 % – на других институциональных инвесторов и 3 % – на брокеров-дилеров.

СЧЕТА ФИЗИЧЕСКИХ ЛИЦ НА РЫНКЕ ЦЕННЫХ БУМАГ

По состоянию на 01 сентября 2020 года в Центральном депозитарии числилось 124 436 лицевых счетов, открытых на физические лица, что на 1 158 счетов больше, чем месяцем ранее и на 6 741 счет больше чем на начало 2020 года.

РЫНОК ИНОСТРАННЫХ ВАЛЮТ

В августе 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 торгов составила 0,05 %.

Объем торгов на рынке иностранных валют сложился на уровне 935,2 млрд тенге, что выше показателя предыдущего месяца на 7,6 % или 66,1 млрд тенге. Среднедневной объем торгов составил 46,8 млрд тенге, среднедневное количество сделок – 492, средний объем одной сделки – 95,1 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	2 198,1 (+6,3 %)	77,3 % (-1,9 %)	9 655 (+179)	417,87 – 420,11	420,11 (+0,5 %)
RUB/KZT	461,6 (+52,1 %)	16,2 % (+4,6 %)	106 (+16)	5,5676 – 5,7595	5,8249 (-1,7 %)
CNY/KZT	182,3 (-23,5)	6,4 % (-2,7 %)	59 (-40)	59,7200 – 61,1449	61,1449 (2,4 %)
EUR/KZT	2,6 (-3,2 %)	0,1 % (0%)	13 (+1)	492,14 – 496,90	494,84 (+0,004 %)

Как следует из приведенных данных тенге завершил август символическим ослаблением к основным валютам, но укрепился к рублю. Ослаблению тенге способствовали слабо меняющаяся стоимость нефти и напряженные отношения между США и Китаем, однако в качестве поддержки национальной валюте выступает замедление роста заболеваемости в стране и мире, а также постепенное ослабление карантинных мер. За текущий месяц тенге ослаб к доллару США на 0,5 % с 418 тенге до 420,11 тенге за единицу валюты. Среди стран СНГ наименьшее ослабление к доллару США в августе продемонстрировали казахстанский тенге (+0,5 %) и киргизский сом (+2,2 %), укрепление отметилось у российского рубля (-0,5 %).

ДЕНЕЖНЫЙ РЫНОК

К концу августа индикатор TONIA (средневзвешенная процентная ставка по сделкам открытия репо сроком на один рабочий день) повысился на 118 б.п. с 8,41 % до 9,59 % годовых по сравнению с июлем.

Индикатор TWINA (средневзвешенная процентная ставка по сделкам открытия репо сроком на семь рабочих дней) продемонстрировал снижение на 39 б.п. с 9,47 % до 9,08 % годовых.

Значение однодневного долларowego свопа SWAP-1D (USD) на конец августа увеличилось на 162 б.п. с 8,11 % до 9,73 % годовых. Доходность двухдневного свопа SWAP-2D (USD) также увеличилась на 122 б.п. с 8,76 % до 9,98 % годовых.

Индикатор KazPrime-3M (KZT) в августе продемонстрировал стабильность, оставаясь неизменным по предложению на уровне 10,5 % в пределах верхней границы коридора базовой ставки Национального Банка, по спросу на уровне 7,5 % в пределах нижней границы коридора базовой ставки Национального Банка.

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, к концу августа увеличился на 121 б.п. с 8,38 % до 9,59 % годовых.

Рынок операций РЕПО

Объем торгов в данном сегменте составил 5 738,4 млрд тенге, что меньше показателя прошлого месяца (в июле объем операций репо составил 6 307,2 млрд тенге) на 568,7 млрд тенге или на 9 %. Среднедневной объем операций составил 286,9 млрд тенге, среднее количество ежедневных заключенных сделок – 366, средний объем одной сделки – 784,7 млн тенге.

Рынок операций валютного свопа

Объем торгов в августе на рынке операции валютного свопа снизился на 129,0 млрд тенге или на 20,2 %, с 637,4 млрд тенге до 508,4 млрд тенге.

Среднедневной объем операций составил 25,4 млрд тенге, среднее количество сделок – 12, средний объем одной сделки – 2,2 млрд. тенге. В инструментальной структуре 54,1 % от общего объема торгов (274,8 млрд тенге или 1,3 млрд. USD) на рынке валютного свопа пришлось на сделки с двухдневным валютным свопом (USDKZT_0_002), 41 % от общего объема торгов (208,5 млрд тенге или 0,997 млрд USD) на рынке валютного свопа пришлось на сделки с однодневным валютным свопом (USDKZT_0_001), 4,9 % от общего объема торгов (25,1 млрд тенге или 0,1 млрд USD) на сделки одномесячного валютного свопа (USDKZT_01M).

Среднедневной объем операций однодневного валютного свопа USDKZT-1D составил 10,4 млрд тенге, двухдневного валютного свопа USDKZT-2D – 13,7 млрд тенге.

Рынок деривативов

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