

ПРЕСС-РЕЛИЗ

г. Алматы

11 марта 2020 года

KASE представляет итоги работы биржевого рынка в феврале 2020 года

АО "Казахстанская фондовая биржа" (KASE, Биржа) представляет итоги работы биржевого рынка в феврале 2020 года.

- Совокупный объем торгов на KASE в феврале составил 10 252,9 млрд тенге и вырос относительно января на 12,2 % или 1 115,2 млрд тенге.
- В феврале в официальный список KASE был включен один выпуск международных облигаций АО "Банк Развития Казахстана".
- По итогам февраля 2020 года значение Индекса KASE снизилось на 3,3 % и составило 2 222,59 пунктов.
- Капитализация рынка акций снизилась на 0,02 % до 17,1 трлн тенге.
- Объем торгуемого корпоративного долга вырос на 0,3 % до 12,9 трлн тенге.
- В секторе корпоративных облигаций объем первичных размещений составил 30,6 млрд тенге.
- На 01 марта 2020 года в Центральной депозитарии числилось 118 773 лицевых счета, открытых на физические лица, что на 1 141 счет больше, чем месяцем ранее и на 1 949 счетов больше чем на начало 2019 года.

РЫНОК АКЦИЙ

По итогам февраля капитализация рынка акций снизилась на 0,02 % или 4 млрд тенге до 17,1 трлн тенге.

На конец месяца в торговых списках KASE находились акции 139 наименований 123 эмитентов, из них три выпуска допущены к обращению в секторе "нелистинговые ценные бумаги". В феврале 2020 года изменений в списке акций не было.

Объем торгов акциями в феврале относительно января снизился на 80,3 % или на 14,4 млрд тенге до 3,5 млрд тенге.

Среди основных категорий инвесторов доля физических лиц составила 43,3 % от суммарного объема сделок с акциями. Доля банков второго уровня (БВУ) – 0,4 %, брокеров-дилеров – 24,8 %, доля других институциональных инвесторов – 7,5 %, доля прочих юридических лиц достигла 23,9 %. Участие нерезидентов оценивается в 16 %.

ИНДЕКС KASE

По итогам февраля главный индикатор фондового рынка Казахстана снизился на 3,3 % до 2 222,59 пунктов. Относительной устойчивости Индекса KASE способствовало укрепление тенге до 375 тенге за доллар США, и подтверждение международным рейтинговым агентством

Fitch Ratings долгосрочных рейтингов Казахстана в национальной и иностранной валютах на уровне "BBB". Стоит отметить, что основным драйвером роста и снижения Индекса KASE в течение отчетного месяца было движение простых акций АО "Народный сберегательный банк Казахстана" и KAZ Minerals PLC, вес каждой из которых в корзине Индекса находится приблизительно на уровне 15%. Снижение котировок акций KAZ Minerals PLC нивелировали влияние роста котировок ценных бумаг крупнейшего банка страны на Индекс KASE. Несмотря на позитивные финансовые результаты группы KAZ Minerals PLC, снижение ценовой конъюнктуры сырьевых рынков усилили распродажи акций компании со стороны инвесторов.

Эмитент	Торговый код	Изменение цены		
		на 01.02.2020	на 01.03.2020	в феврале 2020
АО "Народный сберегательный банк Казахстана"	HSBK	137,22	142,80	+4,1 %
АО "KEGOC"	KEGC	1 600,00	1 606,93	+0,4 %
АО "Банк ЦентрКредит"	CCBN	237,00	237,00	0,0 %
АО "Национальная атомная компания "Казатомпром"	KZAP	5 050,00	4 865,00	-3,7 %
АО "Кселл"	KCEL	2 380,00	2 271,86	-4,5 %
АО "Казактелеком"	KZTK	24 801,00	23 501,02	-5,2 %
АО "КазТрансОйл"	KZTO	1 029,97	974,42	-5,4 %
KAZ Minerals PLC	GB_KZMS	2 329,00	2 111,50	-9,3 %

В феврале простые акции АО "Народный сберегательный банк Казахстана" подорожали на 4,1 %, а с начала 2020 года показатель роста цены бумаги на площадке KASE составил 9 %. Аналогичные показатели изменения стоимости бумаги на London Stock Exchange (LSE) составили -3,8 % и 4,9 %, соответственно. Значимыми факторами роста бумаг банка выступают стабильность его позиций в секторе, ожидание роста чистой прибыли по итогам 2019 года, и как следствие, роста дивидендных выплат. В конце февраля стоимость простых акций скорректировалась на фондовых площадках KASE и LSE – сильный рост акций накануне смог спровоцировать откат цены с новых локальных максимумов. 21 февраля 2020 года стоимость одной простой акции банка достигла максимального значения после проведения сплита акций в пропорции 1:10 в декабре 2012 года.

Главным аутсайдером индексной корзины второй месяц подряд стали простые акции KAZ Minerals PLC. В феврале простые акции производителя меди подешевели на KASE на 9,3 %, а с начала 2020 года – на 19,7 %. Аналогичные показатели изменения стоимости бумаги на LSE составили -6,4 % и -22,9 % соответственно. Небольшое восстановление котировок бумаг было обеспечено новостью о рефинансировании задолженности компании и положительными финансовыми результатами группы KAZ Minerals. Доходы от реализации по группе компаний увеличились в 2019 году до \$2,266 млрд (2018 – \$2,162 млрд), несмотря на снижение средней цены на медь в течение года. Рост произошел благодаря высоким производственным показателям, а также объему реализации меди и золота – он вырос по сравнению с 2018 годом на 7 % и 33 % соответственно. По данным Bloomberg, стоимость медных фьючерсов на товарной бирже London Metal Exchange (LME) за февраль выросла на 1,2%, с начала года снизилась на 9 %. Глобальные депозитарные расписки компании на LSE потеряли в цене в феврале 2020 года 6,4 %, с начала года снижение составило 22,9 %. Новостные сообщения о вспышке коронавируса, и как следствие нарастание рисков замедления экономики Китая и мира, в целом, продолжили оказывать понижающее давление на акции в течение месяца. К концу февраля стоимость одной простой акции KAZ Minerals PLC на площадке KASE составила 2 111,50 тенге, что является минимальным значением с июля 2017 года.

РЫНОК КОРПОРАТИВНЫХ ОБЛИГАЦИЙ

На конец февраля в официальном списке KASE находились 272 выпуска корпоративных облигаций 72 эмитентов.

В официальный список KASE был включен один выпуск международных облигаций XS2106835262 (BRKZe10) АО "Банк Развития Казахстана".

Объем корпоративного долга в обращении в феврале вырос на 0,3 % или 42,1 млрд тенге до 12,9 трлн тенге.

Значение индекса доходности корпоративных облигаций KASE_BMY выросло на 3 базисных пункта до 10,72 % годовых.

Объем торгов корпоративными облигациями на KASE снизился относительно января на 41,8 % или 24,6 млрд тенге до 34,3 млрд тенге.

В феврале на первичном рынке корпоративных облигаций были размещены четыре выпуска на общую сумму 30,6 млрд тенге, что на 30,6 % или 13,5 млрд тенге ниже показателя января:

- АО "Ипотечная организация "Баспана" привлекло 15,8 млрд тенге и 13,4 млрд тенге, разместив облигации KZ2C00006336 (BASPb6) и KZ2C00006484 (BASPb8) соответственно со средневзвешенной доходностью 10,70 % годовых;
- АО "КазАгроФинанс" привлекло на KASE 07 февраля 1,0 млрд тенге, разместив облигации KZ2C00006385 (KAFIb9) под 13,00 % годовых со сроком до погашения 4,9 года;
- ТОО "ТехноЛизинг" привлекло на KASE 13 февраля 405,2 млн тенге, разместив облигации KZ2P00006299 (THLZb1) под 16,00 % годовых со сроком до погашения.

В разрезе основных категорий инвесторов на первичном рынке корпоративных облигаций доля БВУ составила 43,4 %, брокеров-дилеров – 5 %, других институциональных инвесторов – 36,9 %, прочих юридических лиц – 14,7 %, физических лиц – менее 0,1 %. Доля нерезидентов составила 1,1 %.

Объем торгов на вторичном рынке облигаций снизился на 75,4 % или 11,1 млрд тенге до 3,6 млрд тенге.

В разрезе основных категорий инвесторов на вторичном рынке корпоративных облигаций доля БВУ составила 30,4 %, брокеров-дилеров – 16,1 %, других институциональных инвесторов – 25,8 %, прочих юридических лиц – 22,5 %, доля физических лиц – 5,2 %. Доля нерезидентов составила 5,9 %.

РЫНОК ГОСУДАРСТВЕННЫХ ЦЕННЫХ БУМАГ (ГЦБ)

Номинальная стоимость торгуемого на KASE государственного долга по итогам февраля выросла на 3,1 % или 416,1 млрд тенге до 13,9 трлн тенге.

В феврале объем торгов на рынке ГЦБ снизился на 47,7 % или на 87 млрд тенге до 95,3 млрд тенге.

Объем первичного рынка составил 89,3 млрд тенге, что на 46,9 % ниже результата января. Из них 10 млрд тенге привлек акимат г. Нур-Султан, 79,3 млрд тенге под 9,50-9,65 % годовых – Министерство финансов, это меньше показателя января на 53 %. В качестве покупателей выступили БВУ, их доля составила 3,4 %, брокеры-дилеры, доля которых составила 0,8 %, другие институциональные инвесторы с долей 84,4 %, прочие юридические лица, доля которых превысила 11 %. Нерезиденты в сделках на первичном рынке не участвовали.

Объем торгов на вторичном рынке упал на 57,4 % или на 8,2 млрд тенге до 6,1 млрд тенге. Более 97 % об общего оборота торгов вторичного рынка пришлось на ноты Национального Банка. Объем сделок с ГЦБ иностранных государств достиг 166,5 млн тенге.

В структуре инвесторов на вторичном рынке наибольшая доля – 48 % пришлась на долю БВУ, 8,1 % – на долю брокеров-дилеров, 5,6 % – на долю других институциональных инвесторов, 38,2 % составила доля прочих юридических лиц, участие физических лиц не превышает 1 %. Нерезиденты в торгах участие не принимали.

ОБЛИГАЦИИ МФО

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

В отчетном месяце сделок в данном секторе заключено не было.

ПАИ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ФОНДОВ

На 01 марта в секторе "Ценные бумаги инвестиционных фондов" торговались 11 инструментов под управлением восьми компаний.

В отчетном месяце объем торгов составил 402,9 млн тенге и вырос относительно января в 3,9 раза или на 299,1 млн тенге.

Инструмент	Объем, млн KZT	Кол-во сделок
US_BIL_	240,1	7
CSECFE	73,7	7
CSECGM	43,1	9
FFIN_or	40,4	2
US_SPY_	4,9	8
IE_FXBF	0,7	21
	402,9	54

В разрезе основных категорий инвесторов 54,8 % приходится на физические лица, 30,5 % – на брокеров-дилеров и 14,7 % – на прочих юридических лиц.

СЧЕТА ФИЗИЧЕСКИХ ЛИЦ НА ФОНДОВОМ РЫНКЕ

По состоянию на 01 марта 2020 года в Центральной депозитарии числилось 118 773 лицевых счетов, открытых на физические лица, что на 1 141 счет больше, чем месяцем ранее и на 1 949 счетов больше чем на начало 2019 года.

РЫНОК ИНОСТРАННЫХ ВАЛЮТ

Объем торгов на рынке иностранных валют составил 797,8 млрд тенге, что ниже показателя предыдущего месяца на 11,9 % или 107,4 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 объеме торгов, %	в Число сделок	Мин. и макс. курсы, кол-во котируемой валюты за ед. базовой	Курс на конец месяца (изм.%)
USD/KZT	2 097,7 (-11,5 %)	99,4 % (+0,24 %)	5 937 (-842)	375,94 – 381,19	381,19 (+0,56 %)
RUB/KZT	396,2 (+8,4 %)	0,3 % (+0,04 %)	67 (+6)	5,6976 – 6,0027	5,6976 (-5,31 %)
CNY/KZT	18,7 (-65,8 %)	0,1 % (-0,20 %)	37 (-1)	53,4087 – 54,3150	54,5840 (-0,49 %)

Пара	Объем, млн единиц валюты	Доля объеме торгов, %	в Число сделок	Мин. и макс. курсы, кол-во котируемой валюты за ед. базовой	Курс на конец месяца (изм.%)
EUR/KZT	3,5 (-37,7 %)	0,2 % (-0,08 %)	19 (-10)	406,00 – 421,30	417,90 (+0,34 %)

ДЕНЕЖНЫЙ РЫНОК

К концу февраля индикатор TONIA (средневзвешенная процентная ставка по сделкам открытия РЕПО сроком на один рабочий день) вырос на 110 б.п., с 9,14 % до 10,24 % годовых, значение индикатора TWINA (средневзвешенная процентная ставка по сделкам открытия РЕПО сроком на семь рабочих дней) продемонстрировало также увеличение на 51 б.п., с 9,24 % до 9,75 % годовых.

Индикатор KazPrime-3M (KZT) остался неизменным на протяжении всего февраля и составил 10,25 % годовых, также остались неизменными индикаторы KIBOR.

Доходность операции однодневного долларowego свопа SWAP-1D (USD) на конец февраля достигла значения 10,69 % годовых, увеличившись за месяц на 212 б.п. Доходность операции двухдневного свопа SWAP-2D (USD) возросла на 179 б.п. до 10,34 % 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 увеличился на 114 б.п., с 9,11 % до 10,25 % годовых.

Рынок операций репо

Объем торгов в данном сегменте составил 8 032,3 млрд тенге, что больше показателя прошлого месяца на 1 791,2 млрд тенге или на 28,70 %.

98,10 % от общего объема сделок открытия репо пришлось на сделки 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 с корзиной ГЦБ составила 97,04 %.

Рынок валютного свопа

Объем торгов на рынке операции валютного свопа снизился на 442,1 млрд тенге или на 34,29 %, с 1 731,4 млрд тенге до 1 289,3 млрд тенге. 100 % объем операций валютного свопа составил доллар США. В инструментальной структуре 61,6 % от общего объема торгов на рынке валютного свопа пришлось на сделки с двухдневным валютным свопом (USDKZT_0_002).

В феврале были заключены операции с "длинными" валютными свопами на один месяц общей суммой 26,42 млрд. тенге.

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 феврале сделок с фьючерсами заключено не было. К началу марта открытые позиции участников торгов на рынке деривативов отсутствовали.

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.