



ПРЕСС-РЕЛИЗ

г. Алматы

12 августа 2019 года

KASE представляет итоги работы биржевого рынка в июле 2019 года

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

- Совокупный объем торгов на KASE в июле 2019 года составил 9 693,5 млрд тенге и вырос относительно июня 2019 года на 2,5 % или 239,9 млрд тенге
- Положительную динамику продемонстрировали рынок ценных бумаг (+18,3 % или +111,4 млрд тенге) и рынок денег (+8 % или +586,3 млрд тенге). Объем торгов на рынке иностранных валют снизился на 30,3 % или 457,8 млрд тенге
- На рынке ценных бумаг рост зафиксирован в следующих секторах:
 - акции – в 11 раз;
 - ГЦБ – на 30 %;
 - облигаций МФО – на 25 %.
- В июле 2019 года в официальный список Биржи были включены 13 выпусков облигаций 8 эмитентов
- На 01 августа 2019 года в торговых списках KASE находились ценные бумаги 428 наименований 176 эмитентов
- По итогам июля 2019 года значение Индекса KASE снизилось на 0,7 % и составило 2 273,64 пунктов
- Объем первичных размещений в секторе корпоративных облигаций составил 203,1 млрд тенге
- По состоянию на 01 августа 2019 года в Центральной депозитарии числилось 119 687 лицевых счетов, открытых на физических лиц, что на 293 счета больше, чем месяцем ранее и на 2 863 счета больше чем на начало 2019 года.

РЫНОК АКЦИЙ

По итогам июля капитализация рынка акций выросла на 0,8 % или 126,8 млрд тенге до 15,9 трлн тенге. На конец месяца в торговых списках KASE находились акции 138 наименований 123 эмитентов, из них два выпуска допущены к обращению в секторе нелистинговые ценные бумаги.

Относительно июня объем торгов акциями вырос в 11 раз или на 40,6 млрд тенге до 44,5 млрд тенге. Среднедневной объем торгов составил 2 млрд тенге, среднее количество сделок – 479, средний объем одной сделки – 4,2 млн тенге. Столь значительный рост произошел по причине заключения крупных сделок нерегулярного характера.

Среди основных категорий инвесторов доля физических лиц составила 38,6 % от суммарного объема сделок с акциями. Доля брокеров-дилеров – 29,5 %, доля других институциональных инвесторов – 8,1 %, доля прочих юридических лиц достигла 23,9 %. Банки второго уровня (БВУ) в торгах акциями не участвовали. Участие нерезидентов оценивается в 15,7 %.

ИНДЕКС KASE

Индекс KASE завершил июль снижением на 0,7 %, или на 15,36 пунктов до 2 273,64 пунктов.

Изменение цен акций, входящих в представительский список KASE

Эмитент	Торговый код	Изменение цены		
		на 01.07.2019	на 01.08.2019	в июле
АО "Народный сберегательный банк Казахстана"	HSBK	116,70	132,55	+13,58%
АО "Казахтелеком"	KZTK	24 205,00	24 510,01	+1,26%
АО "КазТрансОйл"	KZTO	1 071,16	1 049,99	-1,98%
АО "KEGOC"	KEGC	1 613,99	1 563,00	-3,16%
АО "Банк ЦентрКредит"	CCBN	242,45	230,01	-5,13%
KAZ Minerals PLC	GB_KZMS	2 963,98	2 779,11	-6,24%
АО "Кселл"	KCEL	2 049,70	1 920,00	-6,33%

Драйвером роста Индекса стали простые акции АО "Народный сберегательный банк Казахстана", которые выросли на 13,58 % до 132,55 тенге. Положительная новость об обновлении дивидендной политики банка, опубликованная в конце июня, позволила котировкам акций банка постепенно расти до середины отчетного месяца.

Наибольшее снижение продемонстрировали акции АО "Кселл". К концу июля долевые инструменты компании потеряли 6,33 % от цены закрытия июня. Согласно пресс-релизу компании, чистый объем продаж в первом полугодии вырос на 0,5 % до 73 049 млн тенге; операционная прибыль, без учета единовременных расходов – на 40,9 % и составила 14 313 млн тенге; компания зафиксировала чистый убыток в размере 5 881 млн тенге; абонентская база снизилась до 8 676 тысяч пользователей, как результат реализации стратегии по привлечению качественных клиентов и ухода от дистрибуции, основанной на объемах.

Снижение на 6,24 % продемонстрировали котировки долевых инструментов KAZ Minerals PLC. Неопределенность вокруг исхода торговых войн создает риски для роста мировой экономики, что продолжает держать инвесторов в состоянии напряжения. Беспокойство участников рынка касательно достаточности спроса на медь со стороны Китая значительно увеличили волатильность цен акций производственной компании. 25 июля меднодобывающая компания представила производственные результаты деятельности за первое полугодие 2019 года, в котором отразила рост производства меди на 6 % в сравнении с аналогичным периодом прошлого года до 147,6 тонн. Во втором квартале увеличение технической готовности обогатительных фабрик привело к росту производства меди до 77,6 тыс. тонн. Согласно тексту пресс-релиза, компания на пути к достижению запланированного на 2019 год объема производства меди около 300 тыс. тонн. Публикация финансовых результатов за январь-июнь 2019 года ожидается 15 августа.

В течение месяца котировки простых акций АО "Банк ЦентрКредит" преимущественно двигались в боковом тренде. Основная часть июльского падения прошла в конце месяца на фоне публикации прогноза по рейтингам банка. 23 июля компания сообщила о подтверждении рейтинговых оценок на уровне "В/В" и пересмотре прогноза на "Негативный" агентством Standard & Poor's. Согласно материалам рейтингового агентства, прогноз "Негативный" по рейтингам банка отражает сохраняющийся значительный объем проблемных кредитов, выданных в прошлые периоды, что негативно влияет на его показатели капитализации и качество активов. 24 июля цена акций банка снизилась на 2,91 % в сравнении с уровнем закрытия предыдущего торгового дня.

В условиях отсутствия значимых корпоративных новостей в июле котировки акций АО "KEGOC" продолжили движение по нисходящему тренду. 31 июля 2019 года агентство Moody's Investors Service подтвердило долгосрочный рейтинг эмитента на уровне "Baa3", со стабильным прогнозом.

РЫНОК КОРПОРАТИВНЫХ ОБЛИГАЦИЙ

Объем корпоративного долга в обращении в июле вырос на 2 % или 230,5 млрд тенге, достигнув отметки 11,8 трлн тенге.

На конец июля в официальном списке KASE находились 254 выпуска корпоративных облигаций 65 эмитентов. В отчетном месяце в официальный список включены 11 выпусков облигаций шести эмитентов и исключены из официального списка пять выпусков четырех эмитентов.

Значение индекса доходности корпоративных облигаций KASE_BMY выросло в июле на 5 базисных пунктов до 10,74 % годовых.

Объем торгов корпоративными облигациями на KASE снизился относительно июня на 12,6 % или 31,8 млрд тенге до 220,8 млрд тенге. Среднедневной объем торгов составил 10 млрд тенге, среднедневное количество сделок – 14, средний объем одной сделки – 728,7 млн тенге.

В июле на первичном рынке в секторе корпоративных облигаций были размещены шесть выпусков на общую сумму 203,1 млрд тенге, что на 26,7 % или 42,7 млрд тенге выше показателя июня:

- АО "Ипотечная организация "Баспана" привлекло 28,3 млрд тенге, разместив коммерческие облигации BASPb3 со средневзвешенной доходностью 10,2685 % годовых;
- АО "АстанаГаз КМГ" привлекло 102 млрд тенге, разместив десятилетние облигации AKMGb2 под 10 % годовых;
- АО "Банк Развития Казахстана" привлекло 41 млрд тенге, разместив пятилетние облигации BRKZb16 под 10,27 % годовых;
- АО "Жилищный строительный сберегательный банк Казахстана" привлекло 20 млрд тенге, разместив семилетние облигации JSBNb1 под 10,27 % годовых;
- АО "Ипотечная организация "Казахстанская Ипотечная Компания" привлекло 10,8 млрд тенге, разместив облигации KZIKb27 под 10,27 % годовых со сроком до погашения 8,4 года;
- АО "Оптово-розничное предприятие торговли" привлекло 900 млн тенге, разместив семилетние облигации ORPTb1 под 10,5 % годовых.

В разрезе основных категорий инвесторов на первичном рынке корпоративных облигаций доля банков составила 57,6 %, брокеров-дилеров – 3,5 %, на долю других институциональных инвесторов пришлось 37,2 %, прочих юридических лиц – 1,7 %. Доля нерезидентов составила 50,2 %.

Объем торгов на вторичном рынке облигаций снизился на 80,8 % или 74,5 млрд тенге до 17,7 млрд тенге.

В разрезе основных категорий инвесторов на вторичном рынке корпоративных облигаций доля БВУ составила 39,3 %, брокеров-дилеров – 7,3 %, других институциональных инвесторов – 43,1 %, прочих юридических лиц – 4,5 %, доля физических лиц – 5,8 %. Доля нерезидентов – 5,8 %.

РЫНОК ГЦБ

Номинальная стоимость торгуемого на KASE государственного долга в июле выросла на 1,8 % или 219,3 млрд тенге до 12,3 трлн тенге.

В июле объем торгов на рынке ГЦБ вырос на 30,1 % или 88,1 млрд тенге до 380,8 млрд тенге. Среднедневной объем торгов сложился на уровне 17,3 млрд тенге, среднедневное количество сделок – 3, средний объем одной сделки – 6,2 млрд тенге.

На первичном рынке ГЦБ объем сделок вырос на 36 % или 92,3 млрд тенге до 348,8 млрд тенге. Весь объем пришелся на облигации Министерства финансов, которое разместило

четыре выпуска долгосрочных облигаций под 8,46–8,71 % годовых и на 100 % был выкуплен институциональными инвесторами.

Объем торгов на вторичном рынке снизился на 11,6 % или 4,2 млрд тенге до 32 млрд тенге. 96,9 % об общего оборота торгов вторичного рынка пришлось на ноты Национального Банка.

В структуре инвесторов на вторичном рынке на долю БВУ пришлось 44,5 %, на долю брокеров-дилеров – 4,7 %, на долю других институциональных инвесторов – 30,6 %, доля прочих юридических лиц составила 20,2 %, доля физических лиц – 0,1 %. Нерезиденты в торгах участие не принимали.

ОБЛИГАЦИИ МФО

На конец отчетного периода в торговых списках KASE находилось 28 выпусков облигаций пяти международных финансовых организаций: Евразийского банка развития, Европейского банка реконструкции и развития, Европейского инвестиционного банка, Международной финансовой корпорации и Азиатского банка развития.

В течение июля в сектор "Ценные бумаги МФО" были включены два выпуска облигаций: один выпуск восьмилетних международных облигаций Европейского банка реконструкции и развития, который был размещен в рамках подписки с маржой к полугодовому купону 0,5 % на 60 млрд тенге и выпуск пятилетних облигаций Азиатского банка развития, который был размещен в рамках подписки на 15,4 млрд тенге с маржой к квартальному купону 0,375 %.

В структуре инвесторов на первичном рынке на долю институциональных инвесторов пришлось 93,4 %, на долю юридических лиц – 6,6 %. Нерезиденты в торгах не участвовали.

Объем торгов на вторичном рынке составил 20,3 млн тенге. 50 % от брутто-оборота торгов пришлось на сделки, заключенные брокерско-дилерскими компаниями, и 50 % – доля доугих институциональных инвесторов.

ПАИ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ФОНДОВ

На 01 августа в секторе "Ценные бумаги инвестиционных фондов" находились семь инструментов под управлением шести компаний.

Объем торгов снизился на 57,3 % и составил 58,4 млн тенге. Лидерами по объему сделок выступают паи US_SPY_ (36,5 млн тенге; 8 сделок) под управлением State Street Global Advisors, на втором и третьем местах CSECfe (15,9 млн KZT; 4 сделки) и CSECgm (5 млн KZT; 1 сделка) под управлением АО "Сентрас Секьюритиз",.

В разрезе основных категорий инвесторов 24 % приходится на физические лица, 32,1 % – на брокеров-дилеров, 24,8 % – на других институциональных инвесторов и 19 % на прочих юридических лиц.

СЧЕТА ФИЗИЧЕСКИХ ЛИЦ НА ФОНДОВОМ РЫНКЕ

По состоянию на 01 августа 2019 года в Центральной депозитарии числилось 119 687 лицевых счетов, открытых физическими лицами, что на 293 счета больше, чем месяцем ранее и на 2 863 счета больше чем на начало 2019 года

РЫНОК ИНОСТРАННЫХ ВАЛЮТ

В июле в торгах на рынке иностранных валют KASE принимали участие 30 членов KASE.

Объем торгов на рынке иностранных валют составил 1 050,8 млрд тенге, что ниже показателя предыдущего месяца на 30,3 % или 457,8 млрд тенге. Среднедневной объем торгов составил 47,8 млрд тенге, среднедневное количество сделок – 382, средний объем одной сделки – 124,9 млн тенге.

В июле номинальный курс тенге к доллару ослаб на 1 %, тем самым вернувшись к уровню начала года. Риски затяжной торговой войны между двумя крупнейшими экономиками мира негативным образом воздействуют на котировки сырьевых товаров, в первую очередь – нефти. К концу июля цена эталонной марки Brent теряет более двух процентов. 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	2 721,1 (-30,8 %)	99,4 % (-0,23 %)	8 253 (-2 508)	380,71 – 385,10	384,21 (+1,0 %)
RUB/KZT	374,8 (-16,9 %)	0,2 % (+0,04 %)	63 (-13)	6,0237 – 6,1153	6,0547 (+0,2 %)
CNY/KZT	23,0 (+22,9 %)	0,1 % (+0,05 %)	64 (+20)	55,6154 – 55,9800	55,7801 (+0,9 %)
EUR/KZT	5,9 (+55,5 %)	0,2 % (+0,13 %)	30 (+9)	428,40 – 433,58	428,90 (-0,8 %)

ДЕНЕЖНЫЙ РЫНОК

К концу июля индикатор TONIA снизился на 77 б.п. до 8,27 % годовых, в то время как значение индикатора TWINA (средневзвешенная процентная ставка по сделкам открытия репо сроком на семь рабочих дней) продемонстрировало снижение на 27 б.п. до 8,34 % годовых.

Доходность однодневного долларowego свопа SWAP-1D (USD) на конец июля достигла 7,91 % годовых, прибавив за месяц на 82 б.п. Доходность двухдневного свопа SWAP-2D (USD) выросла на 38 б.п. до 8,27 % годовых.

В июле индикатор KazPrime-3M (KZT) продолжил свое движение на верхней границе базовой ставки Национального Банка на уровне 10 % 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 июля снизился на 41 б.п. до 8,22 % годовых.

Рынок операций репо

Объем торгов в данном сегменте составил 5 283,4 млрд тенге, что выше показателя прошлого месяца на 6,7 %. Среднедневной объем операций составил 240,2 млрд тенге, среднее количество сделок – 358, средний объем одной сделки – 671 млн тенге.

97,1 % 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 89,6 %.

Всего в июле в сделках на рынке репо принимали участие 42 члена Биржи. Более 89 % от общего оборота торгов в данном сегменте заняли банки. Доля участия нерезидентов в отчетном месяце была незначительна и составила 0,9 %.

Рынок валютного свопа

Объем торгов на рынке валютного свопа вырос на 10,6 % до 2 637,8 млрд тенге. Среднедневной объем операций составил 119,9 млрд тенге, среднее количество сделок – 41, средний объем одной сделки – 2,9 млрд тенге. В инструментальной структуре 81,1 % от общего объема торгов (2,1 трлн тенге или 5,6 млрд USD) на рынке валютного свопа пришлось на сделки с двухдневным валютным свопом (USDKZT_0_002).

В июле было заключено 17 сделок с "длинными" валютными свопами – десять сделок с недельными свопами на сумму 88 млн долларов США (33,8 млрд тенге) под 7,1–8,3 % годовых; и семь сделок со свопами на месяц на сумму 70 млн долларов США (26,9 млрд тенге) под 7,5–8,2 % годовых.

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 июле сделок с фьючерсами заключено не было. К началу августа 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.