

ПРЕСС-РЕЛИЗ

г. Алматы

14 марта 2022 года

KASE представляет итоги работы биржевого рынка за февраль 2022 года

АО "Казахстанская фондовая биржа" (далее – KASE, Биржа) информирует об основных итогах деятельности за февраль 2022 года:

- Совокупный объем торгов на KASE в феврале 2022 года составил 18,1 трлн тенге и снизился относительно января на 8,0 % или 1,6 трлн тенге.
- По итогам февраля значение Индекса KASE снизилось на 5,3 % и составило 3 361,98 пункта.
- По итогам февраля капитализация рынка акций снизилась на 13,3 % до 23,1 трлн тенге, объем торгуемого корпоративного долга – на 2,7 % до 15,0 трлн тенге.
- По состоянию на 01 марта 2022 года в торговых списках KASE находились негосударственные ценные бумаги 561 наименования 229 эмитентов.
- По состоянию на 01 марта 2022 года в Центральной депозитарии ценных бумаг числилось 290 932 лицевых счета, открытых на 269 872 физических лица. По итогам февраля физическими лицами зарегистрировано 71 230 новых лицевых счетов.

КЛЮЧЕВЫЕ ПРОЕКТЫ И МЕРОПРИЯТИЯ

10 февраля 2022 года состоялась церемония закрытия 13-го ежегодного конкурса KASE "Биржевой симулятор". По итогам конкурса определены 13 победителей из восьми вузов. Общий объем торгов в рамках проекта превысил 5,1 млрд тенге. Всего было заключено 5 944 сделки. Максимальный объем торгов на одного участника составил 544 млн тенге, а максимальное количество сделок на одного участника – 522.

- 15 февраля 2022 года в прямом эфире на странице Биржи в Instagram прошел KASE Talks с участием Ернара Жанадил, управляющего директора по приватизации и развитию – члена правления АО "Самрук-Қазына". Тема эфира: "В преддверии IPO компаний АО "Самрук-Қазына".
- 21 февраля 2022 года KASE в рамках проекта "День эмитента" провела онлайн-встречу с руководством АО "Кселл" на тему "Обзор результатов деятельности Компании за 2021 год, обзор коммерческих тенденций и стратегических планов развития АО "Кселл".
- 25 февраля 2022 года KASE провела вебинар для начинающих инвесторов "Pro IPO: что нужно знать и как участвовать". Спикерами онлайн-семинара выступили: Шынар Елубаева, главный специалист Департамента по работе с эмитентами и инвесторами KASE; Шолпан Айнабаева, Председатель Правления "SkyBridge Invest", Мария Пан, директор Департамента продаж "Halyk Finance".

РЫНОК АКЦИЙ

По итогам февраля капитализация рынка акций составила 23,1 трлн тенге (49,6 млрд USD), что на 3,5 трлн тенге или 13,3 % ниже аналогичного показателя предыдущего месяца. Снижение

обусловлено корректировкой цен акций в последние дня февраля, связанной с обострением геополитической ситуации и ростом волатильности фондовых рынков.

На конец февраля в торговых списках KASE находились акции 164 наименований 150 компаний, из них акции трех наименований трех эмитентов допущены к обращению в секторе "нелистинговые ценные бумаги".

Объем торгов акциями в феврале относительно января вырос на 3,4 % и составил 10,3 млрд тенге. При этом количество заключенных сделок выросло на 28,9 % до 51 217. Среднедневной объем торгов составил 515,7 млн тенге, среднее количество сделок – 2 561, средний объем одной сделки – 201,4 тыс. тенге. Торги акциями в феврале проходили исключительно на вторичном рынке.

Среди основных категорий инвесторов на долю физических лиц пришлось 52,5 % от суммарного объема сделок с акциями. Доля брокеров-дилеров составила 18,1 %. На долю других институциональных инвесторов пришлось 22,4 %, прочих юридических лиц – 7,0 %. Участие нерезидентов оценивается в 1,4 %.

ИНДЕКС KASE

Развитие локального рынка акций в феврале продолжали определять внешние политические факторы. В динамике Индекса KASE в течение месяца сменилось три выраженных периода: с 01 по 10 февраля Индекс KASE продолжал развивать набранный в конце января положительный тренд, в период с 11 по 21 февраля рынок перешел в горизонтальный тренд, а с 22 февраля – в красную зону.

С начала месяца снижением цены отметились все акции представительского списка Индекса KASE, за исключением АО "Национальная атомная компания "Казатомпром".

Значение Индекса KASE с начала февраля снизилось на 5,3 % до 3 361,98 пункта – уровня октября 2021 года.

Объем сделок с индексными акциями в феврале составил 6,2 млрд тенге, что на 8,8 % или 0,6 млрд тенге ниже аналогичного показателя за январь. Наибольший объем торгов пришелся на простые акции АО "Народный сберегательный банк Казахстана" – 3,7 млрд тенге (59,4 % от общего объема торгов с индексными акциями).

Эмитент	Торговый код	Цена, тенге за акцию			Объем торгов, млн тенге		
		на 01.03.22	на 01.02.22	Δ, %	февраль	январь	Δ
АО "Национальная атомная компания "Казатомпром"	KZAP	14 869,00	14 165,00	5,0	346,4	215,7	+130,7
АО "KEGOC"	KEGC	1 853,22	1 862,00	-0,5	54,6	52,3	+2,3
АО "Kcell"	KCEL	1 701,00	1 739,99	-2,2	421,3	2 930,7	-2 509,4
АО "Банк ЦентрКредит"	CCBN	375,01	403,00	-6,9	79,5	1 635,5	-1 556,0
АО "КазТрансОйл"	KZTO	1 050,00	1 129,00	-7,0	446,5	1 245,5	-799,1
АО "Народный сберегательный банк Казахстана"	HSBK	133,99	152,99	-12,4	3 663,9	613,4	+3 050,6
АО "Казактелеком"	KZTK	31 000,00	35 399,00	-12,4	1 157,9	72,2	+1 085,7

Единственным представителем индексной корзины, акции которого по итогам месяца закрылись в зеленой зоне является АО "Национальная атомная компания "Казатомпром". Ценные бумаги прибавили за месяц 5,0 %.

Наименьшее снижение за месяц зафиксировано в цене акций АО "KEGOC" на 0,5%.

Акции АО "Kcell" снизились на 2,2%. В ходе Дня эмитента Kcell, прошедшего 21 февраля, оператор сотовой связи озвучил финансовые результаты за 2021 год. Консолидированный чистый доход компании вырос с прошлого года на 84,9 % до 32,5 млрд тенге, из которых 21,5 млрд тенге Совет директоров компании рекомендует направить на выплату дивидендов.

В пересчете на одну акцию дивиденды могут составить 107,5 тенге. Дивидендная доходность, соответственно, оценивается ориентировочно в 6,3 % годовых.

Наибольшее снижение по итогам месяца зафиксировано в акциях АО "Казахтелеком" и АО "Народный сберегательный банк Казахстана". Ценные бумаги обеих компаний снизились в цене на 12,4 %.

СЕКТОР "KASE GLOBAL"

На конец февраля в торговых списках Биржи в секторе "KASE Global" находились акции 43 эмитентов с основным листингом на ведущих американских площадках.

В феврале в секторе "KASE Global" объем торгов составил 1,8 млрд тенге и вырос относительно января на 20,1 % или 0,3 млрд тенге. Среднедневной объем торгов составил 89,7 млн тенге, среднедневное количество сделок – 161, средний объем одной сделки – 557,7 тыс. тенге.

Наибольший объем торгов в феврале пришелся на следующие акции:

- Meta Platforms, Inc. – 247 сделок на общую сумму 229,7 млн тенге;
- Advanced Micro Devices, Inc. – 181 сделка на общую сумму 165,4 млн тенге;
- Micron Technology, Inc. – 73 сделки на общую сумму 137,1 млн тенге.

Среди основных категорий инвесторов на долю физических лиц пришлось 29,9 % от суммарного объема сделок с акциями. Доля брокеров-дилеров составила – 58,8 %. На долю других институциональных инвесторов пришлось 4,3 %, прочих юридических лиц – 7,1 %. Участие нерезидентов оценивается в 0,6 %.

КОРПОРАТИВНЫЕ ОБЛИГАЦИИ

Объем корпоративного долга в обращении в феврале 2022 года снизился на 2,7 % или 417,0 млрд тенге до 15,0 трлн тенге (32,0 млрд USD).

На конец февраля 2022 года в официальном списке KASE находились корпоративные облигации 324 выпуска 82 эмитентов. За февраль 2022 года в официальный список Биржи были включены облигации пяти выпусков от четырех эмитентов, в том числе двух новых: два выпуска Дочернего банка АО "Хоум Кредит энд Финанс Банк" и по одному выпуску АО Дочерний Банк "Альфа-Банк", ТОО "МФО "Арнур Кредит" и ТОО "SilkNetCom". В феврале 2022 года из официального списка KASE были исключены корпоративные облигации Lloyds Bank PLC в связи с досрочным погашением.

Значение индекса доходности корпоративных облигаций KASE_BMY в феврале 2022 года повысилось на 29 базисных пунктов до 10,75 % годовых.

Объем торгов корпоративными облигациями на Бирже вырос относительно января 2022 года в 3,3 раза до 91,8 млрд тенге. Среднедневной объем торгов составил 4,6 млрд тенге (на вторичном рынке – 4,1 млрд тенге), среднедневное количество – 57 сделок (на вторичном рынке – 56 сделок), средний объем одной сделки – 80,4 млн тенге (на вторичном рынке – 74,0 млн тенге).

В феврале 2022 года объем первичного рынка корпоративных облигаций составил 9,5 млрд тенге, что выше показателя января 2022 года в 5,3 раза или на 7,7 млрд тенге.

- АО "Казахстанская Жилищная Компания" привлекло на KASE 1,3 млрд тенге, разместив 30-летние облигации под 0,1 % годовых;
- Дочерний банк АО "Хоум Кредит энд Финанс Банк" привлек на Бирже 6,2 млрд тенге, разместив трехлетние облигации и двухлетние облигации с доходностью к погашению 12,80 % годовых;
- ТОО "Микрофинансовая организация ОнлайнКазФинанс" привлекло на KASE 1,5 млрд тенге, разместив облигации с доходностью к погашению 17,50 % годовых и сроком до погашения 2,7 года;

- ТОО "МФО "Swiss Capital (Свисс Капитал)" привлекло на Бирже 504,7 млн тенге, разместив облигации с доходностью к погашению 19,99 % годовых и сроком до погашения 2,7 года;
- ТОО "Микрофинансовая организация "R-Finance" привлекло на KASE 548,0 тыс. тенге, разместив облигации под 18,00 % годовых.

В разрезе основных категорий инвесторов на первичном рынке корпоративных облигаций доля брокерско-дилерских организаций составила 21,2 %, других институциональных инвесторов – 36,2 %, прочих юридических лиц – 42,6 %, физических лиц – менее 0,1 %. Нерезиденты на первичном рынке корпоративных облигаций участие не принимали.

Объем торгов на вторичном рынке облигаций относительно января 2022 года вырос в 3,1 раза или на 53,0 млрд тенге до 82,4 млрд тенге.

В разрезе основных категорий инвесторов на вторичном рынке корпоративных облигаций доля банков второго уровня (БВУ) составила 1,0 %, брокерско-дилерских организаций – 2,2 %, других институциональных инвесторов – 8,0 %, прочих юридических лиц – 87,1 %, доля физических лиц – 1,7 %. Доля нерезидентов составила 12,6 %

ГОСУДАРСТВЕННЫЕ ЦЕННЫЕ БУМАГИ (ГЦБ)

Сумма государственного долга по номиналу, торгуемого на KASE, составила 17,7 трлн тенге (37,8 млрд USD), повысившись за февраль на 2,3 % или 395,7 млрд тенге.

Суммарный объем торгов ГЦБ на KASE составил 333,2 млрд тенге и вырос относительно января на 41,2 % или 97,2 млрд тенге. По итогам февраля 2022 года средневзвешенный объем торгов составил 16,7 млрд тенге (на вторичном рынке – 6,1 млрд тенге), средневзвешенное количество сделок – 11 (на вторичном рынке – 8), средний объем одной сделки – 1,5 млрд тенге (средний объем одной сделки на вторичном рынке – 0,7 млрд тенге).

Объем торгов на первичном рынке ГЦБ вырос на 25,9 % или на 43,6 млрд тенге до 212,0 млрд тенге. Весь объем пришелся на размещение казначейских обязательств Министерства финансов Республики Казахстан. Всего было размещено восемь выпусков облигаций под 10,70-11,10 % годовых (средневзвешенная доходность – 10,73-11,10 % годовых).

В разрезе основных категорий инвесторов на первичном рынке на долю БВУ пришлось 5,6 %, брокеров-дилеров – 1,1 %, других институциональных инвесторов – 75,2 %, доля прочих юридических лиц составила 18,1 %. Нерезиденты на первичном рынке ГЦБ участие не принимали.

Объем торгов на вторичном рынке вырос на 79,3 % или на 53,6 млрд тенге и достиг 121,2 млрд тенге. Доля торгов нотами Национального банка на вторичном рынке составила 7,8 % или 9,5 млрд тенге от общего объема торгов, доля МЕКАМ – 81,6 % или 98,9 млрд тенге, доля еврооблигаций Республики Казахстан – 7,7 % или 9,4 млрд тенге. Остальной объем, составляющий 2,8 % (3,4 млрд тенге), пришелся на сделки с ГЦБ иностранных государств (облигации Министерства финансов США, Украины, Турецкой Республики и Австрийской Республики).

В разрезе основных категорий инвесторов на вторичном рынке на долю БВУ пришлось 7,2 %, на долю брокеров-дилеров – 2,0 %, на долю других институциональных инвесторов – 2,9 %, доля прочих юридических лиц составила 87,5 %, на долю физических лиц пришлось 0,3 %. Участие нерезидентов оценивается в 8,9 %.

ОБЛИГАЦИИ МЕЖДУНАРОДНЫХ ФИНАНСОВЫХ ОРГАНИЗАЦИЙ (МФО)

На конец февраля в торговых списках KASE находились облигации 43 выпусков четырех международных финансовых организаций: Евразийского банка развития, Европейского банка реконструкции и развития, Международной финансовой корпорации и Азиатского банка развития.

В феврале в сектор "Ценные бумаги международных финансовых организаций" официального списка Биржи включен один выпуск облигаций Азиатского банка развития. В том же месяце из официального списка исключены три выпуска облигаций в связи с истечением срока обращения: один выпуск Азиатского банка развития и два выпуска Евразийского банка развития.

В отчетном месяце объем торгов составил 16,0 млрд тенге против 9,2 млрд тенге месяцем ранее, увеличившись на 6,8 млрд тенге или 73,5 %.

На первичном рынке сектора облигаций международных финансовых организаций был размещен один выпуск Азиатского банка развития на общую сумму 14,0 млрд тенге с доходностью к погашению 11,00 % годовых

В разрезе основных категорий инвесторов на первичном рынке доля институциональных инвесторов составила 35,7 %, прочих юридических лиц – 64,3 %.

На вторичном рынке объем торгов составил 2,0 млрд тенге, что на 78,0 % или 7,2 млрд тенге ниже, чем месяцем ранее.

В разрезе основных категорий инвесторов на вторичном рынке облигаций международных финансовых организаций доля БВУ составила 42,3 %, брокеров-дилеров – 2,3 %, других институциональных инвесторов – 47,9 %, прочих юридических лиц – 7,5 %.

ПАИ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ФОНДОВ

На 01 марта 2022 года в секторе "Ценные бумаги инвестиционных фондов" находились 19 инструментов паевых инвестиционных фондов под управлением шести управляющих компаний и шесть ETF.

В отчетном месяце объем торгов составил 916,1 млн тенге и снизился относительно января 2022 года на 57,5 % или 1,2 млрд тенге.

В разрезе основных категорий инвесторов 47,7 % приходится на физические лица, 36,0 % – на брокеров-дилеров, 3,4 % – на других институциональных инвесторов, 12,9 % – на прочих юридических лиц. Доля нерезидентов составила 0,3 %.

ПРОИЗВОДНЫЕ ЦЕННЫЕ БУМАГИ

По состоянию на 01 марта 2022 года в официальном списке KASE находились глобальные депозитарные расписки (ГДР) пяти выпусков, базовыми активами которых являются простые акции АО "Национальная атомная компания "Казатомпром", АО "Народный сберегательный банк Казахстана", АО Kaspi.kz, АО "Казахтелеком" и АО "ForteBank".

Объем торгов в феврале 2022 года составил 8,8 млрд тенге и вырос относительно января 2022 года в 3,1 раза или на 5,9 млрд тенге.

В разрезе основных категорий инвесторов 43,7 % пришлось на счета физических лиц, 0,7 % – на брокерско-дилерские организации, 47,4 % – на других институциональных инвесторов и 8,2 % – на прочих юридических лиц. Доля нерезидентов составила менее 0,1 %.

СЧЕТА ФИЗИЧЕСКИХ ЛИЦ НА РЫНКЕ ЦЕННЫХ БУМАГ

По состоянию на 01 марта 2022 года в Центральной депозитарии числилось 290 932 лицевых счета, открытых на 269 872 физических лица. По итогам февраля физическими лицами зарегистрировано 71 230 новых лицевых счетов.

РЫНОК ИНОСТРАННЫХ ВАЛЮТ

В феврале текущего года в торгах на рынке иностранных валют на KASE принимало участие 30 членов KASE.

Объем торгов на рынке иностранных валют в феврале достиг 1,3 трлн тенге, прибавив с января 1,9 % или 23,6 млрд тенге. Среднедневной объем торгов составил 62,8 млрд тенге, среднедневное количество сделок – 325, средний объем одной сделки – 193,3 млн тенге.

В таблице ниже 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 февраля (изм.%)
USD/KZT	2 800,24 (+0,5 %)	97,9 % (-0,3 %)	6 220 (+135)	426,10 – 495,00	495,00 (+14,18 %)
RUB/KZT	2 526,80 (-16,3 %)	1,1 % (-0,2 %)	168 (-13)	5,4207-5,7068	5,4207 (-3,17 %)
CNY/KZT	59,54 (-17,9%)	0,3 % (-0,1 %)	92 (+26)	66,8389 – 74,0680	73,9700 (+8,37 %)
EUR/KZT	15,43 (x19,2)	0,6 % (+0,6 %)	15 (+5)	487,00 – 496,26	487,00 (+0,67 %)

ДЕНЕЖНЫЙ РЫНОК

Совокупный объем торгов на рынке денег в феврале достиг 16,4 трлн тенге, снизившись относительно показателя января на 9,7 %, или на 1,8 трлн тенге.

24 февраля Комитет по денежно-кредитной политике Национального банка Республики Казахстан принял решение установить базовую ставку на уровне 13,5% годовых с процентным коридором +/- 1,00 п.п. Соответственно, ставка по операциям постоянного доступа по предоставлению ликвидности составит 14,5% годовых, а по операциям постоянного доступа по изъятию ликвидности – 12,5 % годовых.

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, увеличился на 357 б.п. с 11,01 % годовых до 14,58 % годовых.

РЫНОК ОПЕРАЦИЙ РЕПО

Совокупный объем операций репо в феврале 2022 года составил 15,6 трлн тенге, что меньше объемов января 2022 года на 1,6 трлн тенге или на 9,5 %. Среднедневной объем операций снизился до 781,1 млрд тенге (-234,5 млрд тенге), при этом среднедневное количество ежедневных заключенных сделок, напротив, выросло до 904 (+67), средний объем одной сделки – 864,2 млн тенге (-348,8 млн тенге).

Объем операций авторепо с ГЦБ составил 11,4 трлн тенге или 72,8 %, авторепо с НЦБ – 4,2 трлн тенге или 27,2 %, прямое репо с НЦБ – 2,2 млрд тенге или 0,01 %, прямое репо с ГЦБ – 29,5 млн тенге или менее 0,01 %.

По итогам февраля 2022 года индикатор TONIA вырос на 345 б.п. с 11,02 % до 14,47 % годовых, значение индикатора TRION – на 349 б.п. с 10,98 % до 14,47 % годовых, значение индикатора TWINA - на 300 б.п. с 11,20% до 14,20% годовых.

ОПЕРАЦИИ ВАЛЮТНОГО СВОПА

Совокупный объем операций валютного свопа в феврале уменьшился на 119,2 млрд тенге или на 13,1 % до 791,0 млрд тенге с 910,2 млрд тенге в январе. Среднедневной объем операций в феврале 2022 года составил 39,5 млрд тенге (-14,0 млрд тенге), среднедневное количество сделок – 13 (-4), средний объем одной сделки – 3,1 млрд тенге (-0,2 млрд тенге).

В инструментальной структуре 82,0 % от общего объема торгов (648,3 млрд тенге или 1 456,4 млн USD) на рынке валютного свопа пришлось на сделки с однодневным валютном

свопом (USDKZT_0_001), 10,2 % от общего объема торгов (80,5 млрд тенге или 183,9 млн USD) на рынке валютного свопа пришлось на сделки с двухдневным валютным свопом (USDKZT_0_002), 7,8 % от общего объема торгов (62,2 млрд тенге или 142,0 млн USD) с месячным валютным свопом (USDKZT_01M).

Доходность однодневного долларowego свопа SWAP-1D (USD) на конец февраля достигла 15,47 % годовых и выросла за февраль на 469 б.п. Доходность двухдневного валютного свопа SWAP-2D (USD) увеличилась на 492 б.п. до 15,48 % годовых.

РЫНОК ДЕРИВАТИВОВ

В настоящий момент в данном секторе биржевого рынка к торговле доступны беспоставочные фьючерсы на курс доллара США к тенге, простые акции АО "Народный сберегательный банк Казахстана", простые акции АО "НАК "Казатомпром" и Индекс KASE.

В феврале 2022 года в данном секторе сделок 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 пятое место по объему 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.