

ПРЕСС-РЕЛИЗ

г. Алматы

14 апреля 2021 года

KASE представляет итоги работы биржевого рынка за первый квартал 2021 года

АО "Казахстанская фондовая биржа" (KASE, Биржа) информирует об основных итогах деятельности за первый квартал 2021 года.

- Совокупный объем торгов на KASE за три месяца 2021 года составил 35,6 трлн тенге и вырос относительно аналогичного периода 2020 года на 11,1 % или 3,6 трлн тенге.
- Значение Индекса KASE выросло на 16,3 % до 3 112,32 пункта, зафиксировав в первом квартале очередной исторический максимум.
- Капитализация рынка акций выросла на 12,2 % или 2,3 трлн тенге до 21,4 трлн тенге.
- С начала года в официальный список KASE были включены ценные бумаги 15 наименований десяти эмитентов, два из них впервые прошли процедуру листинга.
- По состоянию на 01 апреля 2021 года в торговых списках KASE находились негосударственные ценные бумаги 466 наименований 186 эмитентов.
- По состоянию на 01 апреля 2021 года в Центральной депозитарии числилось 150 180 лицевых счетов, открытых на физические лица, что на 17 319 счетов больше, чем на начало 2021 года.

КЛЮЧЕВЫЕ ПРОЕКТЫ И МЕРОПРИЯТИЯ

В рамках реализации стратегии развития KASE на 2019–2021 годы в первом квартале 2021 года Биржа реализовала следующие проекты и провела следующие мероприятия:

- В январе 2021 года KASE представила для широкого круга пользователей мобильное приложение "KASE Mobile". Приложение дополняет список информационных продуктов Биржи и предназначено прежде всего для упрощения доступа к биржевой информации для розничных и профессиональных инвесторов. В приложении также доступна функция участия в учебных торгах на KASE.
- Биржа запустила в эксплуатацию новую версию системы обмена документами с эмитентами и членами Биржи "Issuers to investors" (система is2in), в которой реализован электронный формат предоставления услуг по листингу ценных бумаг, аккредитации аудиторских организаций, предоставлению членства на Бирже профессиональным участникам рынка.
- KASE увеличила срок операций репо, осуществляемых автоматическим способом, с 30 до 90 дней в целях обеспечения наличия инструментов для привлечения финансирования под залог ценных бумаг на более длительные сроки.
- Обучающие мероприятия

В целях повышения осведомленности о деятельности биржевого рынка KASE, а также о возможностях привлечения капитала на казахстанском фондовом рынке, Биржа продолжила выпуск на радио "Business FM" обучающей передачи "Фондовый рынок с KASE" и новостной передачи "Биржевые новости KASE".

Биржа провела вебинар "Основы фондового рынка" в рамках глобального проекта Global Money Week, направленного на повышение финансовой грамотности школьников и студентов. В вебинаре приняли участие студенты Университета KIMEP, Алматинского Технологического Университета, Университета "Туран", Казахстанско-Британского технического университета, Казахского Национального Университета имени Аль-Фараби, Международного университета информационных технологий, Евразийского национального университета имени Л.Н. Гумилева, Казахстанско-Немецкого Университета, Алматы Менеджмент Университета.

С 01 апреля по 31 мая 2021 года Биржа проводит первый этап конкурса "Биржевой симулятор", в котором за первую неделю зарегистрировалось 1 669 студентов из более 40 вузов и регистрация продолжается. Проект "Биржевой симулятор" реализуется с 2008 года. За 12 лет в нем приняли участие более 8,5 тыс. студентов из 80 вузов Казахстана, а также стран ближнего и дальнего зарубежья.

Проведены открытые лекции в рамках проекта "KASE Talks" с участием Нурдаулета Айдосова и Сергея Лукьянова.

– Мероприятия для бизнеса

В рамках проекта "День эмитента" на KASE были организованы онлайн встречи руководства акимата г. Шымкент, Азиатского Банка Развития с инвесторами, профессиональными участниками рынка ценных бумаг и представителями СМИ, посвященные выпуску ценных бумаг.

В целях развития площадки KASE StartUp была проведена встреча с ТОО "1Fit", получившим допуск на данную площадку.

По итогам 2020 года KASE провела награждение членов Биржи, продемонстрировавших наилучшие результаты на биржевых рынках KASE, листинговых компаний – за стремление к прозрачности, а также представителей СМИ – за активное освещение фондового рынка в печатных изданиях и на интернет-ресурсах.

– Международное сотрудничество

В рамках реализации Инициативы ООН "Устойчивые Фондовые Биржи" (Sustainable Stock Exchanges Initiative) в этом году уже в четвертый раз Биржа провела церемонию открытия торгов Ring the Bell for Gender Equality, а также онлайн-мероприятие "Инклюзивное лидерство: новая реальность в бизнесе".

РЫНОК АКЦИЙ

Капитализация рынка акций с начала года выросла на 12,2 % или 2,3 трлн тенге и составила 21,4 трлн тенге (50,4 млрд USD) за счет значительного роста цен на акции некоторых наименований, в частности акции АО "НК "Казатомпром" на 48 % и KAZ Minerals PLC на 41 %.

На конец марта 2021 года в торговых списках KASE находились акции 138 наименований 122 эмитентов, в том числе на нелистинговой площадке – акции трех компаний.

В 2021 году в официальный список KASE включены простые акции нового эмитента АО "Жалтырбулак". При этом из торгового списка Биржи исключены простые акции пяти наименований: из официального списка – простые акции Tiffany & Co по заявлению инициатора допуска указанных акций о добровольном делистинге по причине поглощения эмитента указанных акций компанией LVMH MOET HENNESSY; простые акции АО "Fincraft Capital" по инициативе их эмитента; простые акции АО "AsiaCredit Bank (АзияКредит Банк) по причине лишения банка лицензии на проведение банковских и иных операций и осуществление деятельности на рынке ценных бумаг; из сектора "нелистинговые ценные бумаги" – простые акции АО "Қазақстан Мақтасы" и АО "Национальная компания "Продовольственная контрактная корпорация" в связи с отсутствием сделок с данными акциями.

Объем торгов акциями за три месяца 2021 года составил 46,4 млрд тенге и вырос относительно первого квартала 2020 года на 82,9 % или 21 млрд тенге. Среднедневной объем торгов составил 814,5 млн тенге, среднее количество сделок – 1 381, средний объем одной сделки – 589,8 тыс. тенге.

Объем первичного рынка оценивается в 852 млн тенге. В разрезе инвесторов 87,1 % от объема торгов пришлось на юридические лица и 12,9 % на физические лица. Участие нерезидентов оценивается в 14,9 %.

Объем торгов на вторичном рынке акций увеличился на 79,5 % по сравнению с аналогичным периодом прошлого года и составил 45,6 млрд тенге.

Среди основных категорий инвесторов на вторичном рынке доля физических лиц составила 48,3 % от общего оборота сделок с акциями. Доля брокеров-дилеров составила 14,6 %, доля других институциональных инвесторов – 5 %, доля прочих юридических лиц достигла 32,1 %. Банки второго уровня (БВУ) в сделках вторичного рынка акций участия не принимали. Участие нерезидентов оценивается в 3, %.

ИНДЕКС KASE

С начала года Индекс KASE вырос на 16,3 %, или 436,74 пункта до 3 112,32 пункта, впервые за время своего существования превысив отметку 3 000 пунктов и обновив абсолютный исторический максимум. Предыдущие пиковые значения Индекса KASE фиксировались в августе 2007 и марте 2008 годов на уровнях 2 800–2 900 пунктов.

Общий объем торгов индексными акциями составил 14 млрд тенге или 31 % от общего объема торгов.

Изменение цен акций, входящих в представительский список Индекса KASE

Эмитент	Торговый код	Изменение цены		
		01.01.2021	01.04.2021	с начала года
АО "Казатомпром"	KZAP	7 150,00	10 599,91	+48,3 %
KAZ Minerals PLC	GB_KZMS	3 502,00	4 940,00	+41,1 %
АО "Народный сберегательный банк Казахстана"	HSBK	123,99	150,24	+21,2 %
АО "КазТрансОйл"	KZTO	970,00	1 117,00	+15,2 %
АО "Банк ЦентрКредит"	CCBN	215,64	235,60	+9,3 %
АО "Казахтелеком"	KZTK	26 700,00	27 040,00	+1,3 %
АО "KEGOC"	KEGC	1 697,00	1 677,11	-1,2 %
АО "Kcell"	KCEL	2 760,00	2 398,00	-13,1 %

За отчетный период лидерами роста среди представителей индексной корзины стали простые акции **АО "Казатомпром"**, выросшие в цене на 48,3 % до 10 599,91 тенге за акцию. Долевые бумаги атомной компании последовательно росли на протяжении всего анализируемого периода на фоне положительных корпоративных новостей компании. В марте АО "Казатомпром" предоставило финансовые результаты за 2020 год, согласно которым чистая прибыль компании по МСФО за 2020 год повысилась на 3,6 % и составила 221,4 млрд тенге. Консолидированная выручка группы составила 587,5 млрд тенге, увеличившись на 17 % по сравнению с 2019 годом, в основном за счет увеличения средней цены реализации, связанного с ростом спотовой цены на U3O8. Операционная прибыль по итогам 2020 года составила 223,899 млрд тенге, увеличившись на 47 % в связи с увеличением средней цены реализации и наращиванием доли собственного урана, произведенного консолидированными дочерними предприятиями и совместными операциями компании.

Второе место по темпам роста занимают простые акции **KAZ Minerals PLC**, подорожавшие с начала года на 41,1 % до 4 940 тенге за акцию. Акции меднодобывающей компании до конца февраля отыгрывали положительный фон, вызванный ростом фьючерсов на медь до уровней 10-летних максимумов. KAZ Minerals также предоставила неаудированные результаты деятельности за 2020 год, согласно которым, компания за отчетный год увеличила показатель EBITDA на 5,6 % до \$1,431 млрд. Кроме того, чистая задолженность группы снизилась на 5,7 % до \$2,601 млрд благодаря высокому денежному потоку от операционной деятельности во втором полугодии и более низкому, чем ожидалось, уровню капитальных затрат за весь год – \$584 млн.

Высокие темпы роста демонстрируют также акции **АО "Народный сберегательный банк Казахстана"**, подорожавшие в первый квартал на 21,2 % до 150,24 тенге за акцию. Фундаментальным фактором для роста цен акций банка послужили опубликованные консолидированные финансовые результаты за 2020 год, согласно которым чистая прибыль увеличилась на 5,4 % до 352,7 млрд тенге по сравнению с 334,5 млрд тенге в 2019 году. Чистая прибыль увеличилась в основном за счет увеличения чистого дохода от страховой деятельности и прибыли от производных инструментов и ценных бумаг (ЦБ), отмечает компания. Активы банка в 2020 году увеличились на 12,5 % до 10,388 трлн тенге за счет роста депозитов и капитала. Обязательства выросли на 12,2 % до 8,895 млрд тенге, собственный капитал на 14,2 %, до 1,493 млрд тенге, уставный капитал не изменился и составил 209,027 млрд тенге.

Снижение цены на 13,1 % зафиксировано по простым акциям **АО "Кселл"**. Акции компании начали нисходящий тренд в первую торговую неделю февраля и продолжили его практически до конца квартала. Рыночная стоимость компании снижалась несмотря на выход финансовой отчетности за

2020 год, согласно которой оператор связи в минувшем году увеличил чистую прибыль по МСФО в 1,8 раза до 17,6 млрд тенге. Однако, численность абонентской базы сократилась на 2,7 % до 8,055 млн абонентов. Чистый объем продаж вырос на 11,5 % и составил 174,7 млрд тенге. Доход от услуг увеличился на 1,8 % до 140,1 млрд тенге.

КОРПОРАТИВНЫЕ ОБЛИГАЦИИ

Объем корпоративного долга в обращении с начала года снизился на 1,1 % или 164,4 млрд тенге до 14,5 трлн тенге (34,3 млрд USD).

На конец марта в официальном списке KASE находился 271 выпуск корпоративных облигаций 69 эмитентов. С начала года в официальный список KASE были включены десять выпусков корпоративных облигаций шести эмитентов (один новый): по одному выпуску АО "НУХ "Байтерек", АО "Фонд развития промышленности", АО "Национальная компания "Продовольственная контрактная корпорация", ТОО "Микрофинансовая организация аФинанс", два выпуска облигаций ТОО "ТехноЛизинг" и четыре выпуска АО "Казахстанский фонд устойчивости".

Из официального списка KASE были исключены 20 выпусков корпоративных облигаций: по одному выпуску АО "Народный сберегательный банк Казахстана", АО "Кселл", ТОО "Казахстанские коммунальные системы", четыре выпуска АО "Фонд национального благосостояния "Самрук-Қазына" – в связи с истечением срока обращения, по два выпуска АО "Казахстанская Жилищная Компания", АО "Национальный управляющий холдинг "Байтерек" и выпуск ТОО "Амангельды Газ – в связи с их аннулированием, выпуск международных облигаций ТОО "Исткомтранс" и выпуск АО "Народный сберегательный банк Казахстана" – в связи с их досрочным погашением, выпуск АО "Haluk Finance" – по инициативе их эмитента, пять выпусков АО "AsiaCredit Bank (АзияКредит Банк)" – в связи с лишением эмитента лицензии на проведение банковских и иных операций и осуществление деятельности на рынке ценных бумаг

Значение индекса доходности корпоративных облигаций KASE_BMY снизилось на 11 базисных пунктов до 10,65 % годовых.

Объем торгов корпоративными облигациями на KASE вырос относительно трех месяцев 2020 года на 98,7 % или 285,5 млрд тенге до 574,8 млрд тенге. Среднедневной объем торгов составил 10,1 млрд тенге (на вторичном рынке – 4,6 млрд тенге), среднедневное количество сделок – 21 (на вторичном рынке – 15), средний объем одной сделки – 485,9 млн тенге (на вторичном рынке – 303,6 млн тенге).

В первом квартале на первичном рынке в секторе корпоративных облигаций были размещены 14 выпусков облигаций девяти эмитентов на общую сумму 312,2 млрд тенге, что на 34,1 % или 79,4 млрд тенге выше соответствующего показателя прошлого года:

- АО "Казахстанский фонд устойчивости" привлекло 158,1 млрд тенге, разместив шесть выпусков облигаций (KFUSb4, KFUSb5, KFUSb8, KFUSb9, KFUSb10, KFUSb11) с доходностью к погашению 10,00–10,77 % годовых (средневзвешенная доходность по выпускам варьировала в диапазоне 10,16–10,70 % годовых);
- АО "KEGOC" привлекло 8,6 млрд тенге, разместив облигации со средневзвешенной доходностью к погашению 11,62 % годовых и сроком до погашения 14,3 лет;
- АО "Казахстанская Жилищная Компания" привлекло 29,2 млрд тенге, разместив пятилетние облигации с доходностью к погашению 11,00 % годовых;
- АО "Национальный управляющий холдинг "Байтерек" привлекло 50,0 млрд тенге, разместив десятилетние облигации с доходностью к погашению 11,00 % годовых;
- АО "Фонд развития промышленности" привлекло 50,0 млрд тенге, разместив десятилетние облигации с доходностью к погашению 11,50 % годовых;
- АО "Национальная компания "Продовольственная контрактная корпорация" привлекло 1,75 млрд рублей (10,0 млрд тенге), разместив рублевые пятилетние облигации под 8,99 % годовых;
- ТОО "Capital Leasing Group (Капитал Лизинг Груп)" привлекло 1,3 млрд тенге, разместив облигации с доходностью к погашению 18,00 % годовых и сроком до погашения 2,8 года;
- АО "Аграрная кредитная корпорация" привлекло 4,6 млрд тенге, разместив облигации со средневзвешенной доходностью 10,23 % годовых и сроком до погашения 295 дней;

- ТОО "Микрофинансовая организация "R-Finance" привлекло 400,7 млн тенге, разместив трехлетние облигации с доходностью к погашению 20,00 % годовых.

В разрезе основных категорий инвесторов на первичном рынке корпоративных облигаций доля БВУ составила 33,6 %, брокерско-дилерских организаций – 5,8 %, других институциональных инвесторов – 20,3 %, прочих юридических лиц – 39,8 %, физических лиц – 0,5 %. Доля участия нерезидентов составила 0,5 %.

Объем торгов на вторичном рынке облигаций вырос в 4,6 раз или 206,1 млрд тенге до 262,6 млрд тенге.

В разрезе основных категорий инвесторов на вторичном рынке корпоративных облигаций доля БВУ составила 2,5 %, брокерско-дилерских организаций – 3 %, других институциональных инвесторов – 34,2 %, прочих юридических лиц – 59,6 %, доля физических лиц – 0,7 %. Доля нерезидентов составила 6,1 %.

ГОСУДАРСТВЕННЫЕ ЦЕННЫЕ БУМАГИ (ГЦБ)

Номинальная стоимость, торгуемого на KASE государственного долга, выросла с начала года на 6,8 % или 1,1 трлн тенге до 17,9 трлн тенге (42,1 млрд USD).

В первом квартале объем торгов на рынке ГЦБ вырос на 11,2 % или на 93,2 млрд тенге до 924,7 млрд тенге. Количество сделок составило 536 (на вторичном рынке – 244), средний объем одной сделки – 1,7 млрд тенге (средний объем одной сделки на вторичном рынке – 817,6 млн тенге).

Объем первичного рынка составил 725,2 млрд тенге, что на 35,9 % выше результата аналогичного периода прошлого года. Из них 702 млрд тенге привлекло Министерство финансов под 8,99–10,40 % годовых (средневзвешенная доходность по выпускам – 9,25–10,30 % годовых) в рамках размещений пятнадцати облигационных выпусков. В марте акиматом Туркестанской области в рамках реализации государственной программы "Дорожная карта занятости на 2020-2021 годы" под 6,07 % годовых было привлечено 20,2 млрд тенге и акиматом г. Шымкент в целях финансирования дефицита бюджета под 10,80 % годовых – 2,8 млрд тенге.

В разрезе основных категорий инвесторов на первичном рынке на долю БВУ пришлось 70,9 %, брокеров-дилеров – 0,2 %, других институциональных инвесторов – 16,3 %, доля прочих юридических лиц составила 12,6 %. Доля нерезидентов в общем объеме торгов на первичном рынке составила 2,9 %.

Объем торгов на вторичном рынке по итогам первого квартала снизился на 33 % или на 98,3 млрд тенге до 199,5 млрд тенге с 297,8 млрд тенге. Объем торгов с МЕКАМ составил 118,2 млрд тенге или 59 % от объема торгов на вторичном рынке ГЦБ, с нотами Национального Банка – 75,2 млрд тенге или 38 %. Оставшийся объем, составляющий 6 млрд тенге или 3 % пришелся на сделки с еврооблигациями Республики Казахстан и с ГЦБ иностранных государств.

В разрезе основных категорий инвесторов на вторичном рынке на долю БВУ пришлось 48,3 %, на долю брокеров-дилеров – 2,3 %, на долю других институциональных инвесторов – 24,3 %, доля прочих юридических лиц составила 24,9 %, на долю физических лиц пришлось 0,1 %. Участие нерезидентов оценивается в 13,6 %.

ОБЛИГАЦИИ МЕЖДУНАРОДНЫХ ФИНАНСОВЫХ ОРГАНИЗАЦИЙ

На конец отчетного периода в торговых списках KASE находилось 35 выпусков облигаций четырех международных финансовых организаций: Евразийского банка развития, Европейского банка реконструкции и развития, Международной финансовой корпорации (IFC) и Азиатского банка развития.

В первом квартале 2021 года в сектор "Ценные бумаги международных финансовых организаций" официального списка KASE включены два выпуска облигаций Азиатского банка развития, целевым назначением которых является инвестирование проектов, нацеленных на снижение гендерного неравенства и содействие расширению прав и возможностей женщин и девочек. Также, за этот период из официального списка KASE в связи с истечением срока обращения был исключен выпуск облигаций Международной финансовой корпорации.

За истекший период 2021 года объем торгов составил 31,9 млрд. тенге, что выше результата аналогичного периода 2020 года в 39 раз или на 31,1 млрд тенге.

Весь объем первичного рынка пришелся на размещения Азиатского банка развития, который в рамках подписки разместил два выпуска своих облигаций под 9,95 % и 10,15 % годовых со сроком погашения 5,1 лет и 9,8 лет соответственно.

В разрезе основных категорий инвесторов на первичном рынке доля БВУ составила 13 %, других институциональных инвесторов – 50,3 %, прочих юридических лиц – 36,7 %.

Объем торгов на вторичном рынке составил 14,4 млрд тенге, что в 18 раз превышает объем рынка в первом квартале 2020 года.

В разрезе основных категорий инвесторов на вторичном рынке облигаций МФО доля БВУ составила 25 %, брокеров-дилеров – 23,2 %, других институциональных инвесторов составила 50 %, и прочих юридических лиц – 1,8 %.

ПАИ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ФОНДОВ

На 01 апреля в секторе "Ценные бумаги инвестиционных фондов" находились 13 паевых инвестиционных фондов под управлением шести управляющих компаний и четыре ETF

Объем торгов за три месяца 2021 года составил 17,3 млрд тенге и вырос относительно первого квартала 2020 года в 28 раз.

Инструмент	Объем, млн KZT	Кол-во сделок
RU_UKFFipo	14 842,1	4 054
FHJlag	818,5	20
CSECfe	352,8	37
FFIN_or	350,3	223
FHJlpc	310,4	14
CSECgm	189,8	32
IE_FXBF	137,0	556
US_BIL_	115,0	24
BCClrb	109,8	2
US_SPY_	52,3	226
US_GLD_	8,9	2
FHJllq	6,4	4
	17 295,6	5 307

В разрезе основных категорий инвесторов 40,6 % приходится на брокеров-дилеров, 0,2 % – на других институциональных инвесторов, 8,9 % – на прочих юридических лиц и 50,4 % приходится на физические лица.

СЧЕТА ФИЗИЧЕСКИХ ЛИЦ НА РЫНКЕ ЦЕННЫХ БУМАГ

По состоянию на 01 апреля 2021 года в Центральной депозитарии числилось 150 180 лицевых счетов, открытых на физических лиц, что на 17 319 счетов больше, чем на начало 2021 года.

РЫНОК ИНОСТРАННЫХ ВАЛЮТ

В первом квартале 2021 года в торгах на рынке иностранных валют на KASE принимали участие 31 член KASE. В отчетном периоде на рынке принимали участие три брокера АО "Казпочта", АО "Freedom Finance" и АО "CAIFC INVESTMENT GROUP", доля их участия в брутто обороте составила 0,5 %.

Объем торгов в первом квартале на рынке иностранных валют составил 3,1 трлн тенге, что ниже аналогичного периода прошлого года на 3,2 % или 99,7 млрд тенге. Среднедневной объем торгов в первом квартале составил 53,8 млрд тенге, среднедневное количество сделок – 384, средний объем одной сделки – 140,2 млн тенге.

В нижеследующей таблице приводятся основные характеристики торгуемых на KASE валютных пар (изменение объема, доли в объеме торгов, числа сделок указано относительно аналогичного периода прошлого года; изменение курса отражает номинальное изменение средневзвешенного биржевого курса иностранной валюты к тенге к началу года).

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 периода (изм.%)
USD/KZT	7 128,40 (-10,0 %)	97,6 % (-1,0 %)	20 854 (+206)	414,10 – 425,90	424,97 (+1,0 %)
RUB/KZT	5 574,08 (-0,1 %)	1,0 % (+0,04 %)	598 (+385)	5,5430 – 5,7500	5,6142 (-1,3%)
CNY/KZT	346,53 (x3,0)	0,7 % (+0,5 %)	344 (+207)	64,2100 – 65,6700	64,6687 (-0,1 %)
EUR/KZT	36,42 (x3,2)	0,6 % (+0,4%)	70 (+13)	500,00 – 514,10	500,00 (-2,2%)

ДЕНЕЖНЫЙ РЫНОК

Совокупный объем торгов на рынке денег составил 30,9 трлн тенге, увеличившись относительно показателя прошлого месяца на 11,5 % или на 3,2 трлн тенге.

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 103 б.п. до 9,28 % годовых к концу марта 2021 года.

Рынок операций РЕПО

Объем торгов в данном сегменте в первом квартале 2021 года составил 27,7 трлн тенге, что больше объема аналогичного периода 2020 на 17,4 % или на 4,1 трлн тенге. Среднедневной объем операций составил 485,4 млрд тенге, среднее количество сделок – 433, средний объем одной сделки – 1,1 млрд тенге.

Объем торгов авторепо с корзиной ГЦБ составил 24,7 трлн тенге или 89,4 % от общего объема репо, с корзиной ОДГУ – 639,5 млрд тенге или 2,3 %, с НЦБ 2,3 трлн тенге или 8,3 %, прямое репо с НЦБ – 18,1 млрд тенге или 0,1 % и прямое репо с ГЦБ – 6,6 тыс. тенге.

К концу марта индикатор TONIA (средневзвешенная процентная ставка по сделкам открытия репо сроком на один рабочий день, заключенным на Бирже в секторе автоматического репо с ценными бумагами Корзины ГЦБ) увеличился на 105 б.п. с 8,25 % до 9,3 % годовых.

Индикатор TRION (средневзвешенная процентная ставка по сделкам открытия репо сроком на один рабочий день, заключенным на Бирже в течение дня в секторе автоматического репо с ценными бумагами Корзины ГЦБ, по которым Биржа осуществляет клиринговую деятельность использованием услуг Центрального контрагента) увеличился на 109 б.п. с 8,25 % до 9,34 % годовых.

Индикатор TWINA (средневзвешенная процентная ставка по сделкам открытия репо сроком на семь рабочих дней, заключенным на Бирже в секторе автоматического репо с ценными бумагами Корзины ГЦБ, по которым Биржа осуществляет клиринговую деятельность использованием услуг Центрального контрагента) увеличился на 30 б.п. с 8,6 % до 8,9 % годовых.

Волатильность индикаторов операций репо TONIA, TRION и TWINA в первом квартале динамично колебалась в рамках коридора базовой ставки Национального банка Республики Казахстан. Динамика волатильности традиционно увеличивались в налоговые периоды и в периоды объявления карантинных ограничений как реакция на снижение деловой активности в перспективе.

Рынок операций валютного свопа

Объем торгов в первом квартале 2021 года на рынке операции валютного свопа составил 3,2 трлн тенге, что меньше на 931,7 млрд тенге или на 22,6 % относительно первого квартала 2020 года.

Среднедневной объем операций в первом квартале 2021 года составил 56,1 млрд тенге, среднедневное количество сделок – 12, средний объем одной сделки – 4,8 млрд тенге.

В инструментальной структуре 56,9 % от общего объема на рынке операций валютного свопа пришлось на сделки с однодневным валютным свопом (USDKZT_0_001), 38,9 % – на сделки с двухдневным валютным свопом (USDKZT_0_002), 3,7 % – на сделки с месячным валютным свопом (USDKZT_0_01M) и 0,4 % – на сделки с недельным валютным свопом (USDKZT_0_01W).

Доходность однодневного долларowego свопа SWAP-1D (USD) на конец марта достигла 8,52 % годовых, увеличившись с начала года на 25 б.п. Доходность двухдневного валютного свопа SWAP-2D (USD) увеличилась на 40 б.п. до 8,39 % годовых.

РЫНОК ДЕРИВАТИВОВ

В секторе биржевого рынка доступны фьючерсы, базовыми активами которых являются доллар США, индекс KASE и отдельные наименования акций. К началу апреля открытые позиции участников торгов на рынке деривативов отсутствовали, операции в первом квартале 2021 года 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. 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.