

ПРЕСС-РЕЛИЗ

г. Алматы

14 сентября 2021 года

KASE представляет итоги работы биржевого рынка за август 2021 года

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

- Совокупный объем торгов на KASE в августе 2021 года составил 14,9 трлн тенге и вырос относительно июля на 24,1 % или 2,9 трлн тенге.
- Значение Индекса KASE выросло на 2,8 % и составило 3 172,45 пунктов.
- Капитализация рынка акций выросла на 0,2 % до 28,4 трлн тенге, объем торгуемого корпоративного долга вырос на 0,3 % до 15,1 трлн тенге.
- По состоянию на 01 сентября 2021 года в торговых списках KASE находились негосударственные ценные бумаги 504 наименований 190 эмитентов.
- По состоянию на 01 сентября 2021 года в Центральной депозитарии числилось 188 009 лицевых счетов, открытых на физические лица, что на 6 445 счет больше, чем месяцем ранее и на 55 148 счета больше, чем на начало 2021 года.

КЛЮЧЕВЫЕ ПРОЕКТЫ И МЕРОПРИЯТИЯ

27 августа 2021 года для информирования бизнес-сообщества и заинтересованной общественности KASE совместно с Фондом развития предпринимательства "Даму" и акиматами Актыубинской и Кызылординской областей провели онлайн круглый стол по вопросам привлечения капитала на фондовом рынке.

РЫНОК АКЦИЙ

По итогам августа капитализация рынка акций составила 28,4 трлн тенге (66,7 млрд USD), что на 49 млрд тенге или 0,2 % выше аналогичного показателя предыдущего месяца. Росту капитализации способствовало увеличение цен по акциям, входящим в корзину Индекса KASE.

На конец августа в торговых списках KASE находились акции 138 наименований 122 эмитентов, из них акции четырех наименований четырех эмитентов допущены к обращению в секторе "Нелистинговые ценные бумаги". В отчетном месяце в официальный список KASE новые акции не включались.

Объем торгов акциями в августе относительно июля снизился на 9,4 % или 1,2 млрд тенге до 12 млрд тенге. Среднедневной объем торгов составил 573,8 млн тенге, среднедневное количество сделок – 1 775, средний объем одной сделки – 323,2 тыс. тенге.

Среди основных категорий инвесторов на долю физических лиц пришлось 45,4 % от суммарного объема сделок с акциями. Доля брокеров-дилеров составила 11,4 %. На долю других институциональных инвесторов пришлось 1 %, прочих юридических лиц – 42 %. Участие нерезидентов оценивается в 4,8 %.

ИНДЕКС KASE

В августе на локальном рынке акций традиционно закончился сезон пост-дивидендного информационного затишья. Компании начинают выпускать полугодовые отчеты, на основании которых инвесторы могут спрогнозировать годовую прибыль и размер будущих дивидендов. Новый информационный импульс способствовал тому, что Индекс KASE, который находился в фазе коррекции с начала июня, перешел к боковому тренду.

Рост по итогам августа составил 2,8 % или 85,79 пункта. Объем сделок с индексными акциями в августе составил 6,2 млрд тенге, что на 33,9 % или 2,1 млрд тенге ниже аналогичного показателя за июль. Наибольший объем торгов пришелся на простые акции АО "Кселл" – 3,1 млрд тенге (49,8 % от общего объема торгов с индексными акциями).

Изменение цен акций, входящих в представительский список KASE

Эмитент	Торговый код	Цена, тенге за акцию			Объем торгов, млн тенге		
		на 01.09.21	на 01.08.21	Δ, %	июль	август	Δ
АО "Банк ЦентрКредит"	CCBN	288,00	249,00	+15,7	592,3	945,7	353,4
АО "Казахтелеком"	KZTK	33 940,00	30 000,01	+13,1	142,1	120,0	-22,1
АО "Народный сберегательный банк Казахстана"	HSBK	180,10	162,50	+10,8	578,7	1 672,5	1093,8
АО "Национальная атомная компания "Казатомпром"	KZAP	12 019,30	11 700,00	+2,7	145,0	124,4	-20,6
АО "KEGOC"	KEGC	1 808,08	1 773,00	+2,0	89,8	58,0	-31,8
АО "КазТрансОйл"	KZTO	1 021,90	1 089,99	-6,2	248,7	179,6	-69,1
АО "Kcell"	KCEL	1 340,00	1 595,00	-16,0	6 459,5	3 063,0	-3 396,5

На протяжении всего месяца поддержку индексу оказывали простые акции компаний банковского сектора – АО "Банк ЦентрКредит" и АО "Народный сберегательный банк Казахстана", выросшие в цене на 15,7 % и 10,8 % соответственно. Акции АО "Банк ЦентрКредит" торгуются на одном из самых высоких уровней за всю историю публичности – 288 тенге за штуку.

Рост цены акций АО "Народный сберегательный банк Казахстана" обусловлен ожиданиями рынка, подтвердившимися опубликованной положительной финансовой отчетностью. Чистая прибыль за полгода достигла 225 млрд тенге, что на 44,2 % выше аналогичного периода прошлого года. Также, в начале августа Банк сообщил о добровольной ликвидации дочернего банка в Республике Таджикистан – Закрытого Акционерного Общества "Халык Банк Таджикистан" с целью концентраций усилий на более экономически привлекательных направлениях.

Еще одним лидером роста по итогам прошедшего месяца стали простые акции АО "Казахтелеком", которые подорожали на 13,1 % до 33 940 тенге за штуку. Согласно опубликованной полугодовой отчетности, выручка АО "Казахтелеком" увеличилась на 15 %. В своем пресс-релизе Компания также заявила о стратегической значимости для бизнеса Группы мобильного оператора Кселл, объем продаж которого по итогам полугодия вырос на 14,6 %.

Цена на акции АО "Кселл" по итогам августа упала на 16 % до 1 340 тенге за штуку на фоне значительного предложения со стороны бывших держателей ГДР. В последний день месяца Kcell, Jusan Bank и международная платежная система Mastercard объявили о запуске совместного цифрового продукта.

Акции АО "НАК "Казатомпром" выросли за месяц на 2,7 %. Согласно финансовой отчетности компании консолидированная выручка этой группы выросла на 54 % по сравнению

с аналогичным периодом прошлого года. Выросла и цена основного товара компании – урановый фьючерс на Нью-Йоркской товарной бирже (NYMEX) достиг 33,5 долларов за фунт впервые с июня 2020 года на фоне роста мирового интереса к ядерной энергетике.

РЫНОК КОРПОРАТИВНЫХ ОБЛИГАЦИЙ

Объем корпоративного долга в обращении в августе вырос на 0,3 % или 47,6 млрд тенге до 15,1 трлн тенге (35,4 млрд USD).

На конец августа в официальном списке KASE находились корпоративные облигации 299 выпусков 72 эмитентов. В отчетном месяце в официальный список были включены корпоративные облигации пяти выпусков от четырех эмитентов (один новый): по одному выпуску АО "KEGOC", АО "КазАгроФинанс", АО "Казына Капитал Менеджмент", два АО "Казахстанская Жилищная Компания". В августе из официального списка исключены корпоративные облигации двух выпусков в связи с истечением срока обращения: АО "FIVE BROKERS' CAPITAL" и Дочерняя организация АО Банк ВТБ (Казахстан).

Значение индекса доходности корпоративных облигаций KASE_BMY в августе снизилось на 15 базисных пунктов до 10,21 % годовых, с начала года снизился на 55 б.п.

Объем торгов корпоративными облигациями на KASE вырос относительно июля в 2,3 раза или 109,1 млрд тенге до 194,8 млрд тенге. Среднедневной объем торгов составил 9,3 млрд тенге (на вторичном рынке – 5,8 млрд тенге), среднедневное количество сделок – 34 сделки (на вторичном рынке – 32 сделки), средний объем одной сделки – 269,5 млн тенге (на вторичном рынке – 181,9 млн тенге).

На первичном рынке корпоративных облигаций были размещены облигации шести выпусков четырех эмитентов на общую сумму 73,3 млрд тенге, что выше показателя июля на 60 % или 27,5 млрд тенге:

- АО "Казахстанский фонд устойчивости" привлекло 19,9 млрд тенге, разместив облигации двух выпусков с доходностью к погашению 9,82–9,85 % годовых (средневзвешенная доходность по выпускам варьировала в диапазоне 9,84–9,85 % годовых);
- Дочерняя организация АО Банк ВТБ (Казахстан) привлекла 12 млрд тенге, разместив облигации двух выпусков с доходностью к погашению 11,0–11,1 % годовых (средневзвешенная доходность по выпускам варьировала в диапазоне 11,04–11,10 % годовых) и сроком до погашения 2,8–3 года;
- АО "КазАгроФинанс" привлекло 40 млрд тенге, разместив семилетние облигации с доходностью к погашению 11,90 % годовых;
- Дочерний банк АО "Хоум Кредит энд Финанс Банк" привлек 1,4 млрд тенге, разместив облигации со средневзвешенной доходностью к погашению 12,5 % годовых и сроком до погашения 1,3 года.

В разрезе основных категорий инвесторов на первичном рынке корпоративных облигаций доля БВУ составила 18,4 %, брокерско-дилерских организаций – 17,2 %, других институциональных инвесторов – 24,3 %, прочих юридических лиц – 40,1 %, физических лиц – менее 0,1 %. Доля участия нерезидентов составила 19 %.

Объем торгов на вторичном рынке облигаций относительно июля вырос в 3 раза или 81,6 млрд тенге до 121,5 млрд тенге.

В разрезе основных категорий инвесторов на вторичном рынке корпоративных облигаций доля БВУ составила 1,3 %, брокерско-дилерских организаций – 22,1 %, других институциональных инвесторов – 25,5 %, прочих юридических лиц – 50 %, доля физических лиц – 1,1 %. Доля нерезидентов составила 7,2 %.

РЫНОК ГОСУДАРСТВЕННЫХ ЦЕННЫХ БУМАГ (ГЦБ)

Номинальная стоимость торгуемого на KASE государственного долга по итогам августа снизилась на 1,2 %, или 214,9 млрд тенге до 17,9 трлн тенге (42 млрд USD).

Объем торгов на рынке ГЦБ в августе составил 172 млрд тенге и снизился относительно июля 2021 года на 50,7 %, или 176,8 млрд тенге, при этом на вторичном рынке объем торгов вырос, в то время как на первичном рынке наблюдался спад. Среднедневной объем торгов составил 8,2 млрд тенге (на вторичном рынке – 3,2 млрд тенге), среднее количество сделок – 12 (на вторичном рынке – 10 сделок), средний объем одной сделки – 687,9 млн тенге (на вторичном рынке – 317,1 млн тенге).

На первичном рынке ГЦБ объем привлечений составил 103,8 млрд тенге и снизился на 67,2 % или 212,5 млрд тенге относительно июля 2021 года. Из указанного объема 83,7 % или 86,9 млрд тенге пришлось на сделки с МЕКАМ с доходностью к погашению 10,25–10,80 % годовых (средневзвешенная доходность по выпускам – 10,36–10,78 % годовых). Оставшиеся 16,9 млрд тенге или 16,3 % привлекли акимат Акмолинской области под 4,25 % годовых в целях финансирования строительства жилья в рамках реализации государственных и правительственных программ и акимат города Алматы под 9,9 % годовых в целях финансирования дефицита бюджета.

В структуре инвесторов на первичном рынке ГЦБ на долю БВУ пришлось 24,4 %, на долю брокерско-дилерских организаций – 0,1 %, на долю других институциональных инвесторов – 67,1 %, физических лиц – 8,5 %. Участие нерезидентов оценивается в 1,3 %.

Объем торгов на вторичном рынке вырос в 2,1 раза или 35,7 млрд тенге до 68,2 млрд тенге. Доля объема сделок с МЕКАМ составила 60,5 % или 41,2 млрд тенге от общего оборота торгов вторичного рынка, 24,4 % или 16,6 млрд тенге пришлось на сделки с нотами Национального Банка, 15,1 % или 10,3 млрд тенге пришлось на сделки с еврооблигациями Республики Казахстан. Оставшийся объем, составляющий 50,4 млн тенге или 0,1 % пришелся на сделки с ГЦБ иностранных государств.

В структуре инвесторов на вторичном рынке на долю БВУ пришлось 14,1 %, на долю брокерско-дилерских организаций – 25,2 %, на долю других институциональных инвесторов – 5,7 %, доля прочих юридических лиц составила 54,2 %, доля физических лиц – 0,9 %. Участие нерезидентов оценивается в 5,2 %.

ОБЛИГАЦИИ МЕЖДУНАРОДНЫХ ФИНАНСОВЫХ ОРГАНИЗАЦИЙ

На конец отчетного периода в торговых списках KASE находились облигации 41 выпуска четырех международных финансовых организаций: Евразийского банка развития, Европейского банка реконструкции и развития, Международной финансовой корпорации и Азиатского банка развития.

В августе в сектор "Ценные бумаги международных финансовых организаций" официального списка KASE включены четыре выпуска облигаций Евразийского банка развития.

Объем торгов в августе составил 1 105,01 тенге.

ПАИ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ФОНДОВ

На 01 сентября 2021 года в секторе "Ценные бумаги инвестиционных фондов" находились 16 инструментов паевых инвестиционных фондов под управлением шести управляющих компаний и шесть ETF.

В отчетном месяце объем торгов составил 2,9 млрд тенге и вырос относительно июля на 9,5 % или 0,3 млрд тенге.

Инструмент	Объем, млн тенге			Количество сделок, шт.	
	июль	август	изм. сумма	июль	август
RU_UKFFipo	1 991,7	2 474,7	+483,1	839	728
FHJlag	43,9	90,6	+46,7	23	16
FFIN_or	36,5	81,0	+44,5	59	80
FHJlpc	18,3	60,3	+42,0	12	6
US_BIL_	0,5	28,8	+28,3	2	1
US_SPY_	19,2	35,1	+15,9	77	114
CSECgm	8,2	18,4	+10,2	5	4

BCCI_cc	3,6	11,0	+7,4	1	1
BCClrb	0,0	4,8	+4,8	0	1
FHJlhm	7,6	7,4	-0,2	924	309
US_GLD_	0,5	0,0	-0,5	3	0
US_ICLN	2,5	0,2	-2,3	5	6
CSECFe	7,3	3,7	-3,6	4	5
FHJlq	18,0	13,3	-4,7	5	6
FHJlds	19,8	11,3	-8,4	344	328
US_PHO_	63,4	9,4	-54,0	15	4
FFINgw	153,2	0,0	-153,2	5	3
IE_FXBF	238,4	32,7	-205,6	324	368
Общий итог	2 632,2	2 882,6	+250,4	2 647	1 980

В разрезе основных категорий инвесторов 52,6 % приходится на физические лица, 43 % – на брокеров-дилеров, 4,4 % – на прочих юридических лиц. Доля нерезидентов составила менее 0,1 %.

СЧЕТА ФИЗИЧЕСКИХ ЛИЦ НА РЫНКЕ ЦЕННЫХ БУМАГ

По состоянию на 01 сентября 2021 года в Центральной депозитарии числилось 188 009 лицевых счетов, открытых на физические лица, что на 6 445 счет больше, чем месяцем ранее и на 55 148 счета больше, чем на начало 2021 года.

РЫНОК ИНОСТРАННЫХ ВАЛЮТ

В августе текущего года в торгах на рынке иностранных валют на KASE принимало участие 28 членов KASE. Объем торгов на рынке иностранных валют в августе достиг 1,2 трлн тенге, что ниже аналогичного показателя прошлого месяца на 11,5 % или 159,1 млрд тенге. Среднедневной объем торгов составил 58,1 млрд тенге, среднедневное количество сделок – 411, средний объем – 141,5 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 августа (изм.%)
USD/KZT	2 765,92 (-12,5 %)	96,3 % (-1,3 %)	8 238 (-910)	423,76 – 427,13	425,42 (+0,2 %)
RUB/KZT	6 116,64 (+95,6 %)	2,9 % (+1,6 %)	242 (-4)	5,7486-5,8249	5,8059 (-0,02 %)
CNY/KZT	128,17 (-38,0%)	0,7 % (-0,3 %)	125 (-8)	65,4897 – 65,8885	65,8225 (+0,1 %)
EUR/KZT	1,78 (-17,9%)	0,07 % (-0,01 %)	22 (+3)	498,50 – 503,53	501,67 (-0,4 %)

ДЕНЕЖНЫЙ РЫНОК

Совокупный объем торгов на рынке денег составил 13,3 трлн тенге и вырос относительно показателя прошлого месяца на 30,9 % или на 3,1 трлн тенге.

Композитный индикатор денежного рынка MM Index, представляющий собой средневзвешенное через объем сделок значение средневзвешенных процентных ставок (доходности) по операциям валютного свопа USD/KZT и операциями автоматического репо с ценными бумагами Корзины ГЦБ, открытыми на один рабочий день, увеличился на 56 б.п. с 8,74 % до 9,30 % годовых.

Рынок операций РЕПО

Объем торгов в данном сегменте в августе 2021 года составил 12,6 трлн тенге, что выше объема прошлого месяца на 3,4 трлн тенге или на 36,5 %. Среднедневной объем операций составил 602,2 млрд тенге, среднедневное количество ежедневных заключенных сделок – 579, средний объем одной сделки – 1 млрд тенге.

Объем операций авторепо с ГЦБ составил 8,75 трлн тенге или 69,2 % от общего объема операций репо, авторепо НЦБ – 3,89 трлн тенге или 30,8 %, прямое репо НЦБ – 2,8 млрд тенге или 0,02 %, прямое репо с ГЦБ – 18,3 млн тенге или менее 0,01 %.

К концу августа индикатор TONIA (основной индикатор рынка операций репо, представляющий собой средневзвешенную процентную ставку по операциям репо с Корзиной ГЦБ сроком на один день, рассчитываемую по итогам каждого торгового дня) увеличился на 57 б.п. с 8,74 % до 9,31 % годовых.

Индикатор TRION (средневзвешенная процентная ставка по операциям репо с Корзиной ГЦБ, осуществляемым с участием Центрального контрагента, сроком на один день, рассчитываемая в течение каждого торгового дня) увеличился на 68 б.п. с 8,73 % до 9,41 % годовых.

Индикатор TWINA (средневзвешенная процентная ставка по операциям репо с Корзиной ГЦБ, осуществляемым с участием ЦК, сроком на семь дней, рассчитываемая в течение каждого торгового дня) увеличился на 36 б.п. с 8,72 % до 9,08 % годовых в августе 2021 года.

Рынок операций валютного свопа

Объем торгов в августе 2021 года на рынке операции валютного свопа составил 608,6 млрд тенге, что ниже на 253 млрд тенге или на 29,4 % объема в июле.

Среднедневной объем операций валютного свопа в августе составил 29 млрд тенге, среднедневное количество сделок – 11, средний объем одной сделки – 2,5 млрд тенге.

В инструментальной структуре 48,2 % от общего объема на рынке валютного свопа пришлось на операции с однодневным валютным свопом (USDKZT_0_001), 42,8 % от общего объема торгов на рынке валютного свопа пришлось на операции с двухдневным валютным свопом (USDKZT_0_002) и 9,1 % от общего объема торгов с месячным валютным свопом (USDKZT_01M).

Индикатор однодневного долларowego свопа SWAP-1D (USD) к концу августа увеличился на 25 б.п. с 8,80 % до 9,05 % годовых. Доходность двухдневного валютного свопа SWAP-2D (USD) выросла на 103 б.п. с 8,67 % до 9,70 % 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 августе 2021 года были заключены пять сделок с фьючерсами с исполнением в августе 2021 года: одна сделка с фьючерсом на курс доллара США к тенге на общую сумму 849 600 тенге, две сделки с фьючерсом на простые акции АО "Народный сберегательный банк Казахстана" на общую сумму 64 575 тенге и две сделки с фьючерсом на Индекс KASE на общую сумму 9 286 тенге. К началу сентября 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.