

АО "КАЗАХСТАНСКАЯ ФОНДОВАЯ БИРЖА"

ПРЕСС-РЕЛИЗ

г. Алматы

08 февраля 2018 года

АО "Казахстанская фондовая биржа" (KASE, Биржа) информирует об основных итогах деятельности за январь 2018 год.

- Совокупный объем торгов на KASE в январе текущего года достиг 12,4 трлн тенге и вырос относительно предыдущего месяца на 9,8 % или 1,1 трлн тенге.
- Капитализация рынка акций с начала года выросла на 8 % до 18,5 трлн тенге.
- Индекс KASE достиг отметки 2 329,23 пункта уровня, что на 8 % выше значения на начало года.
- На первичном рынке состоялось одно размещение. АО "Кселл" разместило облигации на сумму 4,95 млрд тенге сроком на три года под 11,50 % годовых.
- По состоянию на 01 февраля 2018 года в Центральной депозитарии числилось 109 611 лицевых счетов, открытых физическим лицам, что на 366 счетов больше, чем на конец предыдущего месяца.

Основные показатели биржевого рынка

Общий объем торгов ценными бумагами в январе составил 34,6 млрд тенге. Рост продемонстрировали сектор акций и сектор ЦБ инвестиционных фондов – на 25 % и на 69 % соответственно. В секторах ГЦБ и корпоративных облигаций наблюдается снижение на 78,4 % и 92,1 % соответственно. В секторе облигаций МФО сделок заключено не было.

Рынок акций

На конец месяца в торговых списках Биржи находились акции 127 наименований 111 эмитентов, в том числе на нелистинговой площадке – акции четырех наименований четырех компаний.

В течение месяца в официальный список были включены простые акции пяти эмитентов: АО "Горно-металлургический концерн "КАЗАХАЛТЫН", АО "Kazakhmys Copper", АО "Кристалл Менеджмент", АО "Инвестиционный дом "Fincraft" и АО "Joint Resources". Исключены простые акции АО "Страховая компания "Казахмыс" и привилегированные акции АО "АСЫЛ-ИНВЕСТ", а также три выпуска из числа ценных бумаг, допущенных к обращению в секторе "Нелистинговые ценные бумаги": АО "КазТрансГаз", АО "L-CAPITAL", АО "Рейтинговое агентство регионального финансового центра города Алматы".

Капитализация рынка акций KASE в январе выросла на 8,05 % или 1 378,8 млрд тенге до 18,5 трлн тенге.

Индекс KASE, представленный акциями семи наименований, продолжил рост третий месяц подряд, обновив тем самым максимальные значения за более чем 9 лет. По итогам января Индекс KASE вырос на 7,7 % до 2 329,23 пунктов.

Динамика акций, находящихся в "корзине" индекса:

Эмитент	Торговый код	Цена, KZT за акцию		Изменение цены, % (за месяц)
		на 01.01.18	на 01.02.18	
АО "Народный Банк Казахстана"	HSBK	82,59	104,53	+26,6
АО "Казахтелеком"	KZTK	20 505,00	23 700,00	+15,6
АО "КазТрансОйл"	KZTO	1 337,00	1 477,93	+10,5
KAZ Minerals PLC	GB_KZMS	3 800,00	3 937,92	+3,6
АО "РД "КазМунайГаз"	RDGZ	25 800,00	26 250,00	+1,7
АО "КЕГОС"	KEGC	1 389,00	1 407,03	+1,3
АО "Кселл"	KCEL	1 784,00	1 660,00	-7,0

Лидером роста среди ценных бумаг Индекса выступили акции АО "Народный Банк Казахстана", стоимость которых увеличилась на 26,6 % до 104,53 тенге. Значительный рост акций последовал после повышения аналитиками Sberbank CIB целевой цены ГДР Народного банка до \$16, что по курсу закрытия на 31 января 2018 года составляет 129,2 тенге за акцию. Немного позже аналитики АО "Фридом Финанс" также повысили целевую цену акции до 115 тенге.

Лидером падения стали акции АО "Кселл", которые подешевели на 7,0 % до 1 660,00 тенге. Стоит отметить, что в последний торговый день прошлого года (29 декабря), наблюдалась высокая активность, приведшая к скачку цен по акциям данного эмитента на 6,4 %. В целом бумаги сотового оператора торгуются в канале, снижение же объясняется возвращением цены к исходным значениям после всплеска спроса, который не был закреплен какими либо фундаментальными факторами.

Объем торгов акциями в январе 2018 года относительно предыдущего месяца вырос на 25,4 % или 2,1 млрд тенге до 10,5 млрд тенге. Среднедневной объем торгов составил 501,3 млн тенге, что на 7,5 % выше показателей декабря.

Среди основных категорий инвесторов наиболее активными были физические лица, на счета которых пришлось 58,5 % суммарного объема сделок с акциями. Доля банков второго уровня (БВУ) составила 1 %, доля брокеров-дилеров – 22,0 %, на счета других институциональных инвесторов пришлось 5,0%, доля прочих юридических лиц достигла 13,5 %. Доля нерезидентов равна 7,7 %.

Рынок корпоративных облигаций

На конец января в торговых списках KASE находились облигации 256 наименований, выпущенные 67 эмитентами. В отчетном месяце в списки были включены три выпуска облигаций: АО "Дочерняя организация Народного Банка Казахстана "Halyk Finance", АО "Кселл" и АО "Банк Развития Казахстана".

Объем корпоративного долга в обращении снизился на 157,6 млрд тенге или на 2 % до 8,7 трлн из-за исключения из официального списка KASE в связи с погашением облигаций Дочерней организации АО "Банк ВТБ (Казахстан)" и ТОО "Кредитное товарищество "ОРДА кредит", а также в связи с аннулированием шести выпусков облигаций АО "Алматинские электрические станции".

Индекс доходности корпоративных облигаций основной площадки KASE_BMY в январе не изменился и составил 10,35 % годовых. С 26 января приостановлен расчет индикаторов альтернативной площадки (серии KASE_BA*) в связи с отсутствием достаточного представительского списка для такого расчета.

Объем торгов корпоративными облигациями сложился в отчетном месяце на уровне 8,3 млрд тенге и снизился относительно предыдущего месяца на 92,1 % или на 96,4 млрд тенге. Среднедневной объем торгов составил 394,5 млн тенге, снизившись более чем на 90 %. Снижение объема торгов облигациями было зафиксировано как на первичном рынке, так и на вторичном. В течение месяца размещение провело лишь АО "Кселл", которое привлекло 4,95 млрд тенге, разместив трехлетние облигации с доходностью к погашению 11,50 % годовых.

В торгах приняли участие четыре участника, спрос составил 16,5 % от предложения. Снижение активности на рынке корпоративного долга характерный признак начала года.

Среди основных категорий инвесторов на первичном рынке корпоративных облигаций доля БВУ составила 20,2 %, других институциональных инвесторов – 75,8 %, прочих юридических лиц – 4,0 %.

Объем торгов на вторичном рынке составил 3,3 млрд тенге, что ниже результата предыдущего месяца на 86 % или 20,5 млрд тенге.

Среди основных категорий инвесторов на вторичном рынке корпоративных облигаций доля БВУ составила 13,6 %, брокеров-дилеров – 18,0 %, других институциональных инвесторов – 39,4 %, прочих юридических лиц – 19,3 %, доля физических лиц – 9,8 %. Доля нерезидентов – 1,8 %.

Рынок государственных ценных бумаг (ГЦБ)

Номинальная стоимость торгуемого на KASE государственного долга составила 10,7 трлн тенге, что на 7,7 % или 770,3 млн тенге больше чем по итогам декабря 2017 года.

Совокупный объем торгов ГЦБ на KASE снизился на 78,4 % до 15,8 млрд тенге. Объем первичного рынка снизился на 89 % до отметки в 5,2 млрд тенге. В январе Министерство финансов Казахстана разместило 10-летние облигации (МЕУКАМ-120) с доходностью к погашению 8,55 % годовых.

В структуре покупателей при размещении на БВУ пришлось 35,7 %, на других институциональных инвесторов – 46,4 %, на прочих юридических лиц – 17,9 %. Нерезиденты в размещении не принимали участие.

Объем вторичного рынка ГЦБ снизился на 59,3 % или 15,4 млрд тенге до 10,5 млрд тенге. Среднедневной объем торгов снизился на 65,1 % и составил 501,4 млн тенге. 80,5 % торгового оборота вторичного рынка пришлось на ноты Национального Банка, на долю еврооблигаций и облигаций Министерства финансов пришлось 16,1 % и 3,4 % соответственно.

В разрезе основных категорий инвесторов на вторичном рынке ГЦБ на долю БВУ пришлось 44,7 %, на долю брокеров-дилеров – 8,2 %, на других институциональных инвесторов – 21,8 % и на прочих юридических лиц – 15,3 %. Физические лица и нерезиденты в январе сделки с ГЦБ на KASE не заключали.

Паи инвестиционных фондов

За истекший период объем торгов составил 19 млн тенге, что выше результата декабря 2017 года на 68,7 %. В разрезе основных категорий инвесторов доля физических лиц составила 37,5 %, брокеров-дилеров – 36,6%, прочих юридических лиц – 25,9 %.

Рынок иностранных валют

Объем торгов на рынке иностранных валют достиг 1 244,8 млрд тенге, что выше результата предыдущего месяца на 5,1 % или 60,4 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 в объеме торгов, %	Число сделок	Мин. и макс. курсы, KZT за ед. валюты	Курс на конец месяца (изм.%)
USD/KZT	3 798,9 (+7,4 %)	86,1 % (-0,9%)	7 438 (+812)	319,83–333,29	322,90 (-2,8 %)
RUB/KZT	586,8 (+13,8 %)	13,3 % (+0,6%)	93 (-20)	5,6944–5,8466	5,7459 (-0,7%)
CNY/KZT	26,4 (+100,0 %)	0,6 % (+0,3%)	47 (+5)	50,2850–51,2820	51,0000 (+0,2 %)
EUR/KZT	2,9 (-24,7 %)	0,1 % (+0,0%)	21 (+2)	395,50–402,50	402,00 (+1,4 %)

Денежный рынок

Наиболее значимым событием с начала года на рынке денег является снижение 16 января базовой ставки Национального Банка на 50 б.п. до 9,75 % годовых, что стало неожиданным для участников рынка, которые прогнозировали ее сохранение на прежнем уровне. Предыдущее снижение состоялось 22 августа 2017 года на 25 б.п. до 10,25 % годовых. Значение композитного индикатора денежного рынка MM_Index на конец месяца составило 8,81 % годовых (-0,59 %). Индикаторы TONIA (8,75 %, -0,58 %) и TWINA (8,76%, -1,09 %) продолжили свое движение на нижней границе коридора базовой ставки, что свидетельствует о сохранении профицита ликвидности в тенге.

Доходность однодневного долларowego свопа на конец января составила 9,17 % годовых и снизилась за месяц на 72 б.п., доходность двухдневного свопа упала на 210 б.п. до 8,94 % годовых. Примечательным стало снижение доходности по однодневным свопам до 7,24 % годовых в середине месяца, что было связано с тенденцией укрепления тенге к доллару США. Индикатор KazPrime-3M (KZT) показал идентичное с базовой ставкой снижение на 50 б.п. и на конец месяца достиг значения 10,75 % годовых. Совокупный объем торгов за январь на рынке денег увеличился на 12,1 % и достиг 11,1 трлн тенге. На долю рынка операций репо пришлось 62,5 %.

Рынок операций репо

Объем торгов составил 7,0 трлн тенге, что выше показателя прошлого месяца на 3,5 %. Среднедневной объем операций равен 331,5 млрд тенге.

Более 98 % от общего объема торгов по сделкам открытия репо приходится на сделки авторепо с ГЦБ. Наиболее популярным инструментом остается репо сроком на один день, доля сделок с ним в общем объеме торгов на рынке авторепо с ГЦБ составляет 92,1 %.

Всего в сделках на рынке репо принимали участие 43 члена Биржи. Более 50 % от общего оборота торгов в данном сегменте приходится на банки второго уровня. Доля участия нерезидентов в данном секторе незначительна и равна 0,4 %.

Рынок валютного свопа

Объем торгов на рынке валютных свопов вырос на 30,0 % до 4,2 трлн тенге. Предметом операций валютного свопа являлся только доллар США. Более 70 % от общего объема торгов составляют сделки с инструментом USDKZT_0_002. Среднедневной объем операций – 199,0 млрд тенге.

Для справки

АО "Казахстанская фондовая биржа" (KASE) является ведущей фондовой биржей в Центрально-Азиатском регионе и единственной биржей в Казахстане, осуществляющей свою деятельность на финансовом рынке. Это универсальная торговая площадка для инструментов рынка репо, иностранных валют, государственных и корпоративных ценных бумаг, облигаций международных финансовых институтов, а также производных инструментов.

KASE является членом Международной федерации бирж (WFE), Федерации Евро-Азиатских фондовых бирж (FEAS) и других международных и отечественных профессиональных объединений. В 2015 году KASE присоединилась к инициативе ООН "Фондовые биржи за устойчивое развитие". KASE занимает второе место среди бирж СНГ по объему торгов ценными бумагами, а также занимает шестое место по уровню капитализации рынка акций бирж FEAS.

Дополнительная информация: +7 (727) 237 5342, pr@kase.kz