

ПРЕСС-РЕЛИЗ

г. Алматы

12 июня 2018 года

KASE представляет итоги работы биржевого рынка в мае 2018 года

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

- Совокупный объем торгов на KASE в мае 2018 года составил 10 934,8 млрд тенге и вырос относительно предыдущего месяца на 10 % или 994,1 млрд тенге. Положительную динамику продемонстрировали рынок ценных бумаг (в 3,9 раза) и рынок денег (+13,3 %). Снижение наблюдалось на рынке иностранных валют (-28 %).
- По итогам мая значение Индекса KASE выросло на 2,7 % до 2 503,22 пункта, обновив в мае свой 10-тилетний максимум.
- В сектор "Ценные бумаги международных финансовых организаций" официального списка KASE включены три выпуска облигаций Евразийского банка развития.
- Объем первичного рынка ГЦБ вырос в 2,2 раза и достиг 97,7 млрд тенге. Размещения в мае осуществляли областные исполнительные органы на сумму 7,7 млрд тенге и Министерство финансов, которое привлекло в этом месяце 89,9 млрд тенге под 8,44–8,47 % годовых.

РЫНОК АКЦИЙ

На конец месяца в торговых списках Биржи находились акции 126 наименований 111 эмитентов, в том числе на нелистинговой площадке – акции пяти наименований пяти компаний.

Капитализация рынка акций KASE снизилась в мае на 7,6 % или 1 401,3 млрд тенге до 17 трлн тенге. Основной причиной снижения данного показателя стало исключение простых акций АО "Разведка Добыча "КазМунайГаз". Капитализация компании на дату делистинга оценивается в 1 534,63 млрд тенге.

Индекс KASE после малозаметной апрельской коррекции в мае продолжил восходящий тренд. По итогам отчетного месяца Индекс KASE вырос на 2,7 % до 2 503,22 пунктов. 18 мая Индекс голубых фишек обновил почти 10-тилетний максимум, закрывшись на отметке 2 532,67 пунктов. Основными определяющими событиями на рынке стали публикация финансовой отчетности эмитентов за первый квартал 2018 года, а также дивидендные истории после проведенных годовых общих собраний акционеров.

Изменение цен акций, входящих в представительский список KASE

Эмитент	Торговый код	Цена, тенге за акцию		Изменение цены, % в апреле
		на 01.05.2018	на 01.06.2018	
АО "Казахтелеком"	KZTK	29 300,0	33 800,0	+15,4 %
KAZ Minerals PLC	GB_KZMS	4 110,0	4 362,1	+6,1 %
АО "Банк ЦентрКредит"	CCBN	286,9	294,3	+2,6 %
АО "Народный Банк"	HSBK	102,1	104,0	+1,8 %
АО "КазТрансОйл"	KZTO	1 565,0	1 538,0	-1,7 %
АО "KEGOC"	KEGC	1 482,0	1 449,0	-2,2 %
АО "Кселл"	KCEL	1 699,0	1 650,0	-2,9 %

Главным драйвером роста Индекса KASE стали акции АО "Казахтелеком", которые выросли в цене на 15,4 % до 33 800 тенге. Бумаги телекоммуникационной компании растут в цене восьмой месяц подряд, при этом в мае наблюдалось ускорение роста, объемы сделок при этом упали более чем вдвое.

Заметный рост в размере 6,1 % продемонстрировали акции KAZ Minerals PLC, их цена на конец месяца достигла 4 362,1 тенге. В конце апреля компания представила операционные результаты за первый квартал 2018 года, которые оказались лучше результатов первого квартала 2017 года. Значительный прирост производства меди наблюдался на Актогайской сульфидной фабрикой, пропускная способность которой в марте достигла 76 %.

Лидером падения стали акции АО "Кселл", они подешевели на 2,9 % до 1 650 тенге. Давление на акции оказывает отчетность компании за первый квартал 2018 года, которая оказалась слабее результатов аналогичного периода 2017 года.

Снижение также продемонстрировали акции АО "KEGOC" (-2,2 %) до 1 449 тенге. Акции компании полностью нивелировали рост, который был зафиксирован после годового собрания акционеров. К завершению месяца на фоне улучшения кредитного рейтинга, бумаги компании отыграли более 2 %. Международное рейтинговое агентство S&P Global Ratings повысило долгосрочный кредитный рейтинг KEGOC с "BB" до "BB+" в связи с улучшением финансовых показателей. Прогноз по рейтингам – "Стабильный".

Объем торгов акциями вырос относительно предыдущего месяца в 2,2 раза (+115 %) или 12,4 млрд тенге до 23,1 млрд тенге. Среднедневной объем торгов достиг 1 157 млн тенге, повысившись относительно предыдущего месяца в 2,3 раза. Весь объем прошел в секторе купли-продажи. Размещений в мае не было.

В разрезе основных категорий инвесторов наиболее активными были физические лица, на счета которых пришлось 64,9 % от общего оборота акций. Банки второго уровня (БВУ) не принимали участие в торгах, доля брокеров-дилеров составила 23,2 %, на счета других институциональных инвесторов пришлось 0,4 %, доля прочих юридических лиц составила 11,5 %. Участие нерезидентов оценивается в 11,1 %.

РЫНОК КОРПОРАТИВНЫХ ОБЛИГАЦИЙ

На конец мая в торговых списках KASE находились облигации 253 наименований, выпущенные 66 эмитентами. В отчетном месяце в официальный список были включены облигации АО "Банк Развития Казахстана" (BRKZe9) и АО "Фридом Финанс" (FFINb3). Исключены в связи с истечением срока обращения облигации АО "Казкоммерцбанк" (KKGBе23) и АО "Нурбанк"

(NRBNb11). В связи с досрочным погашением исключены четыре выпуска международных облигаций АО "Национальная компания "КазМунайГаз".

Результатом перечисленных изменений стало снижение в мае объема торгуемого на KASE корпоративного долга на 12,1 % или 1 102,6 млрд тенге до 8 трлн тенге в номинальном выражении.

Значение индекса доходности корпоративных облигаций KASE_BMY выросло в мае на 11 базисных пунктов до 10,3 % годовых. Доходность индекса поднялась выше верхней границы коридора действующей на конец месяца базовой ставки Национального Банка ($9,25 \pm 1$ % годовых).

Объем торгов корпоративными облигациями на KASE составил 195,1 млрд тенге и вырос относительно апреля в 18 раз. Среднедневной объем торгов составил 9 753,5 млн тенге, что выше показателя апреля в 19 раз.

В мае на KASE состоялось одно размещение: ТОО "Компания Фаэтон" привлекло 536,4 млн тенге, на семь лет под 13,49 % годовых.

Основной объем торгов в данном сегменте пришелся на вторичный рынок. Объем торгов вырос на 183,7 млрд тенге или в 18 раз и достиг 194,5 млрд тенге.

В разрезе основных категорий инвесторов на рынке корпоративных облигаций доля БВУ составила 26,2 %, брокеров-дилеров – 1,4 %, других институциональных инвесторов – 3,7 %, других юридических лиц – 68,6 %, доля физических лиц не превысила 0,1 %. Участие нерезидентов оценивается 0,01 %.

РЫНОК ГОСУДАРСТВЕННЫХ ЦЕННЫХ БУМАГ (ГЦБ)

Номинальная стоимость торгуемого на KASE государственного долга оценивается в 10,8 трлн тенге, что ниже показателя апреля на 1,3 % или 148 млрд тенге.

В мае объем торгов на рынке ГЦБ вырос в 2,2 раза (+120,8 %) и достиг 162,3 млрд тенге. Среднедневной объем торгов составил 8 114,2 млн тенге (вырос в 2,3 раза относительно апреля).

На первичном рынке ГЦБ объем сделок вырос в 2,2 раза (+124,3 %) или 54,1 млрд тенге до 97,7 млрд тенге. 92 % от общего объема размещений пришлось на размещения пяти выпусков казначейских облигаций Министерства финансов, которое привлекло 89,9 млрд тенге под 8,44–8,47 %.

В отчетном месяце в рамках реализации государственных программ акиматы шести областей разместили свои двухлетние облигации под 0,35 % годовых на 7,7 млрд тенге.

В структуре инвесторов на первичном рынке на долю юридических лиц пришлось 7,9 %, на долю институциональных инвесторов – 92,1 %.

Объем торгов на вторичном рынке вырос в 2,2 раза (+115,7 %) до 64,6 млрд тенге. В структуре инвесторов на вторичном рынке на долю БВУ пришлось 62,9 %, на долю брокеров-дилеров – 1,7 %, на долю других институциональных инвесторов – 14,8 %, прочие юридические лица составили 20,6 %, на долю физических лиц пришлось менее 0,1 %. Доля нерезидентов составила также менее 0,1 %.

ПАИ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ФОНДОВ (ПИФ)

На конец отчетного периода в секторе "Ценные бумаги инвестиционных фондов" находились шесть инструментов под управлением пяти компаний. Объем торгов составил 39,8 млн тенге, что выше результата апреля на 13,1 %. В разрезе основных категорий инвесторов доля физических лиц составила 59 %, брокеров-дилеров – 23,3 %, прочих юридических лиц – 17,7 %.

Счета физических лиц на рынке ценных бумаг

На конец мая в системе учета Центрального депозитария ценных бумаг числилось 110 974 лицевых счетов, открытых физическими лицами, что на 427 счетов больше, чем месяцем ранее и на 1 729 счетов больше чем на начало года.

РЫНОК ИНОСТРАННЫХ ВАЛЮТ

В мае в торгах на рынке иностранных валют на KASE принимали участие 31 член KASE.

Объем торгов на рынке иностранных валют сложился на уровне 1 040,1 млрд тенге, что ниже результата предыдущего месяца на 28,1 % или 407,4 млрд тенге.

Негативный эффект от введения антироссийских санкций сохранил свое влияние на протяжении мая – тенге и рубль продолжили свое движение на уровнях, закрепленных в апреле. Временным фактором поддержки в конце месяца выступил налоговый период, во время которого экспортеры производили платежи в бюджет по итогам первого квартала текущего года. Тем временем, эталонная марка Brent уверенно торговалась выше 75 долларов США за баррель, а к середине месяца вплотную приближалась к отметке 80 долларов США.

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	3 124,1 (-28,5 %)	76,2 % (+2,8 %)	6 330 (-1 358)	325,75 – 330,72	329,35 (+0,6 %)
RUB/KZT	943,1 (-38,7 %)	23,0 % (-2,9 %)	145 (-25)	5,2013 – 5,3311	5,3077 (+0,4 %)
CNY/KZT	9,1 (-39,7 %)	0,2 % (-0,03 %)	25 (-7)	50,9790 – 51,9800	51,5300 (-0,3 %)
EUR/KZT	10,2 (+31,6 %)	0,2 % (+0,1 %)	23 (+2)	381,64 – 396,55	386,12 (-3,0 %)
EUR/USD	15,0 (-42,3 %)	0,4 % (-0,1 %)	3 (-3)	1,1868	1,1868 (-1,7 %)

ДЕНЕЖНЫЙ РЫНОК

Индикатор TONIA завершил месяц без изменений и остался на уровне 8,26 % годовых. В то же время индикатор TWINA (средневзвешенная процентная ставка по сделкам открытия репо сроком на семь рабочих дней) показал снижение на 33 б.п. до 8,29 % годовых.

Доходность однодневного долларowego свопа SWAP-1D (USD) на конец мая составила 9,06 % годовых и выросла за месяц на 44 б.п. Доходность двухдневного свопа SWAP-2D (USD) повысилась на 6 б.п. до 8,82 % годовых. Минимальное значение индикатора SWAP-1D (USD) было зафиксировано на уровне 6,44 % годовых – нижняя граница ставки, по которой Национальный Банк изымает ликвидность в национальной валюте через валютный своп.

Индикатор KazPrime-3M (KZT) на протяжении всего месяца находился на уровне 10,25 % 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 мая вырос на 3 б.п. до 8,29 % годовых.

Рынок операций репо

Объем торгов в данном сегменте достиг 7,1 трлн тенге, что выше показателя прошлого месяца на 29,6 % или 1,6 трлн тенге. Среднедневной объем операций в мае составил 354,7 млрд тенге (+36 % к аналогичному показателю апреля 2018 года).

97,2 % от общего объема торгов по сделкам открытия репо пришлось на сделки авторепо с ГЦБ. Наиболее популярным инструментом на рынке авторепо с ГЦБ остается операция репо сроком на один день, доля сделок с ним в общем объеме торгов на рынке авторепо с ГЦБ составила 87,2 %.

Всего в мае 2018 в сделках на рынке репо принимали участие 46 членов Биржи. Более 87 % от общего оборота торгов в данном сегменте заняли БВУ. Доля участия нерезидентов в отчетном месяце была незначительна и составила 0,1 %.

Рынок валютного свопа

Объем торгов на рынке валютного свопа снизился на 17,1 % до 2,4 трлн тенге. Среднедневной объем операций составил 121 млрд тенге, что ниже аналогичного показателя апреля на 13 %. В инструментальной структуре более 76 % от общего объема торгов (1,9 трлн тенге или 5,6 млрд USD) на рынке валютного свопа пришлось на сделки с двухдневным валютным свопом (USDKZT_0_002).

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 мае сделок с фьючерсами заключено не было. К началу июня открытые позиции участников торгов на рынке деривативов отсутствовали.

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