

ПРЕСС-РЕЛИЗ

г. Алматы

13 сентября 2024 года

KASE представляет итоги работы биржевого рынка за август 2024 года

АО "Казахстанская фондовая биржа" (далее – KASE, Биржа) информирует об основных итогах деятельности за август 2024 года:

- Совокупный объем торгов на KASE в августе 2024 года составил 34,0 трлн тенге и снизился относительно июля на 1,3 % или 463,7 млрд тенге.
- По итогам августа значение Индекса KASE выросло на 1,3 % и составило 5 304,09 пунктов.
- По итогам августа капитализация рынка акций выросла на 0,2 % до 33,0 трлн тенге, объем торгуемого корпоративного долга увеличился на 0,4 % до 14,2 трлн тенге.
- В августе процедуру листинга прошли корпоративные облигации двух новых эмитентов.
- По состоянию на 01 сентября 2024 года в торговых списках KASE находились негосударственные ценные бумаги 704 наименований 255 эмитентов.

КЛЮЧЕВЫЕ ПРОЕКТЫ И МЕРОПРИЯТИЯ

В августе 2024 года Казахстанская фондовая биржа и Клиринговый центр KASE официально присоединились к цифровому биржевому хабу Tabadul Digital Exchange Hub, созданному Abu Dhabi Securities Exchange (ADX) для осуществления двусторонней кросс-биржевой торговли между организациями, оптимизации торговых механизмов, укрепления стратегического партнерства, расширения возможностей сотрудничества между двумя биржами и инвестиционных возможностей для локальных и иностранных инвесторов.

Мероприятия для бизнеса

В рамках проекта "День эмитента" на KASE прошли следующие мероприятия:

- День эмитента АО "НК "КазМунайГаз", в рамках которого была представлена информация о финансовых результатах деятельности компании и объемах добычи и транспортировки нефти за первое полугодие 2024 года;
- День эмитента АО "КазТрансОйл", на котором руководство компании о производственных и финансовых результатах за первое полугодие 2024 года.

РЫНОК АКЦИЙ

По итогам августа 2024 года капитализация рынка акций составила 33,0 трлн тенге (68,5 млрд USD), что на 50,9 млрд тенге или 0,2 % выше показателя предыдущего месяца.

Объем торгов акциями в августе составил 9,1 млрд тенге, снизившись относительно июля на 83,4 % или на 45,8 млрд тенге. Торги акциями в августе проходили исключительно на вторичном рынке. Среднедневной объем торгов составил 433,2 млн тенге, среднедневное количество сделок – 6 596 сделок, средний объем одной сделки – 65,7 тыс. тенге.

Среди основных категорий инвесторов на долю физических лиц пришлось 68,3 % от суммарного объема сделок с акциями, на долю банков – менее 0,1 %, на долю брокерско-дилерских

организаций – 14,1 %, на долю других институциональных инвесторов – 3,7 %, на долю прочих юридических лиц – 13,8 %. Доля нерезидентов составила 5,3 %.

ИНДЕКС KASE

Значение Индекса KASE в августе выросло на 1,3 % и к концу месяца составило 5 304,09 пунктов.

Объем сделок с индексными акциями в августе составил 7,8 млрд тенге, что на 4,3 млрд тенге ниже показателя июля. Наибольший объем торгов пришелся на простые акции АО "Народный банк Казахстана" – 1,5 млрд тенге (19,0 % от общего объема торгов с индексными акциями).

Изменение цен акций по последним сделкам, входящих в представительский список Индекса KASE

Эмитент	Торговый код	Цена, тенге за акцию			Объем торгов, млн тенге		
		на 01.09.24	на 01.08.24	Δ, %	август	июль	Δ
АО "Kcell"	KCEL	3 232,00	2 964,99	+9,0	566,6	2063,3	-1 496,7
АО "НК "КазМунайГаз"	KMGZ	14 138,00	13 434,99	+5,2	907,9	2 151,1	-1 243,2
АО "Народный банк Казахстана"	HSBK	210,98	205,87	+2,5	1 482,3	1 462,4	+20,0
АО "КазТрансОйл"	KZTO	827,00	814	+1,6	873,5	703,7	+169,8
АО "Национальная атомная компания "Казатомпром"	KZAP	18 394,00	18 301,01	+0,5	982,1	1003,7	-21,7
АО "Казахтелеком"	KZTK	38 960,00	38 874,00	+0,2	357,9	997,8	-639,8
АО "KEGOC"	KEGC	1 480,00	1 480,00	0	332,4	643,9	-311,5
АО "Банк ЦентрКредит"	CCBN	1 994,96	1 995,00	-0,002	479,7	847,8	-368,1
АО "Эйр Астана"	AIRA	822,00	853,02	-3,6	1 000,2	1 313,5	-313,2
АО Kaspi.kz	KSPI	63 100,00	65 550,00	-3,7	803,1	924,6	-121,5

Наилучшую динамику по итогам августа продемонстрировали простые акции **АО "Kcell"**, которые выросли по результатам месяца на 9,0 %. Согласно консолидированной отчетности компании за первое полугодие 2024 года, выручка выросла на 9,7 % до 119,8 млрд тенге по сравнению с аналогичным периодом прошлого года. EBITDA в первом полугодии 2024 года составила 41 млрд тенге, а чистая прибыль составила 5,5 млрд тенге.

На втором месте по темпам роста находятся простые акции **АО "Национальная компания "КазМунайГаз"**, которые прибавили в цене 5,2 %. Согласно консолидированным финансовым результатам компании за первое полугодие 2024 года, выручка выросла на 7,5 % до 4,2 трлн тенге, а чистая прибыль с учетом доли в прибыли в совместно-контролируемых предприятиях и ассоциированных компаниях – на 12,7 % до 550 млрд тенге.

На третьем месте по темпам роста находятся простые акции **АО "Народный банк Казахстана"** с ростом в 2,5 %. Согласно консолидированной финансовой отчетности за первое полугодие 2024 года чистая прибыль увеличилась на 2,2 % до 379 млрд тенге, чистый процентный доход вырос на 32,1 % до 511 млрд тенге, а чистая процентная маржа увеличилась с 6 % до 7 %.

Акции **АО "КазТрансОйл"** выросли в цене на 1,6 %. Согласно консолидированной финансовой отчетности компании за первое полугодие 2024 года, выручка составила 151 млрд 9,2 млн тенге, что на 10,3 % выше аналогичного показателя за первое полугодие 2023 года, а консолидированная чистая прибыль, по итогам первого полугодия 2024 года, составила 19 млрд 522,9 млн тенге, что на 3,9 % ниже результата первого полугодия 2023 года.

СЕКТОР KASE GLOBAL

На конец августа в секторе KASE Global находились акции 46 наименований и 12 ETF иностранных эмитентов.

Объем торгов в секторе "KASE Global" в августе составил 2,9 млрд тенге и снизился относительно июля на 64,6 % или на 5,2 млрд тенге. Среднедневной объем торгов составил 136,4 млн тенге, среднее количество сделок – 630, средний объем одной сделки – 216,5 тыс. тенге.

Наибольшее количество сделок в секторе "KASE Global" в августе 2024 года заключено со следующими акциями:

- Intel Corporation (INTC_KZ) – 2 293 сделки на общую сумму 256,8 млн тенге;
- NVIDIA Corp. (NVDA_KZ) – 1 956 сделок на общую сумму 461,2 млн тенге;
- Ford Motor Company (F_KZ) – 1 565 сделок на общую сумму 136,3 млн тенге;
- ProShares Bitcoin Strategy ETF (BITO_KZ) – 1 384 сделки на общую сумму 173,3 млн тенге;
- American Airlines (AAL_KZ) – 1 234 сделки на общую сумму 21,8 млн тенге.

В разрезе основных категорий инвесторов 54,7 % приходится на физические лица, 32,2 % – на брокерско-дилерские организации, 13,1 % – на прочих юридических лиц. Доля нерезидентов составила менее 0,1 %.

КОРПОРАТИВНЫЕ ОБЛИГАЦИИ

Объем корпоративного долга в обращении в августе увеличился на 0,4 % или 60,8 млрд тенге до 14,2 трлн тенге (29,5 млрд USD).

На конец августа 2024 года в официальном списке KASE находились корпоративные облигации 451 выпуска 119 эмитентов. В августе в официальный список KASE были включены 11 выпусков корпоративных облигаций 10 эмитентов (два новых): два выпуска АО "Bereke Bank" и по одному выпуску АО "Банк ЦентрКредит", ТОО "BASS Gold", АО "Интергаз Центральная Азия", АО "Жилищный строительный сберегательный банк "Отбасы банк", ТОО "Микрофинансовая организация аФинанс", АО "МФО ОнлайнКазФинанс", ТОО "Сейф-Ломбард", **АО "АИФН "SNS INVESTMENTS (СНС ИНВЕСТМЕНТС)" и ТОО "Терра"**.

Значение индекса доходности корпоративных облигаций KASE_BMY в августе снизилось на 15 б.п. и на конец месяца составило 13,75 % годовых.

Объем торгов корпоративными облигациями на KASE в августе снизился относительно июля на 38,8 % или на 315,3 млрд тенге до 496,9 млрд тенге. Среднедневной объем торгов составил 23,7 млрд тенге (на вторичном рынке – 12,3 млрд тенге), среднее количество сделок – 392 сделки (на вторичном рынке – 390 сделок), средний объем одной сделки – 60,3 млн тенге (на вторичном рынке – 31,5 млн тенге).

В августе объем первичного рынка корпоративных облигаций составил 238,7 млрд тенге и снизился относительно июля на 68,7% или на 523,1 млрд тенге:

- АО "Bereke Bank" привлекло 200,0 млрд тенге, разместив двухлетние и трехлетние облигаций с доходностью к погашению 13,90 % и 13,95 % соответственно;
- АО "Банк ЦентрКредит" привлекло 3,9 млн долларов США (эквивалент 1,9 млрд тенге), разместив полугодовые облигации с доходностью к погашению 4,50 % годовых;
- АО "Банк "Bank RBK" привлекло 16,7 млрд тенге, разместив девятилетние облигации под 4,00 % годовых;
- АО "Казахстанский фонд устойчивости" привлекло 14,9 млрд тенге, разместив облигации со средневзвешенной доходностью к погашению 13,51-13,57 % годовых и со сроком до погашения менее года;
- ТОО "Терра" привлекло 445,0 млн тенге, разместив пятилетние облигации под 19,75 % годовых.

В разрезе основных категорий инвесторов на первичном рынке корпоративных облигаций доля банков составила 5,2 %, брокерских-дилерских организаций – менее 0,1 %, других институциональных инвесторов – 0,8 %, прочих юридических лиц – 91,8 %, физических лиц – 2,2 %. В торгах на первичном рынке корпоративных облигаций нерезиденты участия не принимали.

Объем торгов на вторичном рынке облигаций в августе относительно июля увеличился в 5,1 раза или на 207,8 млрд тенге до 258,2 млрд тенге.

В разрезе основных категорий инвесторов на вторичном рынке корпоративных облигаций доля банков составила 44,3 %, брокерско-дилерских организаций – 0,2 %, других институциональных инвесторов – 0,5 %, прочих юридических лиц – 52,5 %, физических лиц – 2,5 %. Доля нерезидентов составила 1,2 %.

ГОСУДАРСТВЕННЫЕ ЦЕННЫЕ БУМАГИ (ГЦБ)

Сумма государственного долга по номиналу, торгуемого на KASE, составила 27,1 трлн тенге (56,2 млрд USD), увеличившись за август на 1,2 % или 322,2 млрд тенге.

Суммарный объем торгов ГЦБ на KASE составил 517,2 млрд тенге и снизился относительно июля на 53,2 % или 588,2 млрд тенге. По итогам августа 2024 года среднедневной объем торгов составил 24,6 млрд тенге (на вторичном рынке – 6,3 млрд тенге), среднедневное количество сделок – 24 (на вторичном рынке – 17), средний объем одной сделки – 1,0 млрд тенге (на вторичном рынке – 383,1 млн тенге).

Объем торгов на первичном рынке ГЦБ снизился на 60,7 % или на 594,3 млрд тенге до 384,3 млрд тенге. Из них 101,9 млрд тенге привлекли акиматы 13 областей, г. Алматы, г. Астана и г. Шымкент (в целях финансирования мероприятий, предусмотренных в рамках реализации государственных программ). Министерство финансов привлекло 282,4 млрд тенге, разместив облигации со средневзвешенной доходностью 13,16-13,41 % годовых и сроком до погашения от 0,8 до 14,9 лет.

В разрезе основных категорий инвесторов на первичном рынке на долю банков пришлось 45,9 %, брокерско-дилерских организаций – 1,4 %, других институциональных инвесторов – 15,7 %, прочих юридических лиц – 37,0 %. Доля нерезидентов на первичном рынке ГЦБ составила 0,5 %.

Объем торгов на вторичном рынке вырос на 4,8 % или на 6,0 млрд тенге и составил 132,9 млрд тенге. Доля торгов нотами Национального Банка на вторичном рынке составила 42,5 % или 56,4 млрд тенге от общего объема торгов, доля МЕКАМ – 54,9 % или 72,9 млрд тенге, доля еврооблигаций Республики Казахстан – менее 0,1 % или 46,4 млн тенге. Остальной объем, составляющий 2,7 % или 3,5 млрд тенге, пришелся на сделки с ГЦБ иностранных государств (облигации Министерства финансов США, Султаната Оман и Австрийской Республики).

В разрезе основных категорий инвесторов на вторичном рынке на долю банков пришлось 33,4 %, брокерско-дилерских организаций – 0,3 %, других институциональных инвесторов – 14,7 %, прочих юридических лиц – 46,9 %, физических лиц – 4,7 %. Участие нерезидентов оценивается в 4,8 %.

ОБЛИГАЦИИ МЕЖДУНАРОДНЫХ ФИНАНСОВЫХ ОРГАНИЗАЦИЙ (МФО)

На конец августа в торговых списках KASE находились облигации 66 выпусков семи международных финансовых организаций: 26 выпусков Евразийского банка развития, 18 выпусков Европейского банка реконструкции и развития, 12 выпусков Азиатского банка развития, пять выпусков Международной финансовой корпорации, три выпуска Международного банка реконструкции и развития и по одному выпуску Европейского инвестиционного банка и Исламской корпорации по развитию частного сектора.

За август 2024 года в официальный список включен один выпуск облигаций Евразийского банка развития, были исключены из официального списка два выпуска Евразийского банка развития и один выпуск Международного банка реконструкции и развития в связи с истечением срока обращения.

В отчетном месяце весь объем торгов пришелся на вторичный рынок и составил 479,8 млн тенге, что на 10,2 млрд тенге ниже результата июля 2024 года. Среднедневной объем торгов составил 22,8 млн тенге, средний объем одной сделки – 53,3 млн тенге.

В разрезе основных категорий инвесторов на вторичном рынке в отчетном периоде доля брокерско-дилерских организаций составила 0,1 %, прочих юридических лиц – 99,6 %, физических лиц – 0,3 %. Нерезиденты в торгах на вторичном рынке международных финансовых организаций не принимали.

ПАИ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ФОНДОВ

На 01 сентября 2024 года в секторе "Ценные бумаги инвестиционных фондов" находилось 17 инструментов паевых инвестиционных фондов под управлением пяти управляющих компаний и шесть ETF.

В отчетном месяце объем торгов составил 498,3 млн тенге и снизился относительно июля 2024 года на 64,7 % или на 915,2 млн тенге. В разрезе основных категорий инвесторов 50,2 % пришлось на счета физических лиц, 45,1 % – на брокерско-дилерские организации, 4,7 % – на прочие юридические лица. Доля нерезидентов составила 25,7 %.

ПРОИЗВОДНЫЕ ЦЕННЫЕ БУМАГИ

По состоянию на 01 сентября 2024 года в официальном списке KASE находились глобальные депозитарные расписки (ГДР) шести выпусков, базовыми активами которых являются простые акции АО "Национальная атомная компания "Казатомпром", АО "Народный Банк Казахстана", АО Kaspi.kz, АО "Казакхтелеком", АО "ForteBank" и АО "Эйр Астана", включенные с августа 2024 года.

Объем торгов в августе 2024 года составил 164,1 млн тенге и снизился относительно июля 2024 года на 36,6 % или 94,7 млн тенге. В разрезе основных категорий инвесторов 59,5 % пришлось на счета физических лиц, 33,9 % – на брокерско-дилерские организации, 2,9 % – на других институциональных инвесторов и 3,7 % – на прочих юридических лиц. Доля нерезидентов составила 2,1 %.

РЫНОК ИНОСТРАННЫХ ВАЛЮТ

В августе текущего года в торгах на рынке иностранных валют на KASE принимал участие 36 членов KASE.

Объем торгов в августе на рынке иностранных валют вырос относительно июля на 25,6 % или на 711,3 млрд тенге до 3,5 трлн тенге. Среднедневной объем торгов составил 166,3 млрд тенге, среднедневное количество сделок – 930, средний объем одной сделки – 178,8 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 мес. (изм. %)
USD/KZT	4 727,7 (+21,7 %)	64,8 % (-1,5 %)	13 465 (+677)	473,30-484,90	481,61 (+1,6 %)
RUB/KZT	124 208,6 (+86,7 %)	19,0 % (+6,0 %)	4 486 (+1 197)	5,1401-5,6500	5,2398 (-4,6 %)
CNY/KZT	1 146,2 (+20,9 %)	2,2 % (-0,02 %)	664 (+92)	65,5600-67,9200	67,6694 (+3,5 %)
EUR/KZT	105,9 (+91,9 %)	1,6 % (+0,6 %)	563 (+229)	511,41-541,35	535,12 (+4,2 %)
EUR/USD	313,9 (+25,1 %)	4,7 % (+0,1 %)	194 (-71)	1,0792-1,1181	1,1098 (+2,5 %)
USD/CNY	558,5 (-24,8 %)	7,6 % (-5,1 %)	167 (-24)	7,0863-7,2537	7,1098 (-1,6 %)
EUR/CNY	- (-)	- (-)	- (-)		(-)

ДЕНЕЖНЫЙ РЫНОК

Совокупный объем торгов на рынке денег в августе составил 29,4 трлн тенге, который снизился относительно показателя июля на 0,7 % или на 209,2 млрд тенге.

29 августа Комитет по денежно-кредитной политике Национального Банка Республики Казахстан принял решение сохранить базовую ставку на уровне 14,25 % годовых с процентным коридором +/- 1,0 п.п.

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, снизился за месяц на 54 б.п. с 12,98 % до 12,44 % годовых.

РЫНОК ОПЕРАЦИЙ РЕПО

Совокупный объем операций репо в августе составил 22,7 трлн тенге, что ниже объема июля на 1,4 трлн тенге или на 6,0 %. Среднедневной объем операций составил 1,1 трлн тенге, среднедневное количество сделок – 763, средний объем одной сделки – 1,4 млрд тенге.

Объем операций авторепо с ГЦБ составил 17,7 трлн тенге, или 78,1 % от общего объема операций репо, авторепо с НЦБ – 5,0 трлн тенге, или 21,8 %, прямое репо НЦБ – 21,7 млрд тенге, или 0,1 %. Были заключены сделки авторепо с КСУ на 1,4 млрд тенге.

К концу августа 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) снизился на 46 б.п. с 13,75 % до 13,29 % 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) снизился на 49 б.п. с 13,77 % до 13,28 % 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) снизился на 38 б.п. с 13,75 % до 13,37 % годовых.

ОПЕРАЦИИ ВАЛЮТНОГО СВОПА

Совокупный объем операций валютного свопа в августе составил 6,7 трлн тенге, что выше объема июля на 1,2 трлн тенге или на 22,4 %. Среднедневной объем операций составил 320 млрд тенге, среднедневное количество сделок – 69, средний объем одной сделки – 4,6 млрд тенге.

В структуре валютного свопа 99,4 % от объема операций валютными свопами пришлось на свопы USDKZT; 38,6 млрд тенге, или 0,6 %, – на RUBKZT; 0,9 млрд тенге, или менее 0,1 %, – на EURKZT.

Валютная пара	Инструмент	Объем, млрд тенге	Объем, млн ед. валюты	Доля в объеме торгов, %
USD/KZT	USDKZT_0_001	2 820,7	5 901,1	41,9%
	USDKZT_0_002	3 836,7	8 019,2	57,0%
	USDKZT_0_01W	24,9	52,0	0,4%
	USDKZT_1_01M	0,1	0,3	<0,1%
	USDKZT_1_001	6,7	14,0	0,1%
EUR/KZT	EURKZT_1_001	0,9	1,6	<0,1%
RUB/KZT	RUBKZT_0_001	11,3	2 070,9	0,2%
	RUBKZT_1_001	27,3	5 095,6	0,4%
CNY/KZT	CNYKZT_0_001	0,3	4,0	<0,1%

Доходность однодневного долларowego свопа SWAP-1D (USD) на конец августа составила 5,55% годовых, снизившись за месяц на 131 б.п. Доходность двухдневного валютного свопа SWAP-2D (USD) снизившись в августе на 118 б.п. до 5,81 % годовых.

РЫНОК ДЕРИВАТИВОВ

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

В августе 2024 года на рынке деривативов сделок заключено не было. На 01 сентября открытые позиции участников торгов на рынке деривативов отсутствовали.

С 12 августа АО "SQIF Capital" присвоен статус маркет-мейкера по производным финансовым инструментам – фьючерсам на курс доллара США к тенге и на курс рубля к тенге.

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.