

ПРЕСС-РЕЛИЗ

г. Алматы

13 ноября 2019 года

KASE представляет итоги работы биржевого рынка в октябре 2019 года

АО "Казахстанская фондовая биржа" (KASE, Биржа) представляет итоги работы биржевого рынка в октябре 2019 года.

- Совокупный объем торгов на KASE в октябре 2019 года составил 8,9 трлн тенге и снизился относительно сентября на 6,6 % или 632 млрд тенге.
- Снижение наблюдалось только на денежном рынке – на 11,6 % до уровня 7,5 трлн тенге.
- Остальные рынки продемонстрировали рост: на рынке ценных бумаг – в 2,2 раза, на рынке иностранных валют – на 12,3 %, объем торгов в данных сегментах рынка составил 494,9 млрд тенге и 842,4 млрд тенге соответственно.
- По итогам октября 2019 года значение Индекса KASE выросло на 3,6 % и составило 2 249,89 пунктов.
- На 01 ноября 2019 года в торговых списках KASE в секторе негосударственных ценных бумаг находились ценные бумаги 180 эмитентов.
- В секторе корпоративных облигаций объем первичных размещений достиг 403,2 млрд тенге.

РЫНОК АКЦИЙ

По итогам октября капитализация рынка акций выросла на 0,5 % или на 71,4 млрд тенге до 15,5 трлн тенге. Рост произошел за счет увеличения цен на акции ряда крупных компаний, в том числе входящих в расчет Индекса KASE.

На конец месяца в торговых списках KASE находились акции 141 наименования 125 эмитентов, из них четыре выпуска допущены к обращению в секторе нелистинговые ценные бумаги. В октябре из официального списка KASE были исключены простые акции АО "Аль СакрФинанс" по инициативе их эмитента.

Объем торгов акциями в октябре относительно сентября 2019 года вырос в 2,4 раза или на 5,6 млрд тенге до 9,6 млрд тенге. Среднедневной объем торгов составил 0,4 млрд тенге, среднедневное количество сделок составило 360, средний объем одной сделки – 1,2 млн тенге.

23 октября в торговой системе KASE было продано 44 989 простых акций АО "Дочернее предприятие "Актобе-Темир-ВС" на сумму 6,7 млрд тенге, что составило 69,5 % от общего объема торгов акциями.

Среди основных категорий инвесторов доля физических лиц составила 62,9 % от суммарного объема сделок с акциями. Доля банков второго уровня (БВУ) – 0,4 %, брокеров-дилеров – 19,3 %, доля других институциональных инвесторов – 1,5 %, доля прочих юридических лиц достигла 15,9 %. Участие нерезидентов оценивается в 21,3 %.

ИНДЕКС KASE

Индекс KASE завершил октябрь ростом на 3,6 %, или на 78,99 пунктов до 2 249,89 пунктов.

Изменение цен акций, входящих в представительский список KASE

Эмитент	Торговый код	Изменение цены		
		на 01.10.19	на 01.11.19	в октябре
KAZ Minerals PLC	GB_KZMS	2 034,97	2 253,40	+10,73 %
АО "Казактелеком"	KZTK	23 173,00	24 682,99	+6,52 %
АО "Народный сберегательный банк "Казахстана"	HSBK	121,50	127,20	+4,69 %
АО "КазТрансОйл"	KZTO	994,00	1 036,11	+4,24 %
АО "KEGOC"	KEGC	1 606,12	1 624,00	+1,11 %
АО "Кселл"	KCEL	2 170,00	2 175,00	+0,23 %
АО "Банк ЦентрКредит"	CCBN	229,99	228,01	-0,86 %

В отчетном месяце практически все акции индексной корзины продемонстрировали рост. Единственным представителем Индекса KASE, зафиксировавшим незначительное снижение, стали бумаги АО "Банк ЦентрКредит".

Напомним, что с 01 ноября 2019 года в представительский список Индекса KASE добавлены простые акции АО "Национальная атомная компания "Казатомпром".

РЫНОК КОРПОРАТИВНЫХ ОБЛИГАЦИЙ

На конец октября в официальном списке KASE находилось 256 выпусков корпоративных облигаций 67 эмитентов. В октябре в официальный список Биржи сектора корпоративных облигаций был включен один выпуск АО "Банк Развития Казахстана".

За отчетный месяц из торговых списков KASE были исключены три выпуска корпоративных облигаций трех эмитентов: АО "Ипотечная организация "Баспана", АО "Хоум Кредит энд Финанс Банк" и АО "КазАгроФинанс" в связи с истечением срока обращения.

Объем корпоративного долга в обращении в октябре вырос на 3 % или на 361,8 млрд тенге, достигнув отметки 12,5 трлн тенге.

Значение индекса доходности корпоративных облигаций KASE_BMY выросло в октябре на 8 базисных пунктов до 10,71 % годовых.

Объем торгов корпоративными облигациями на KASE вырос относительно сентября в 2,6 раза или на 253,1 млрд тенге до 407,6 млрд тенге. Среднедневной объем торгов составил 17,7 млрд тенге, среднедневное количество сделок – 10, средний объем одной сделки – 1,8 млрд тенге.

В октябре на первичном рынке в секторе корпоративных облигаций были размещены восемь выпусков на общую сумму 403,2 млрд тенге, что в 2,7 раза или на 253,8 млрд тенге выше показателя сентября.

- АО "Аграрная кредитная корпорация" привлекло 10 октября 3,3 млрд тенге, разместив семилетние облигации под 10,75 % годовых;
- Дочерняя организация АО Банк ВТБ (Казахстан) привлекла 03 октября 2,3 млрд тенге, разместив двухлетние облигации под 10,75 % годовых;
- АО "Национальная компания "Қазақстан темір жолы" привлекло 03 октября 300 млрд тенге, разместив 15-летние облигации под 11,5 % годовых;
- АО "Банк Развития Казахстана" привлекло 07 октября 20 млрд тенге, разместив 20-летние облигации в рамках Программы кредитования покупателей легкового автотранспорта отечественного производства;

- АО "Оптово-розничное предприятие торговли" привлекло 10 октября 360,4 млн тенге, разместив облигации под 10,493 % годовых;
- АО Дочерний Банк "Альфа-Банк" привлекло 25 октября 15 млрд тенге, разместив семилетние облигации под 10,75 % годовых;
- Дочерний банк АО "Хоум Кредит энд Финанс Банк" привлек 30 октября 2,6 млрд тенге, разместив облигации под 13,5 % годовых со сроком до погашения 2,1 года;
- АО "Ипотечная организация "Баспана" привлекло 59,7 млрд тенге, разместив облигации со средневзвешенной доходностью 10,9003 % годовых.

В разрезе основных категорий инвесторов на первичном рынке корпоративных облигаций доля БВУ составила 11,2 %, брокеров-дилеров – 1,8 %, других институциональных инвесторов – 86,2 %, прочих юридических лиц – 0,7 %. Нерезиденты в торгах участие не принимали.

Объем торгов на вторичном рынке облигаций снизился на 14,8 % или на 0,8 млрд тенге до 4,3 млрд тенге.

В разрезе основных категорий инвесторов на вторичном рынке доля БВУ составила 32,4 %, брокеров-дилеров – 12,9 %, других институциональных инвесторов – 16,9 %, прочих юридических лиц – 31 %, доля физических лиц – 6,8 %. Доля нерезидентов оценивается в 4,3 %.

РЫНОК ГОСУДАРСТВЕННЫХ ЦЕННЫХ БУМАГ (ГЦБ)

Номинальная стоимость торгуемого на KASE государственного долга в октябре выросла на 1,6 % или на 192,6 млрд тенге до 12,6 трлн тенге.

В октябре в секторе ГЦБ официального списка Биржи появились иностранные ГЦБ: с 10 октября – государственные международные облигации Министерства финансов Украины и Турецкой Республики, а с 29 октября – Министерства финансов Султаната Оман.

В октябре объем торгов на рынке ГЦБ снизился на 1,5 % или 1,1 млрд тенге до 68,1 млрд тенге. Среднедневной объем торгов сложился на уровне 3 млрд тенге, среднедневное количество сделок равно 4, средний объем одной сделки составил 782,6 млн тенге.

В отчетном месяце на первичном рынке ГЦБ объем торгов снизился на 25,2 % или на 9,6 млрд тенге до 28,5 млрд тенге. В рамках реализации государственных программ местные исполнительные органы трех областей и г. Алматы привлекли 8,7 млрд тенге (в сентябре состоялось одно размещение на сумму 396,5 млн тенге). Остальной объем – 19,8 млрд тенге что на 47,6 % или на 17,9 млрд тенге, меньше аналогичного показателя сентября – привлекло Министерство финансов, доразместив четыре выпуска облигаций с дюрацией от 1,7 до 6,9 лет под 9,13–9,90 % годовых.

В структуре инвесторов на первичном рынке на долю институциональных инвесторов пришлось 69,3 %, на долю прочих юридических лиц – 30,7 %. Нерезиденты в торгах не участвовали.

Объем торгов на вторичном рынке вырос на 27,4 % или на 8,5 млрд тенге до 39,6 млрд тенге. 87,3 % об общего оборота торгов вторичного рынка пришлось на ноты Национального Банка. Кроме того, в отчетном месяце были заключены первые 11 сделок с международными облигациями Турецкой Республики объемом 40,2 млрд тенге.

В структуре инвесторов на вторичном рынке на долю БВУ пришлось 47,7 %, на долю брокеров-дилеров – 4,9 %, на долю других институциональных инвесторов – 38,3 %, доля прочих юридических лиц составила 9 %, физических лиц – 0,1 %. Нерезиденты в торгах участие не принимали.

ОБЛИГАЦИИ МЕЖДУНАРОДНЫХ ФИНАНСОВЫХ ОРГАНИЗАЦИЙ (МФО)

На конец отчетного периода в торговых списках KASE находилось 27 выпусков облигаций пяти МФО: Евразийского банка развития, Европейского банка реконструкции и развития, Европейского инвестиционного банка, Международной финансовой корпорации (IFC) и Азиатского банка развития. В октябре в официальный список KASE был включен один выпуск двухлетних облигаций IFC.

В отчетном месяце IFC привлекла через подписку 9,5 млрд тенге, разместив двухлетние международные облигации под 9,5 % годовых. В общем объеме активных заявок на долю институциональных инвесторов пришлось 15,8 %, на долю прочих юридических лиц – 84,2 %.

Объем торгов на вторичном рынке составил 3,5 млн тенге и снизился на 95,6 % относительно сентября. Весь объем пришелся на брокерско-дилерские компании.

ПАИ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ФОНДОВ

На 01 ноября в секторе "Ценные бумаги инвестиционных фондов" находились восемь инструментов под управлением семи компаний. В отчетном месяце в данный сектор были включены простые акции SPDR Bloomberg Barclays 1-3 Month T-Bill ETF, выпущенные инвестиционным фондом SPDR SeriesTrust.

Объем торгов снизился на 95,6 % и составил 3,5 млн тенге. Лидерами по объему сделок выступают паи US_SPY_ (1,5 млн тенге) под управлением State Street Global Advisors, на втором месте CSECgm (1,4 млн тенге) и на третьем месте CSECfe (494,5 тыс. тенге) под управлением АО "Сентрас Секьюритиз", на последнем месте – акции IE_FXBF субфонда FinEx FFIN Kazakhstan Equity ETF (ETF на Индекс KASE; 32,6 тыс. тенге).

В разрезе основных категорий инвесторов 29,3 % приходится на физические лица, 22,1 % – на брокеров-дилеров и 48,6 % – на прочих юридических лиц.

СЧЕТА ФИЗИЧЕСКИХ ЛИЦ НА ФОНДОВОМ РЫНКЕ

На 01 ноября 2019 года в системе учета Центрального депозитария числилось 119 441 лицевых счетов, открытых физическими лицами, что на 973 счета меньше, чем месяцем ранее и на 2 617 счетов больше чем на начало 2019 года.

РЫНОК ИНОСТРАННЫХ ВАЛЮТ

Объем торгов на рынке иностранных валют достиг 842,4 млрд тенге, что выше показателя предыдущего месяца на 12,3 % или 92,4 млрд тенге. Среднедневной объем торгов составил 36,6 млрд тенге, среднее количество сделок – 265, средний объем одной сделки – 138,4 млн 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, кол-во котируемой валюты за ед. базовой	Курс на конец месяца (изм.%)
USD/KZT	2 092,3 (+8,8 %)	96,7 % (-2,53 %)	5 896 (-658)	387,92 – 390,13	388,67 (+0,2 %)
RUB/KZT	4 144,4 (X 8,8)	3,0 % (+2,59 %)	117 (+39)	5,9528 – 6,1230	6,0965 (+1,6 %)
CNY/KZT	19,1 (-6,2 %)	0,1 % (-0,02 %)	50 (-1)	54,5846 – 55,2900	55,2900 (+1,5 %)
EUR/KZT	4,5 (-2,6 %)	0,2 % (-0,03 %)	25 (-5)	425,50 – 435,60	434,65 (+2,3 %)

ДЕНЕЖНЫЙ РЫНОК

К концу октября индикатор TONIA снизился на 196.п. до 8,57 % годовых, значение индикатора TWINA (средневзвешенная процентная ставка по сделкам открытия репо сроком на семь рабочих дней) тоже продемонстрировало снижение на 53 б.п. до 8,92 % годовых.

Доходность однодневного долларowego свопа SWAP-1D (USD) на конец октября достигла 8,08 % годовых, потеряв за месяц 84 б.п. Доходность двухдневного свопа SWAP-2D (USD) снизилась на 91 б.п. до 8,22 % годовых.

В октябре индикатор KazPrime-3M (KZT) продолжил свое движение на верхней границе базовой ставки Национального Банка 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 октября снизился на 30 б.п. до 8,49 % годовых.

Рынок операций репо

Объем торгов в данном сегменте составил 5,6 трлн тенге, что ниже показателя прошлого месяца на 9,8 %. Среднедневной объем операций составил 243,5 млрд тенге, среднее количество сделок – 390, средний объем одной сделки – 623,8 млн тенге.

97 % от общего объема сделок открытия репо пришлось на сделки авторепо с корзиной ГЦБ. Наиболее популярным инструментом на рынке авторепо с корзиной ГЦБ остается операция репо сроком на один день, доля сделок с ним в общем объеме торгов на рынке авторепо с корзиной ГЦБ составила 80,7 %.

Рынок валютного свопа

Объем торгов на рынке валютного свопа вырос на 4,7 % до 2,76 трлн тенге. Среднедневной объем операций составил 131,6 млрд тенге, среднее количество сделок – 45, средний объем одной сделки – 2,9 млрд тенге.

Объем торгов на рынке валютного свопа снизился на 16,5 % или 382,8 млрд тенге до 1,9 трлн тенге. Среднедневной объем операций составил 84,2 млрд тенге, среднее количество сделок – 31, средний объем одной сделки – 2,7 млрд тенге. В инструментальной структуре 70,5 % от общего объема торгов (1,4 трлн тенге или 3,5 млрд USD) на рынке валютного свопа пришлось на сделки с двухдневным валютным свопом (USDKZT_0_002).

В октябре было заключено 14 сделок с "длинными" валютными свопами – 12 сделок с недельными свопами на сумму 148 млн долларов США (57,6 млрд тенге) под 8–8,5 % годовых; и две сделки со свопами на месяц на сумму 16,9 млн долларов США (6,6 млрд тенге) под 8–8,25 % годовых.

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 октябре сделок с фьючерсами заключено не было. К началу ноября 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 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.