

ПРЕСС-РЕЛИЗ

г. Алматы

14 февраля 2022 года

KASE представляет итоги работы биржевого рынка за январь 2022 года

АО "Казахстанская фондовая биржа" (KASE, Биржа) информирует об основных итогах деятельности за январь 2022 года:

- Совокупный объем торгов на KASE в январе 2022 года составил 19,7 трлн тенге и снизился относительно декабря 2021 на 26,2 % или 7,0 трлн тенге.
- По итогам января значение Индекса KASE снизилось на 3,4 % и составило 3 549,26 пунктов.
- По итогам января капитализация рынка акций снизилась на 7,2 % до 26,7 трлн тенге, объем торгуемого корпоративного долга – на 0,2 % до 15,4 трлн тенге.
- Процедуру листинга прошел один новый эмитент.
- По состоянию на 01 февраля 2022 года в торговых списках KASE находились негосударственные ценные бумаги 559 наименований 229 эмитентов.
- По состоянию на 01 февраля 2022 года в Центральной депозитарии числилось 221 799 лицевых счетов, открытых на 202 210 физических лиц. По итогам января физическими лицами зарегистрировано 4 615 новых лицевых счетов.

КЛЮЧЕВЫЕ ПРОЕКТЫ И МЕРОПРИЯТИЯ

29 января 2022 года проведен вебинар для начинающих розничных инвесторов "Основы инвестиционной грамотности". В ходе онлайн-семинара более 100 участников ознакомились о первых шагах в инвестировании, базовых инвестиционных концепциях, о рисках инвестиционного мошенничества, а также о рисках инвестирования и способах их снижения.

РЫНОК АКЦИЙ

По итогам января 2022 года капитализация рынка акций составила 26,7 трлн тенге (61,5 млрд USD), что на 2,1 трлн тенге или 7,2 % ниже аналогичного показателя предыдущего месяца. Основная доля снижения пришлась на капитализацию трех компаний за счет корректировки цены их акций: Kaspi.kz, АО "НАК "Казатомпром", АО "Народный сберегательный банк Казахстана".

На конец января в торговых списках KASE находились акции 164 наименований 150 эмитентов, из них акции трех наименований трех эмитентов допущены к обращению в секторе "Нелистинговые ценные бумаги". В отчетном месяце в официальный список KASE новые акции не включались и не исключались.

Объем торгов акциями в январе снизился на 95,4 % или 206,3 млрд тенге до 10,0 млрд тенге, относительно высокого показателя декабря. Напомним, что в декабре были проведены специализированные торги по выкупу простых акций АО "Народный сберегательный банк Казахстана" на сумму 127,2 и приобретению простых акций АО "КазАзот" на сумму 67,1 млрд тенге. При этом количество заключенных сделок снизилось на 5,5 % до 39 730 сделок.

Среднедневной объем торгов составил 586,6 млн тенге, среднее количество сделок – 2 337, средний объем одной сделки – 251,0 тыс. тенге. Торги акциями в январе проходили исключительно на вторичном рынке.

Среди основных категорий инвесторов на долю физических лиц пришлось 34,3 % от суммарного объема сделок с акциями. Доля банков второго уровня (БВУ) составила 0,3 %, брокеров-дилеров – 13,5 %. На долю других институциональных инвесторов пришлось 26,4 %, прочих юридических лиц – 25,5 %. Участие нерезидентов оценивается в 0,2 %.

ИНДЕКС KASE

В первый торговый день года 5 января, на фоне напряженной внутренней ситуации в цене упали акции всех публичных компаний. Под наиболее внушительным давлением оказались ценные бумаги, торгуемые на Лондонской фондовой бирже, это Kaspi.kz, АО "Народный сберегательный банк Казахстана" и АО "НАК "Казатомпром".

В течение следующих двух недель динамика стоимости акций развивалась разнонаправленно под воздействием большого количества корпоративных новостей. Ряд важных назначений и объявлений был сделан за пределами непосредственно индексных компаний. В этот период рынок большую часть времени находился в боковом тренде.

С 26 января индексные компании приступили к публикации годовых оперативных отчетов и акции постепенно перешли к росту в ожидании дивидендного сезона. По итогам месяца индексные компании разделились на три группы. Акции компаний, которые меньше всего отреагировали на январские события, смогли завершить месяц в зеленой зоне: АО "Kcell" вырос в цене на 7 %, АО "КазТрансОйл" – на 3,2 %, АО "Банк ЦентрКредит" – на 1,3 %. Небольшое снижение в цене зафиксировано по акциям АО "KEGOC" и АО "Казакхтелеком" – до 1 %. Более значительная корректировка по итогам месяца зафиксирована по акциям АО "НАК "Казатомпром", АО "Народный сберегательный банк Казахстана".

По итогам января Индекс KASE потерял 3,4 % и закрыл месяц на уровне 3 549,26 пунктов.

Объем сделок с индексными акциями в январе 2022 года составил 6,8 млрд тенге, что на 104,4 % или 3,5 млрд тенге выше аналогичного показателя за декабрь 2021 года (без учета сделок, заключенных в рамках спецторгов).

Наибольший объем торгов пришелся на простые акции АО "Кселл" – 2,9 млрд тенге (43,3 % от общего объема торгов с индексными акциями).

Эмитент	Торговый код	Цена, тенге за акцию			Объем торгов, млн тенге		
		на 01.02.2022	на 01.01.2022	Δ, %	январь	декабрь	Δ
АО "Kcell"	KCEL	1 739,99	1 626,91	+7,0	2 930,7	1 126,8	+1 803,9
АО "КазТрансОйл"	KZTO	1 129,00	1 094,10	+3,2	1 245,5	142,5	+1 103,0
АО "Банк ЦентрКредит"	CCBN	403,00	398,00	+1,3	1 635,5	1 023,2	+612,3
АО "KEGOC"	KEGC	1 862,00	1 870,52	-0,5	52,3	82,1	-29,8
АО "Казакхтелеком"	KZTK	35 399,00	35 800,00	-1,1	72,2	150,2	-78,0
АО "НАК "Казатомпром"	KZAP	14 165,00	16 890,00	-16,1	215,7	243,5	-27,8
АО "Народный сберегательный банк Казахстана"	HSBK	152,99	186,99	-18,2	613,4	541,8	+71,6

KASE GLOBAL

На конец января в списках KASE Global находились акции 43 наименований.

Объем торгов акциями в январе 2021 года относительно декабря 2022 года снизился на 73,9 % или 4,2 млрд тенге до 1,5 млрд тенге, при этом количество сделок уменьшилось на 28,6 % до 2 260 сделок. Среднедневной объем торгов составил 87,8 млн тенге, среднедневное количество сделок – 133, средний объем одной сделки – 660,8 тыс. тенге.

Среди основных категорий инвесторов на долю физических лиц пришлось 19,4 % от суммарного объема сделок с акциями. Доля брокеров-дилеров составила 48,3 %. На долю других институциональных инвесторов пришлось 15,6 %, прочих юридических лиц – 16,6 %. Доля нерезидентов оценивается в 0,2 %.

КОРПОРАТИВНЫЕ ОБЛИГАЦИИ

Объем корпоративного долга в обращении в январе 2022 года снизился на 0,2 % или 24,0 млрд тенге до 15,4 трлн тенге (35,5 млрд USD).

На конец января 2022 года в официальном списке KASE находились корпоративные облигации 320 выпусков 82 эмитентов. За январь 2022 года в официальный список KASE были включены облигации четырех выпусков от трех эмитентов (один новый): два выпуска ТОО "ТехноЛизинг" и по одному выпуску АО "BCC Invest" - дочерняя организация АО "Банк ЦентрКредит" и ТОО "МФО "Капиталинвест". С начала года из официального списка KASE были исключены корпоративные облигации двух выпусков двух эмитентов в связи с истечением срока обращения.

Значение индекса доходности корпоративных облигаций KASE_BMY в январе 2022 года снизилось на 15 базисных пунктов до 10,46 % годовых.

Объем торгов корпоративными облигациями на KASE уменьшился относительно декабря 2021 года на 89,8 % или 249,6 млрд тенге до 28,2 млрд тенге. Среднедневной объем торгов составил 1,7 млрд тенге (на вторичном рынке – 1,6 млрд тенге), среднедневное количество сделок – 46 (на вторичном рынке – 46 сделок), средний объем одной сделки – 36,2 млн тенге (на вторичном рынке – 34,0 млн тенге).

В январе 2022 года объем первичного рынка корпоративных облигаций составил 1,8 млрд тенге, что ниже показателя декабря 2021 года на 99,1 % или 196,6 млрд тенге. В отчетном месяце состоялось одно размещение – АО "Казахстанский фонд устойчивости" разместил облигации со средневзвешенной доходностью к погашению 10,32 % годовых и сроком до погашения - один год. Весь объем размещенных облигаций был выкуплен институциональными инвесторами.

Объем торгов на вторичном рынке облигаций относительно декабря 2021 года снизился на 66,7 % или 53,0 млрд тенге до 26,4 млрд тенге.

В разрезе основных категорий инвесторов на вторичном рынке корпоративных облигаций доля БВУ составила 1,9 %, брокерско-дилерских организаций – 6,5 %, других институциональных инвесторов – 16,0 %, прочих юридических лиц – 63,8 %, доля физических лиц – 11,9 %. Доля нерезидентов составила 8,6 %.

ГОСУДАРСТВЕННЫЕ ЦЕННЫЕ БУМАГИ (ГЦБ)

Сумма государственного долга по номиналу, торгуемого на KASE, составила 17,3 трлн тенге (39,8 млрд USD), снизившись с начала года на 3,1 % или 553,1 млрд тенге.

Суммарный объем торгов ГЦБ на KASE составил 236,0 млрд тенге и снизился относительно декабря 2021 года на 5,3 % или 13,2 млрд тенге.

По итогам января 2022 года среднедневной объем торгов составил 13,9 млрд тенге (на вторичном рынке – 4,0 млрд тенге), среднедневное количество сделок – 8 (на вторичном рынке – 6), средний объем одной сделки – 1,7 млрд тенге (средний объем одной сделки на вторичном рынке – 0,7 млрд тенге).

Объем торгов на первичном рынке ГЦБ вырос на 53,3 % или на 58,6 млрд тенге до 168,4 млрд тенге. Весь объем пришелся на размещение казначейских обязательств Министерства финансов Республики Казахстан. Всего было размещено семь выпусков облигаций под 10,21-11,50 % годовых.

В разрезе основных категорий инвесторов на первичном рынке на долю БВУ пришлось 25,0 %, других институциональных инвесторов – 61,5 %, доля прочих юридических лиц составила 13,5 %. Нерезиденты на первичном рынке ГЦБ участие не принимали.

Объем торгов на вторичном рынке снизился на 51,5 % или на 71,8 млрд тенге до 67,6 млрд тенге. Доля торгов нотами Национального Банка на вторичном рынке составила 12,6 % или 8,5 млрд тенге от общего объема торгов, доля МЕКАМ – 83,7 % или 56,6 млрд тенге, доля еврооблигаций Республики Казахстан – 2,4 % или 1,7 млрд тенге. Остальной объем, составляющий 1,2 % (0,8 млрд тенге), пришелся на сделки с ГЦБ иностранных государств.

В разрезе основных категорий инвесторов на вторичном рынке на долю банков пришлось 16,3 %, на долю брокеров-дилеров – 1,9 %, на долю других институциональных инвесторов – 4,9 %, доля

прочих юридических лиц составила 76,1 %, на долю физических лиц пришлось 0,9 %. Участие нерезидентов оценивается в 3,7 %.

ОБЛИГАЦИИ МЕЖДУНАРОДНЫХ ФИНАНСОВЫХ ОРГАНИЗАЦИЙ

На конец года в торговых списках KASE находились облигации 45 выпусков четырех международных финансовых организаций: Евразийского банка развития, Европейского банка реконструкции и развития, Международной финансовой корпорации и Азиатского банка развития.

В январе 2022 года весь объем торгов пришелся на торги на вторичном рынке и составил 9,2 млрд тенге против 2,6 млрд тенге месяцем ранее, увеличившись на 6,7 млрд тенге или в 3,6 раз.

На первичном рынке сектора облигаций международных финансовых организаций в январе 2022 году размещений не было.

В разрезе основных категорий инвесторов на вторичном рынке облигаций международных финансовых организаций доля БВУ составила 35,6 %, брокеров-дилеров – 14,2 %, других институциональных инвесторов – 49,9 %, прочих юридических лиц – 0,3 %. Нерезиденты в торгах участие не принимали.

ПАИ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ФОНДОВ

На 01 февраля 2022 года в секторе "Ценные бумаги инвестиционных фондов" находились 19 инструментов паевых инвестиционных фондов под управлением шести управляющих компаний и шесть ETF.

В отчетном месяце объем торгов составил 2,2 млрд тенге и вырос относительно декабря 2021 года на 0,2 % или 5,3 млн тенге.

В разрезе основных категорий инвесторов 20,3 % приходится на физические лица, 42,5 % – на брокеров-дилеров, 0,4 % – на других институциональных инвесторов, 36,9 % – на прочих юридических лиц. Доля нерезидентов составила 0,2 %.

ПРОИЗВОДНЫЕ ЦЕННЫЕ БУМАГИ

По состоянию на 01 февраля 2022 года в официальном списке KASE находилось глобальные депозитарные расписки (ГДР) пяти выпусков, базовыми активами которых являются простые акции АО "Национальная атомная компания "Казатомпром", АО "Народный сберегательный банк Казахстана", АО Kaspi.kz, АО "Казахтелеком" и АО "ForteBank".

Объем торгов в январе 2022 года составил 2,8 млрд тенге против показателя декабря 2021 года 0,1 млрд тенге. В разрезе основных категорий инвесторов 43,3 % пришлось на счета физических лиц, 1,9 % – на брокерско-дилерские организации, 42,5 % – на других институциональных инвесторов и 12,4 % – на прочих юридических лиц. Доля нерезидентов составила менее 0,1 %.

СЧЕТА ФИЗИЧЕСКИХ ЛИЦ НА РЫНКЕ ЦЕННЫХ БУМАГ

По состоянию на 01 февраля 2022 года в Центральном депозитарии ценных бумаг числилось 221 799 лицевых счетов, открытых на 202 210 физических лиц. По итогам января физическими лицами зарегистрировано 4 615 новых лицевых счетов.

РЫНОК ИНОСТРАННЫХ ВАЛЮТ

В январе текущего года в торгах на рынке иностранных валют на KASE принимало участие 30 членов KASE.

Объем торгов на рынке иностранных валют в январе достиг 1,2 трлн тенге, что ниже аналогичного показателя предыдущего месяца на 37,6 % или 742,4 млрд тенге. Среднедневной объем торгов составил 72,5 млрд тенге, среднее количество сделок – 373, средний объем – 194,3 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 января (изм.%)
USD/KZT	2 786,87 (-36,6 %)	98,2 % (+1,6 %)	6 085 (-3 955)	431,30 – 435,48	433,52 (+0,40 %)
RUB/KZT	3 017,12 (-66,6 %)	1,4 % (-1,3 %)	181 (-203)	5,4650-5,8500	5,5980 (-5,53 %)
CNY/KZT	72,52 (-62,3%)	0,4 % (-0,3 %)	66 (-98)	67,7500 – 68,8100	68,2590 (+0,60 %)
EUR/KZT	0,80 (x5,3)	0,03 % (+0,03 %)	10 (+8)	483,75 – 496,10	483,75 (-1,68 %)

ДЕНЕЖНЫЙ РЫНОК

Совокупный объем торгов на рынке денег в январе составил 18,2 трлн тенге, снизившись относительно показателя декабря прошлого года на 24,2 %, или на 5,8 трлн тенге.

24 января 2022 года Комитет по денежно-кредитной политике Национального Банка Республики Казахстан принял решение установить базовую ставку на уровне 10,25% годовых с процентным коридором +/- 1,00 п.п. Соответственно, ставка по операциям постоянного доступа по предоставлению ликвидности составила 11,25 %, а по операциям постоянного доступа по изъятию ликвидности – 9,25 %. Решение принято как часть общей политики по снижению инфляции в рамках разработки совместно с Правительством Республики Казахстан комплекса мер по контролю за инфляцией.

Композитный индикатор денежного рынка MM_Index, представляющий собой средневзвешенное значение доходности по операциям валютного свопа и операциями автоматического репо с ГЦБ, открытыми на один рабочий день, увеличился на 49 б.п. с 10,52 % годовых до 11,01 % годовых.

РЫНОК ОПЕРАЦИЙ РЕПО

Совокупный объем операций репо в январе 2022 года составил 17,3 трлн тенге, что меньше объемов декабря 2021 года на 5,3 трлн тенге или на 23,4 %. Среднедневной объем операций составил 1 015,6 млрд тенге, среднее количество ежедневных заключенных сделок – 837, средний объем одной сделки – 1 213,0 млн тенге.

Объем операций авторепо с ГЦБ составил 11 873,3 млрд тенге или 68,8 %, авторепо с НЦБ – 5 391,6 млрд тенге или 31,2 %, прямое репо НЦБ – 1,0 млрд тенге или 0,01 %.

По итогам января 2022 года индикатор TONIA вырос на 46 б.п. с 10,56 % до 11,02 % годовых, значение индикатора TRION – на 45 б.п. с 10,53 % до 10,98 % годовых, значение индикатора TWINA - на 86 б.п. с 10,34% до 11,20% годовых

ОПЕРАЦИИ ВАЛЮТНОГО СВОПА

Совокупный объем операций валютного свопа в январе 2022 года снизился в сравнении с декабрем 2021 года на 36,1 % или 514,1 млрд тенге до 910,2 млрд тенге. Среднедневной объем операций в минувшем месяце составил 53,5 млрд тенге, среднее количество сделок – 16, средний объем одной сделки – 3,3 млрд тенге.

В инструментальной структуре 69,5 % от общего объема торгов (632,8 млрд тенге или 1 458,3 млн USD) на рынке валютного свопа пришлось на сделки с однодневным валютным свопом (USDKZT_0_001), 23,3 % от общего объема торгов (212,2 млрд тенге или 489,2 млн USD) на рынке валютного свопа пришлось на сделки с двухдневным валютным свопом (USDKZT_0_002), 1,4 % от общего объема торгов (52,1 млрд тенге или 120,0 млн USD) на сделки

недельного валютного свопа (USDKZT_01W), 5,7 % от общего объема торгов (13,0 млрд тенге или 30,0 млн USD) с месячным валютным свопом (USDKZT_01M).

Доходность однодневного долларowego свопа SWAP-1D (USD) на конец января составила 10,78% годовых и выросла за январь на 130 б.п. Доходность двухдневного валютного свопа SWAP-2D (USD) увеличилась на 32 б.п. до 10,56 % 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 январе 2022 года сделок заключено не было. К началу февраля 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.