



ПРЕСС-РЕЛИЗ

г. Алматы

07 ноября 2018 года

KASE представляет итоги работы биржевого рынка в октябре 2018 года

АО "Казахстанская фондовая биржа" (KASE, Биржа) представляет итоги работы биржевого рынка в октябре 2018 года.

- Совокупный объем торгов на KASE составил 10,2 трлн тенге и снизился относительно предыдущего месяца на 15,8 % или 1,9 трлн тенге.
- На 01 ноября 2018 года к торгам на Бирже были доступны ценные бумаги 382 наименований 152 эмитентов. В октябре в официальный список KASE были включены простые акции АО "ПОЗИТИВ-А", облигации АО "КазАгроФинанс" и 4 выпуска облигаций АО "Цеснабанк".
- Объем корпоративного долга в обращении вырос на 2,4 %, достигнув отметки 10 трлн тенге.
- По итогам октября значение Индекса KASE выросло на 0,4 % до 2 204,81.
- На первичном рынке корпоративных облигаций общая сумма привлечения составила 48 млрд тенге.
- Евразийский банк развития привлек в октябре 20 млрд тенге, разместив пятилетние облигации под 9,5 % годовых.
- На 01 ноября 2018 года в Центральной депозитарии числилось 113 679 лицевых счетов, открытых физическими лицами, что на 1 831 счетов больше, чем месяцем ранее и на 4 434 счета больше чем на начало года.

РЫНОК АКЦИЙ

На 01 ноября 2018 года в торговых списках KASE находились акции 123 наименований 108 эмитентов, в том числе на нелистинговой площадке – акции четырех наименований четырех компаний. В октябре в официальный список KASE были включены простые акции АО "ПОЗИТИВ-А".

Капитализация рынка акций KASE в октябре изменилась незначительно. Рост в тенговом выражении достиг 0,4 % или 62,7 млрд тенге до 15,3 трлн тенге.

Индекс KASE прервал четырехмесячную череду снижений, повысившись в октябре на 0,4 % или на 9,5 пунктов до уровня 2 204,81. Основным определяющим событием на рынке стала публикация ряда финансовых и производственных отчетов за период январь–сентябрь 2018 года.

Изменение цен акций, входящих в представительский список KASE

Эмитент	Торговый код	Изменение цены, %		
		на 01.10.2018	на 01.11.2018	в октябре
АО "Народный Банк"	HSBK	93,6	105,1	12,3
АО "KEGOC"	KEGC	1 494,9	1 548,0	3,6
АО "КазТрансОйл"	KZTO	1 300,02	1 300,0	-
АО "Кселл"	KCEL	1 689,2	1 689,0	-0,01
АО "Казахтелеком"	KZTK	30 400,0	29 100,0	-4,3
АО "Банк ЦентрКредит"	CCBN	253,0	241,5	-4,5
KAZ Minerals PLC	GB_KZMS	2 616,0	2 399,0	-8,3

Наибольший рост из индексных акций показали долевые инструменты АО "Народный Банк", цена которых выросла на 12,3 % или 11,5 тенге до 105,1 тенге за акцию. Бумаги опустившись в сентябре до минимума с начала года, стали вновь привлекательны для инвесторов, восстановление цены сопровождалось увеличением объемов торгов. Положительным фактором для роста ценовых показателей акций АО "Народный Банк" послужила позитивная финансовая отчетность, демонстрирующая рост чистой прибыли банка.

Наибольшее давление на динамику Индекса KASE оказали акции KAZ Minerals PLC, которые снизились на 8,3 % или на 217 тенге до 2 399 тенге. В октябре акции достигли своих минимальных значений, зафиксированных в сентябре. Фундаментально, давление на акции оказывает решение компании о разработке Баимского месторождения. В конце октября компания предоставила производственный отчет по итогам девяти месяцев 2018 года, согласно которому компания произвела 217 тыс. тонн меди, что на 12 % больше, чем за аналогичный период 2017 года. По сообщению KAZ Minerals, компания на пути достижения запланированного на 2018 год прогнозного диапазона производства 270-300 тыс. тонн меди.

Объем торгов акциями снизился относительно предыдущего месяца на 41,1 % или 30,9 млрд тенге до 44,4 млрд тенге. Среднедневной объем торгов составил 1,9 млрд тенге, среднедневное количество сделок – 474, средний объем одной сделки – 4,1 млн тенге. Весь объем сделок прошел в секторе купли-продажи. Размещений в октябре не было. В секторе вторичного рынка был осуществлен выкуп привилегированных акций АО "Разведка Добыча "Казмунайгаз" на сумму 2,5 млрд тенге по 12 800 тенге за акцию и простых акций АО Kaspi.kz на 19 млрд тенге по цене 4 750 тенге за акцию.

В разрезе основных категорий инвесторов наиболее активными были физические лица, на счета которых пришлось 47,8 % от брутто-оборота торгов акциями. Доля банков второго уровня (БВУ) составила менее 0,1 %, участие брокеров-дилеров оценивается в 15,8 %. На счета других институциональных инвесторов пришлось 4,3 %, доля прочих юридических лиц составила 32,1 %. Участие нерезидентов оценивается в 24,2 %.

РЫНОК КОРПОРАТИВНЫХ ОБЛИГАЦИЙ

На 01 ноября 2018 года в торговых списках KASE находились 239 выпусков облигаций, выпущенных 59 эмитентами. В отчетном месяце в официальный список были включены облигации АО "Цеснабанк" (TSBNb33, TSBNb34, TSBNb35, TSBNb36) и АО "КазАгроФинанс" (KAFib8). Исключены в связи с аннулированием выпуска облигации АО "Банк Развития Казахстана" (BRKZb4), по инициативе эмитента – облигации АО "Алатау Жарық Компаниясы" (AZHKb3) и ТОО "СФК "Capital Group" (CPGRb1).

Объем торгуемого на KASE корпоративного долга в октябре вырос на 2,4 % или 229,3 млрд тенге до 10 трлн тенге.

Объем торгов корпоративными облигациями на KASE составил 55 млрд тенге, снизившись относительно сентября на 93,6 %. Среднедневной объем торгов составил 2,4 млрд тенге, среднедневное количество сделок – 13, средний объем одной сделки – 183,2 млн тенге.

В октябре на KASE состоялось пять размещений на общую сумму 48 млрд тенге:

- АО "Ипотечная организация "Баспана" привлекло 9,9 млрд тенге, разместив годовые облигации по цене 992,38 тенге;
- АО "Kaspi Bank" привлекло 9 млрд тенге, разместив облигации со сроком до погашения 4,3 года под 11,50 % годовых;
- АО "КазАгроФинанс" привлекло 9,3 млрд тенге, разместив годовые облигации со средневзвешенной доходностью к погашению 11,2719 % годовых;
- АО "Евразийский банк" привлекло 19,7 млрд тенге, разместив двухлетние облигации с доходностью к погашению 12 % годовых;
- ТОО "Компания Фаэтон" привлекло 130,2 млн тенге, разместив облигации со сроком до погашения 6,7 лет под 10,99 % годовых.

В разрезе основных категорий инвесторов на первичном рынке корпоративных облигаций доля БВУ составила 10,3 %, брокеров-дилеров – 3,8 %. На долю других институциональных инвесторов пришлось 80,8 %, прочих юридических лиц – 5,1 %.

Объем торгов на вторичном рынке облигаций снизился на 9,8 млрд тенге или на 58,3 % и составил 7 млрд тенге. Значение индекса доходности корпоративных облигаций KASE_BMY выросло в октябре на 15 базисных пунктов до 10,7 % годовых.

В разрезе основных категорий инвесторов на вторичном рынке корпоративных облигаций доля БВУ составила 7,6 %, брокеров-дилеров – 38,4 %, других институциональных инвесторов – 24,4 %, прочих юридических лиц – 15,7 %, доля физических лиц – 14 %. Участие нерезидентов оценивается в 25,3 % от брутто-оборота.

РЫНОК ГОСУДАРСТВЕННЫХ ЦЕННЫХ БУМАГ (ГЦБ)

Номинальная стоимость торгуемого на KASE государственного долга в октябре обновила свой исторический максимум, достигнув 11 330,6 млрд тенге, что на 6,3 % или 672,5 млрд тенге выше чем по итогам сентября.

В октябре объем торгов на рынке ГЦБ составил 130,1 млрд тенге, снизившись относительно предыдущего месяца на 32,4 % или на 62,5 млрд тенге. Среднедневной объем торгов сложился на уровне 5,7 млрд тенге, среднедневное количество сделок – 6, средний объем одной сделки – 1 млрд тенге.

На первичном рынке ГЦБ объем сделок снизился на 84,7 % или 69,2 млрд тенге до 12,5 млрд тенге. В отчетном месяце в рамках реализации государственных программ местные исполнительные органы пяти областей Костанайской, Северо-Казахстанской, Атырауской, Павлодарской, Алматинской и г. Астаны привлекли весь объем размещения под 0,35%.

Объем торгов на вторичном рынке вырос на 6,1 % до 117,6 млрд тенге. 97,1 % об общего оборота торгов вторичного рынка пришлось на ноты Национального Банка.

В структуре инвесторов на вторичном рынке ГЦБ на долю БВУ пришлось 61,5 %, на долю брокеров-дилеров – 2,8 %, на долю других институциональных инвесторов – 27,4 %, доля прочих юридических лиц составила 8,3 %, на долю физических лиц пришлось менее 0,1 %. Участие нерезидентов оценивается в 1,7 %.

Облигации МФО

На конец отчетного периода в торговых списках KASE находилось 14 выпусков облигаций трех международных финансовых организаций: Евразийского банка развития, Европейского банка реконструкции и развития и Международной финансовой корпорации.

В октябре Евразийский банк развития привлек 20 млрд тенге, разместив пятилетние облигации под 9,5 % годовых. Объем торгов на вторичном рынке составил 411 млн тенге (в сентябре данный показатель равнялся 10 млн тенге).

Паи инвестиционных фондов

На 01 ноября в секторе "Ценные бумаги инвестиционных фондов" находились шесть инструментов под управлением пяти компаний. Объем торгов вырос в 2,5 раза и достиг 26,9 млн тенге. В разрезе основных категорий инвесторов доля физических лиц составила 39,3 %, брокеров-дилеров – 27,2%, прочих юридических лиц – 33,6 %.

Счета физических лиц на рынке ценных бумаг

На 01 ноября 2018 года в Центральной депозитарии числилось 113 679 лицевых счетов, открытых физическими лицами, что на 1 831 счета больше, чем месяцем ранее и на 4 434 счета больше чем на начало года.

РЫНОК ИНОСТРАННЫХ ВАЛЮТ

В октябре в торгах на рынке иностранных валют на KASE принимали участие 29 членов KASE.

Объем торгов на рынке иностранных валют сложился на уровне 948,8 млрд тенге, что ниже показателя предыдущего месяца на 32,8 % или 463 млрд тенге. Среднедневной объем торгов составил 41,3 млрд тенге, среднедневное количество сделок – 239, средний объем одной сделки – 172,7 млн тенге.

Достигнув своего максимального значения октября в его первую неделю, обменный курс пары доллар / тенге начал постепенно снижаться. Вторая неделя октября прошла без резких колебаний курсов в преддверии очередного решения Национального Банка РК по базовой ставке. После ожидаемого её повышения тенге демонстрировал укрепление, однако потерял большую часть позиций в последние шесть торговых сессий отчетного месяца. При относительно стабильном обменном курсе пары доллар / рубль, ослабление тенге проходило на фоне падения котировок нефти эталонной марки Brent, которая за месяц снизились почти на 9 %.

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 базовой валюты за ед. котируемой	Курс на конец месяца (изм.%)
USD/KZT	2 565,9 (-32,8 %)	99,2 % (-0,29 %)	5 271 (-887)	360,65 – 373,71	368,95 (+1,6 %)
RUB/KZT	882,0 (+7,6 %)	0,5 % (+0,20 %)	155 (+2)	5,5441 – 5,6256	5,6250 (+1,5 %)
CNY/KZT	16,9 (+3,4 %)	0,1 % (+0,03 %)	49 (-12)	52,0000 – 53,9200	52,8450 (+0,4 %)
EUR/KZT	3,7 (+5,7 %)	0,2 % (+0,06 %)	19 (0)	418,65 – 429,40	419,00 (-0,9 %)

ДЕНЕЖНЫЙ РЫНОК

К концу октября индикатор TONIA снизился на 6 б.п. до 8,25 % годовых. В то же время индикатор TWINA (средневзвешенная процентная ставка по сделкам открытия репо сроком на семь рабочих дней) показал снижение на 35 б.п. до 8,27 % годовых.

Доходность однодневного долларового свопа SWAP-1D (USD) на конец октября достигла 8,00 % годовых, опустившись за месяц на 138 б.п. Доходность двухдневного свопа SWAP-2D (USD) также продемонстрировала снижение на 145 б.п. до 7,81 % годовых.

В октябре индикатор KazPrime-3M (KZT) продолжил движение на верхней границе базовой ставки Национального Банка, повысившись за месяц на 25 б.п. до уровня 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 25 б.п. до 8,24 % годовых.

Рынок операций репо

Объем торгов в данном сегменте составил 6 трлн тенге, что ниже показателя прошлого месяца на 16 %. Среднедневной объем операций в августе составил 261,2 млрд тенге, среднедневное количество сделок – 407, средний объем одной сделки – 641,6 млн тенге.

98,3 % от общего объема сделок 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 78,4 %.

Рынок валютного свопа

Объем торгов на рынке валютного свопа вырос на 22,9 % до 3 трлн тенге. Среднедневной объем операций составил 131,4 млрд тенге, среднедневное количество сделок – 49, средний объем одной сделки – 2,7 млрд тенге. В инструментальной структуре 78 % от общего объема торгов или 2,4 трлн тенге на рынке валютного свопа пришлось на сделки с двухдневным валютным свопом (USDKZT_0_002). В октябре было совершено четыре сделки с инструментом RUBKZT_0_001 на общую сумму 111,4 млн тенге или 20 млн рублей по ставке 7,5 % 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 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.