

АО "КАЗАХСТАНСКАЯ ФОНДОВАЯ БИРЖА"

ПРЕСС-РЕЛИЗ

г. Алматы

13 сентября 2017 года

KASE представляет итоги работы биржевого рынка в августе 2017 года

АО "Казахстанская фондовая биржа" (KASE или Биржа) информирует об основных итогах работы биржевого рынка в августе 2017 года.

- Совокупный объем торгов на KASE в августе достиг 10 218,3 млрд тенге, что выше показателя предыдущего месяца на 2,2 %. Положительную динамику продемонстрировали рынок иностранных валют (+32 %), рынок денег (+10 %), рынок корпоративных облигаций (в 8 раз) и рынок ценных бумаг инвестиционных фондов (в 24 раза)
- Индекс KASE вырос на 9,7 %, обновив девятилетний максимум
- Объем первичных размещений на рынке корпоративных облигаций достиг 80,8 млрд тенге
- Объем специализированных торгов на первичном рынке ГЦБ вырос на 90 % до 33,6 млрд тенге, на вторичном рынке ГЦБ объем торгов вырос в 5 раз до 43,4 млрд тенге.
- Процедуру листинга прошли акции трех наименований и пять выпусков облигаций.
- К началу сентября объем открытых позиций на рынке деривативов достиг 6,7 млрд тенге

РЫНОК ЦЕННЫХ БУМАГ

Общий объем торгов ценными бумагами составил в августе 309,3 млрд тенге, что ниже результата предыдущего месяца на 866,3 млрд тенге или 73,7 %. Напомним, что в июле высокий показатель объема торгов был связан с проведением крупной сделки по смене акционеров АО "Каспий нефть", а также с размещением 03 июля большого объема казначейских обязательств Министерства финансов Республики Казахстан методом подписки.

Акции

На конец месяца в торговых списках Биржи находились акции 127 наименований 109 эмитентов, в том числе на нелистинговой площадке – акции шести наименований шести компаний. В августе на KASE прошли листинг акции АО "Шубарколь Премиум", АО "Mega Center Management" и АО "Аль Сакр Финанс".

Значение Индекса KASE по итогам месяца выросло на 9,7 %, и достигло 1 975,64, обновив девятилетний максимум. Рост был зафиксирован по шести акциям Индекса. Лидером роста выступили акции KAZ Minerals PLC, цена которых увеличилась на 21,7 % до 3 681,50 тенге. Акции KAZ Minerals PLC продолжают лидировать в росте при поддержке котировок меди.

Незначительное снижение цен за месяц зафиксировано по акциям АО "KEGOC" (на 1,4 % до 1 378,93 тенге) и АО "Банк ЦентрКредит" (на 0,9 % до 160,80 тенге). Данное снижение находится в пределах средней волатильности по этим ценным бумагам и не является показателем выраженной нисходящей динамики. В частности, новостной фон по АО "KEGOC" в августе был в целом благоприятным. Компания сообщила о подтверждении агентством Moody's Investors Service долгосрочного рейтинга эмитента на уровне Baa3 со стабильным прогнозом и о частичном погашении двух полугодовых выплат за 2018 год по займу Европейского Банка Реконструкции и Развития.

Изменение цен акций корзины Индекса KASE в августе

Эмитент	Торговый код	Цена, тенге за акцию			Изменение цены, тенге	
		на 01.01.17	на 01.08.17	на 01.09.17	в августе	в 2017 году
KAZ Minerals PLC	GB_KZMS	1 511,00	3 026,00	3 681,50	+21,7	+143,5
АО "Казахтелеком"	KZTK	14 522,97	16 351,10	19 600,00	+19,9	+35,9
АО "Народный сберегательный банк"	HSBK	50,34	77,4	87,5	+13,0	+73,8
АО "Кселл"	KCEL	1 102,01	1 330,00	1 482,00	+11,4	+34,7
АО "Разведка Добыча "КазМунайГаз"	RDGZ	15 270,00	19 400,00	19 850,0	+2,3	+30,0
АО "КазТрансОйл"	KZTO	1 231,00	1 200,00	1 215,0	+1,3	-0,9
АО "Банк ЦентрКредит"	CCBN	168,41	162,3	160,8	-0,9	-4,0
АО "KEGOC"	KEGC	1 192,15	1 398,84	1 378,90	-1,4	+17,6

Капитализация рынка акций KASE выросла в августе на 2,9 % или 466,0 млрд тенге до 16,4 трлн тенге. Рост показателя продемонстрировали компании всех секторов экономики, представленные в официальном списке KASE. В наибольшей степени вырос сектор "Материалы" (+258,9 млрд тенге или 15,3 %) за счет увеличения стоимости акций KAZ Minerals PLC, а также сектор "Предоставление телекоммуникационных услуг" (+68,1 млрд тенге или 15,2 %) за счет роста стоимости акций АО "Казахтелеком" на 19,9 %.

Объем торгов акциями снизился в августе относительно предыдущего месяца на 87,9 % или 106,6 млрд тенге до 14,7 млрд тенге. Среднедневной объем торгов снизился на 89,0 %, до 668,0 млн тенге. Все сделки с акциями в августе заключены на вторичном рынке.

Из всех основных категорий инвесторов наиболее активными были физические лица, на счета которых пришлось 52 % оборота акций. Доля брокеров-дилеров составила 33,7 %, на счета банков второго уровня (БВУ) пришлось 0,1 %, на счета других институциональных инвесторов – 2,1 %, доля юридических лиц, не являющихся институциональными инвесторами, достигла 12,3 %. Доля нерезидентов –1,4 %. Доля физических лиц в брутто-обороте акций в денежном выражении снизилась до 51,8 % с 53,7 % в июле 2017 года. Количество счетов физических лиц, задействованных в сделках с акциями на KASE, снизилось в августе на 21,6 % по отношению к предыдущему месяцу.

Корпоративные облигации

На конец августа в торговых списках KASE находились облигации 262 наименований, выпущенные 65 эмитентами. В течение отчетного периода листинг на KASE прошли пять выпусков долговых ценных бумаг: три выпуска АО "Банк Развития Казахстана", два выпуска АО "Самрук-Энерго". При этом из официального списка в связи с погашением были исключены два выпуска облигаций: исламские облигации сукук "аль-Мурабаха" АО "Банк Развития Казахстана" и облигации Дочернего Банка АО "Сбербанк России".

На 01 сентября 2017 года объем корпоративного долга, обращающегося на KASE, достиг 8,8 трлн тенге, увеличившись с начала августа на 3 % или на 240,2 млрд тенге. Рост показателя был обусловлен размещением шести выпусков облигаций, а также ростом курса доллара, который повлиял на увеличение показателя капитализации облигаций, номинированных в долларах США.

Индекс доходности корпоративных облигаций KASE_BY вырос за месяц на 67 базисных пунктов до 9,94 % годовых.

Суммарный объем торгов корпоративными облигациями сложился в отчетном месяце на уровне 217,3 млрд, увеличившись в 8 раз или на 189,8 млрд тенге. Рост объема торгов облигациями был связан с новыми размещениями и активизацией вторичного рынка. Среднедневной объем торгов составил 9 877,2 млн тенге, увеличившись в 7 раз относительно июля.

Объем первичного рынка корпоративных облигаций в августе достиг 80,8 млрд тенге против одного миллиарда тенге в июле. В рамках подписки, которая проводилась 04 августа, АО "Аграрная кредитная корпорация" привлекло 5,1 млрд тенге, разместив 10-летние облигации под 14 % годовых. В рамках специализированных торгов на первичном рынке корпоративных облигаций были размещены четыре выпуска:

- АО "Банк Развития Казахстана" привлекло 17,7 млрд тенге, разместив 13- и 15-летние облигации с доходностью к погашению 11,25 % годовых, и 8,8 млрд тенге, разместив 11-летние облигации под 11 % годовых;
- АО "KEGOC" привлекло 36,3 млрд тенге, разместив 15-летние облигации под 11,50 % годовых.

Кроме того, в секторе купли-продажи методом непрерывного встречного аукциона размещены облигации АО "Самрук-Энерго" на сумму 12,9 млрд тенге под 13,00 % годовых сроком на пять лет.

Объем торгов на вторичном рынке корпоративных облигаций вырос в пять раз или на 110,0 млрд тенге до 136,5 млрд тенге. Здесь, кроме сектора купли-продажи, АО "ФНБ "Самрук-Қазына" продало свои 10-летние облигаций методом специализированных торгов на сумму 25,0 млрд тенге под 10,50 % годовых.

В разрезе основных категорий инвесторов на рынке корпоративных облигаций доля брокеров-дилеров составила 4,8 %, БВУ – 5,5 %, других институциональных инвесторов – 51,1 %, других юридических лиц – 37,6 %, доля физических лиц составила менее 1 %. На долю нерезидентов пришлось 2,6 %.

Государственные ценные бумаги (ГЦБ)

Объем торгов ГЦБ на KASE по итогам августа показал снижение на 92,5 % до 76,9 млрд тенге с 1 026,7 млрд тенге месяцем ранее по причинам, указанным выше.

На первичном рынке Министерство финансов привлекло 25,5 млрд тенге, разместив в августе четыре выпуска среднесрочных и один выпуск долгосрочных ценных бумаг. Оставшиеся 8,1 млрд тенге привлек акимат Астаны, доразместив свои двухлетние облигации под 9,2 % годовых.

В структуре инвесторов при размещении ГЦБ на БВУ пришлось 70,8 %, на других институциональных инвесторов – 26,3 %, 2,8 % выкупили другие юридические лица.

Вторичный рынок ГЦБ показал рост. Объем торгов здесь увеличился в 5 раз, достигнув отметки 43,4 млрд тенге, из которых 12,3 млрд тенге пришлось на продажу Национальным банком трех выпусков государственных сберегательных казначейских обязательств Министерства финансов Республики Казахстан в рамках 15-ти биржевых торгов с целью построения безрисковой кривой доходности для облигаций со сроком до погашения более 12 лет.

В структуре инвесторов на вторичном рынке на долю БВУ приходится 53,3 %, на долю других институциональных инвесторов – 34,9 %, брокеры-дилеры контролировали 9,5 %, другие юридические лица – 2,2 %, менее 1 % пришлось на долю физических лиц.

Ценные бумаги инвестиционных фондов

В данном секторе торгуются ценные бумаги шести наименований. Суммарный объем торгов в августе составил 348,7 млн тенге и вырос относительно июля в 24 раза или на 334,4 млн тенге.

В августе наибольшую активность в секторе проявили физические лица, доля которых достигла 84,9 %, доля юридических лиц – 15 %. Доля нерезидентов составила 12,3 %.

Счета физических лиц на рынке ценных бумаг

На конец августа в системе учета Центрального депозитария ценных бумаг числилось 109 268 лицевых счетов, открытых на физических лиц, что на 554 счета больше, чем на конец предыдущего месяца, и на 4 408 счетов больше, чем на начало 2017 года.

РЫНОК ИНОСТРАННЫХ ВАЛЮТ

Объем торгов иностранными валютами на спот-рынке августа сложился на уровне эквивалента 1 328,8 млрд тенге, что выше результата предыдущего месяца на 32,2 % или 323,8 млрд тенге.

В нижеследующей таблице приводятся основные характеристики торгуемых на KASE в отчетном месяце 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	Число банков	Мин. и макс. курсы, тенге за ед. валюты	Курс на конец месяца (изм.%)
USD/KZT	3 865,7 (+25,9 %)	97,06 % (-2,3 п.п.)	7 791 (+1 502)	32 (-1)	328,00–338,08	336,18 (+2,8 %)
RUB/KZT	6 784,9 (+622,7 %)	2,82 % (+2,3 п.п.)	159 (-12)	17 (+5)	5,5058–5,7900	5,7743 (+5,15%)
EUR/KZT	2,7 (+74,1 %)	0,08 % (+2 б.п.)	15 (+7)	5 (+1)	390,70–404,40	401,28 (+4,2 %)
CNY/KZT	11,1 (+289,5 %)	0,04 % (+3 б.п.)	85 (+63)	7 (+1)	48,9200–51,1400	50,9687 (+4,9 %)

РЫНОК ДЕНЕГ (РЕПО И ВАЛЮТНЫЙ СВОП)

В течение августа ставки денежного рынка продолжили снижаться, приблизившись к нижней границе коридора базовой ставки, установленной Национальным Банком 21 августа на уровне 10,25 (+/-1%). Значения MM_Index и индикатора TONIA снизились на 25 базисных пунктов до 9,26% годовых. TWINA снизилась на 35 б.п до 9,00 % годовых. Судя по продолжающемуся снижению ставок, распределение ликвидности на межбанковском рынке не изменилось.

Доходность однодневного долларowego свопа упала на 2 б.п. до 9,48 %, доходность двухдневного свопа напротив выросла на 61 б.п. до 10,17% годовых.

Индикатор KazPrime-3М (KZT), который представляет собой показатель стоимости денег при размещении их на депозитах межбанковского рынка среди банков, участников Соглашения о формировании данного индикатора, снизился на 25 б.п. до 11,25 % годовых. На сегодняшний день участниками Соглашения являются пять банков.

Совокупный объем торгов на рынке денег вырос на 9,8 % и достиг 8,6 трлн тенге. Структура оборота не изменилась: на долю рынка операций приходится около 60 %.

Операции репо

Объем торгов сложился на уровне 6,5 трлн тенге, что на 8,5% выше показателя предыдущего месяца. Среднедневной объем операций равен 294,7 млрд тенге (-1,4 %).

Традиционно более 90 % от общего объема торгов по сделкам открытия репо приходится на сделки авторепо с ГЦБ. Наиболее популярным инструментом остается репо сроком на один день, доля сделок с ним в общем объеме торгов на рынке авторепо с ГЦБ составляет 97 %.

Всего в сделках на рынке репо принимал участие 21 член Биржи. Основной объем около 90 % от общего оборота торгов в данном сегменте приходится на БВУ. Доля участия нерезидентов в данном секторе незначительна – 0,02 %.

Операции валютного свопа

Объем торгов на рынке валютных свопов вырос на 14 % до 2,1 трлн тенге. Предметом операций валютного свопа являлся только доллар США. Более 80 % от общего объема торгов составляют сделки с инструментом USDKZT_0_002. Среднедневной объем операций – 95,3 млрд тенге (+3,7 %).

Фьючерсы

В настоящий момент в данном секторе биржевого рынка к торговле доступны фьючерсы, базовыми активами которых являются доллар США, Индекс KASE, отдельные наименования акций. Всего 17 инструментов.

В августе объем торгов составил 1,7 млрд тенге, что ниже показателей июля на 65 %. Весь объем торгов пришелся на шестимесячный фьючерс на курс доллара США к тенге, исполнение которого приходится на декабрь 2017 года. Число открытых на KASE позиций к началу сентября составило 20 000 контрактов на сумму 6,7 млрд тенге.

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 "Устойчивые фондовый биржи". KASE занимает второе место среди бирж СНГ по объему торгов ценными бумагами, а также входит в топ-5 по капитализации рынка акций бирж FEAS.

Дополнительная информация: +7 (727) 237 5342, pr@kase.kz