

ЕЖЕНЕДЕЛЬНИК KASE

28 сентября – 02 октября,
2020

НОВОСТИ KASE

- ▲ KASE [сформировала](#) списки ценных бумаг первого, второго и третьего классов ликвидности на октябрь 2020 года.
- ▲ АО "Исламский банк "Заман-Банк" [принято](#) в члены KASE по категории "валютная".
- ▲ АО "Tengri Bank" [исключено](#) из членов KASE по категориям "валютная" и "фондовая".
- ▲ [Введены](#) в действие поправки в Положение о клиринговых участниках и Правила осуществления клиринговой деятельности по сделкам с финансовыми инструментами.
- ▲ На KASE открыты торги облигациями [KZ2C00006955](#) (KFUSb3) АО "Казахстанский фонд устойчивости"
- ▲ Облигации [KZ2C00006955](#) (KFUSb3) АО "Казахстанский фонд устойчивости" включены в [корзину](#) ГЦБ с ЦК, корзину НБРК с ЦК, [корзину](#) ГЦБ без ЦК, в [Список Т+](#) и Список обеспечения Т+.
- ▲ Простые акции [KZ1C00007665](#) (ТPIB) АО "Tengri Partners Investment Banking (Kazakhstan)" [включены](#) в сектор "акции" альтернативной площадки KASE.
- ▲ Акции [US78463V1070](#) (US_GLD_) SPDR Gold Shares, выпущенные инвестиционным фондом SPDR Gold Trust, [включены](#) в сектор "Ценные бумаги инвестиционных фондов" официального списка KASE.
- ▲ Облигации [KZ2C00006898](#) (BRKZb20) АО "Банк Развития Казахстана" [включены](#) в официальный список KASE по категории "облигации" основной площадки.
- ▲ АО "Halyk Finance" [присвоен](#) статус маркет-мейкера на KASE по облигациям [KZ2D00006939](#) (EABRb12) Евразийского банка развития.
- ▲ Простые акции [KZ1C00013143](#) (KZMK) АО "Қазақстан Мақтасы" и [KZ1C00007426](#) (PRKR) АО "НК "Продовольственная контрактная корпорация" [допущены](#) к обращению на KASE в секторе "Нелистинговые ценные бумаги".

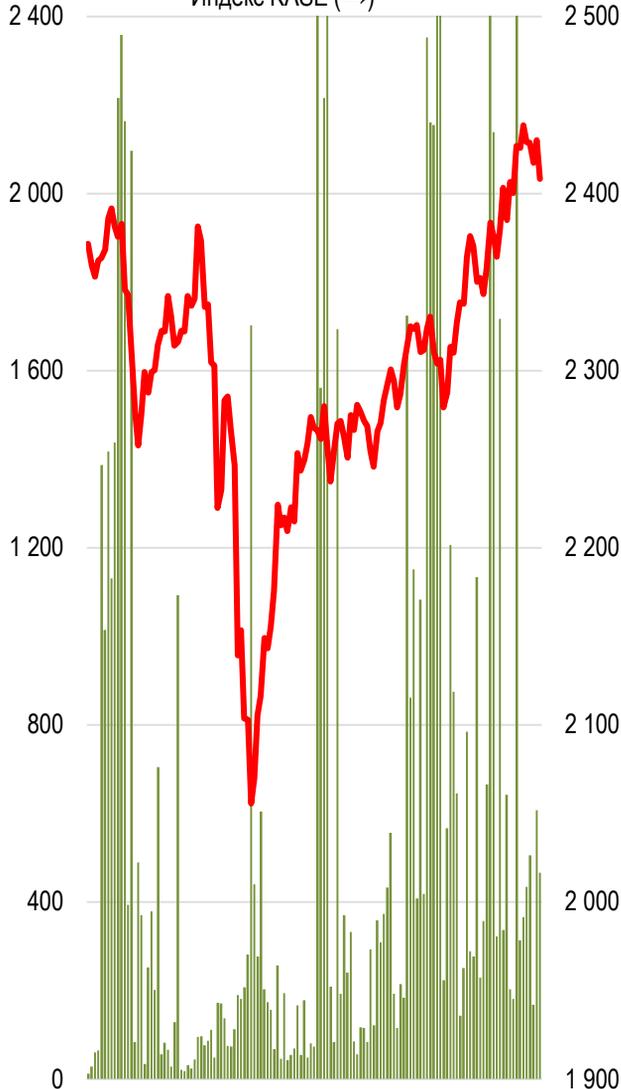
НОВОСТИ ЭМИТЕНТОВ И АНОНСЫ

- ▲ Министерство финансов Казахстана привлекло на KASE 221,9 млрд тенге, разместив MEYKAM-156 шестого выпуска ([KZKD00000964](#)) с доходностью к погашению 10,50 % годовых, MEYKAM-216 первого выпуска ([KZKD00000972](#)) с доходностью к погашению 10,52 % годовых, MEYKAM-216 второго выпуска ([KZKD00001079](#)) с доходностью к погашению 10,52 % годовых, MEYKAM-168 третьего выпуска ([KZKD00000949](#)) с доходностью к погашению 10,50 % годовых, MEYKAM-300 второго выпуска ([KZKD00000774](#)) с доходностью к погашению 10,52 % годовых, MEYKAM-300 третьего выпуска ([KZKD00000857](#)) с доходностью к погашению 10,52 % годовых.
- ▲ АО "Казахстанский фонд устойчивости" привлекло на KASE 15,3 млрд тенге, разместив облигации [KZ2C00006476](#) (BASPb7) с доходностью к погашению 11,0600 % годовых и [KZ2C00006948](#) (KFUSb2) со средневзвешенной доходностью к погашению 10,8969 % годовых.
- ▲ АО "КазТрансОйл" [сообщило](#) о вводе в эксплуатацию после реконструкции участков нефтепровода "Узень-Атырау-Самара".

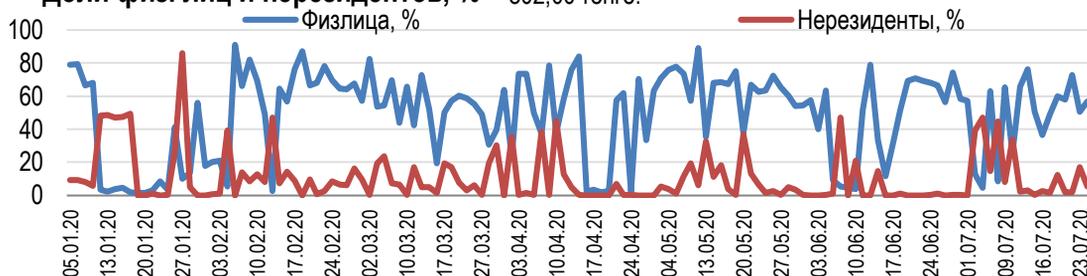
Индекс KASE по итогам недели снизился на 0,8% до 2 412,14 пунктов. Наибольшее количество сделок среди индексных акций было совершено с простыми акциями Народного банка – 620 сделок. Самый большой объем торгов пришёлся на бумаги Kcell – 652,2 млн тенге (83,1% от суммарного объема за неделю).

Акции Индекса KASE

Объем торгов, млн тенге (←)
Индекс KASE (→)



Доли физ. лиц и нерезидентов, %



02.10.2020

Индекс KASE	#Н/Д	Тренды (%)	
Первый класс ликвидности	Цена	Δ 7д	Δ 1м
Казахтелеком, прив. акции	12 395,0	2,1	0,8
Kcell	2 586,0	0,8	2,4
KEGOC	1 709,6	0,0	-0,0
Банк ЦентрКредит	220,0	0,0	-3,6
Газпром	10 000,0	0,0	0,0
Сбербанк	10 000,0	0,0	0,0
Freedom Holding Corp.	10 000,0	0,0	0,0
Bank of America Corporation	10 000,0	0,0	0,0
Аэрофлот	10 000,0	0,0	0,0
Банк ВТБ	10 000,0	0,0	0,0
НАК Казатомпром	6 179,7	-0,2	-1,1
Казахтелеком	24 940,0	-0,2	-4,8
КазТрансОйл	802,0	-0,5	-0,7
Народный банк	115,9	-1,8	-3,6
KAZ Minerals	2 839,0	-2,1	-9,3

Справка: зеленым цветом выделены индексные акции
Цена ГДР «НАК «Казатомпром» выражена в долларах США

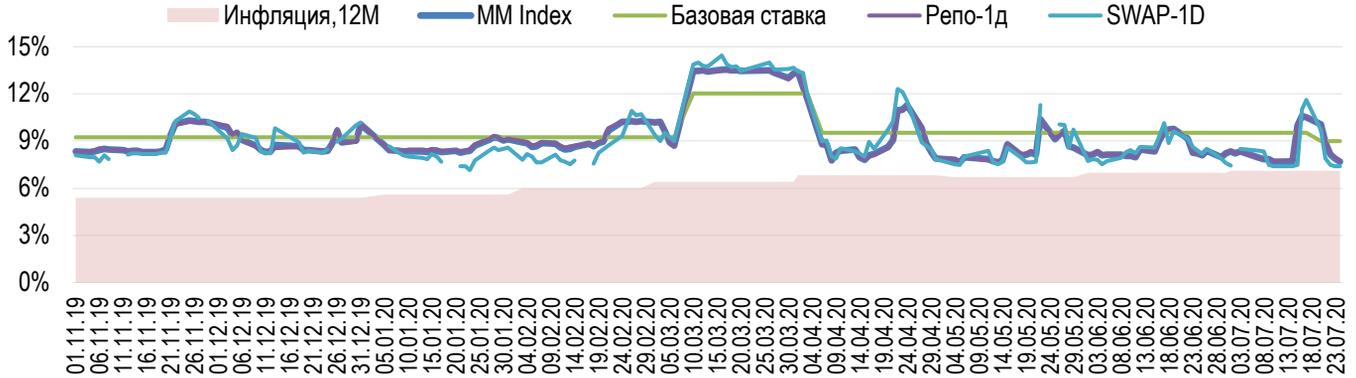
Главным аутсайдером торгов стала простая акция KAZ Minerals, чья цена опустилась на 3,4% до 2 801,00 тенге. Неопределенность на мировых рынках касательно темпов восстановления экономики негативно сказывается на котировках меди, которые за неделю теряют около 4%. Акция меднодобывающей компании на Лондонской фондовой бирже (LSE) на момент закрытия торгов на KASE опускается на 3,7% с прошлой пятницы и торгуется на уровне 508,40 британских пенсов, что эквивалентно 2 804,59 тенге по официальному курсу Нацбанка на 02 октября. Также на этой неделе стало известно о том, что IT-компания IBM помогла KAZ Minerals развернуть для центра обработки данных гибкий и масштабируемый резервный сайт, что позволяет продолжить операционную деятельность даже в случае чрезвычайного происшествия.

Лидером роста стала акция Kcell, чья цена выросла на незначительные 0,8% до 2 586,00 тенге. Тем временем, ГДР компании на LSE на момент закрытия торгов на KASE торговалась на уровне \$6,25, что эквивалентно 2 683,56 тенге за акцию по официальному курсу Нацбанка на 02 октября.

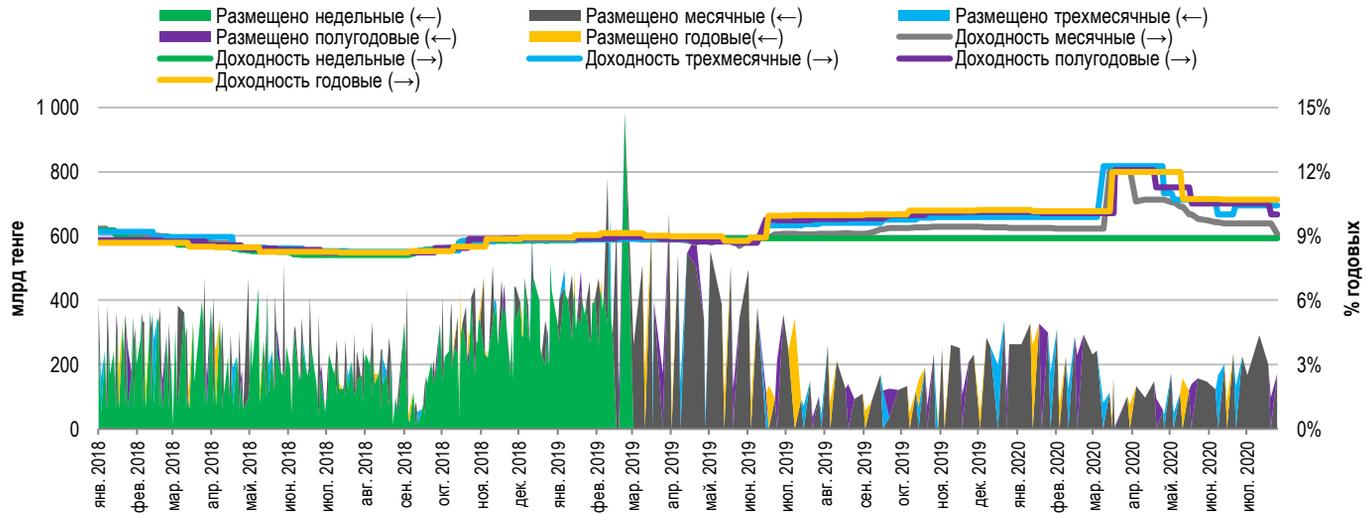
В понедельник АО «КазТрансОйл», на акции которого приходится 8,5% веса в Индексе KASE, сообщило о вводе в эксплуатацию после реконструкции участков нефтепровода «Узень-Атырау-Самара». В рамках строительства линейной части магистрального трубопровода впервые в Казахстане успешно использован цифровой метод радиографического контроля сварных стыков, применяемый ранее только в США и России. Цена за акцию компании снизилась на 0,5% до 802,00 тенге.

Доходность операций репо с государственными ценными бумагами сроком на один день за неделю увеличилась на 31 б.п. до уровня 9,39% годовых. Ставка заимствования тенге под залог долларов США уменьшилась 35 б.п. до 9,00% годовых. Средний объем заимствования тенговой ликвидности на один день за неделю составил 209,8 млрд тенге (+41,1% к аналогичному показателю прошлой недели).

Инфляция и процентные ставки

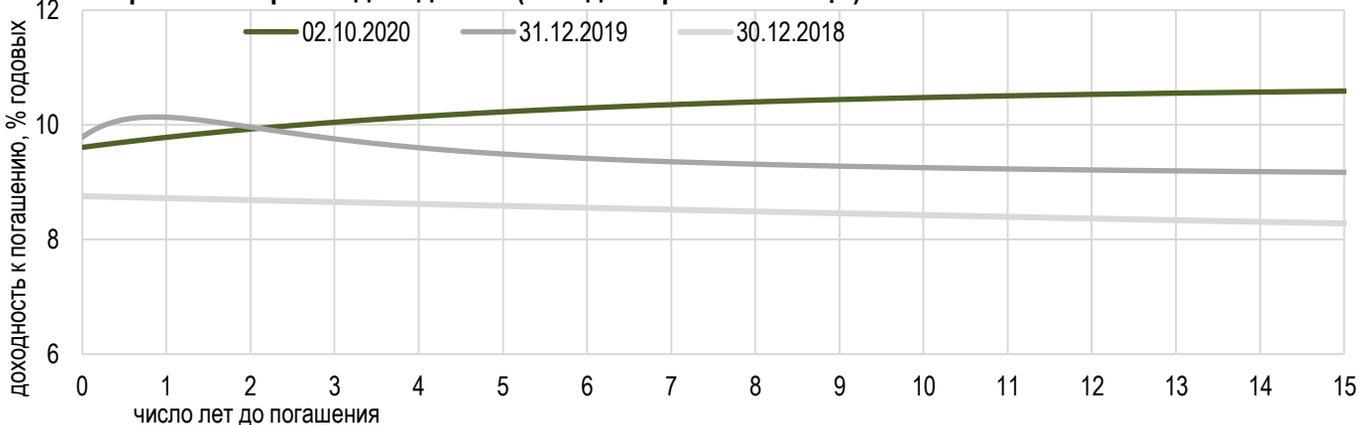


Основные параметры размещения нот НБРК



*Средневзвешенная доходность по всем операциям валютного свопа с долларом США.

Безрисковая кривая доходности (неиндексированные ГЦБ)





По итогам недели курс доллара США к тенге вырос на 4,80 тенге (+1,1%) до 431,12 тенге. Суммарный объем торгов за неделю составил \$637,1 млн (+1,7% к аналогичному показателю прошлой недели). Общее количество сделок по покупке и продаже доллара США составило 2 244 (-96 к показателю прошлой недели). Максимальная цена составила 432,11 тенге за доллар США, минимальная – 427,80 тенге.

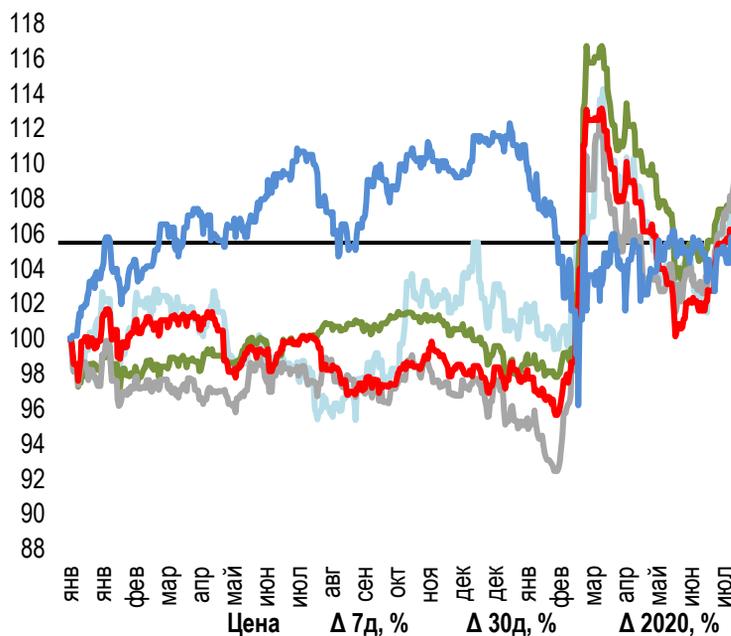
Тенге по итогам недели теряет позиции ко всем иностранным валютам, торгующимся на KASE, на фоне снижения нефтяных цен и ослабления российского рубля. Нефтяные котировки рискуют завершить в минусе вторую неделю подряд. В пятницу к 15:30 времени г. Нур-Султан декабрьский фьючерс нефти Brent на лондонской бирже ICE Futures торговался на уровне \$39,58 за баррель, тем самым снижаясь на 5,6% с цены закрытия прошлой пятницы. Цены на нефть резко дешевеют в пятницу на новостях о положительном результате на COVID-19 у президента США Дональда Трампа. Между тем, несмотря на данные Минэнерго США, опубликованные в среду, которые показали снижение нефтяных запасов в стране третью неделю подряд, рынок всё еще скептически настроен на темпы восстановления мировой экономической активности. Давление на котировки продолжают оказывать опасения по поводу темпов восстановления спроса в связи с ростом количества новых заражений коронавирусом в мире и повторное введение ограничительных карантинных мер в ряде стран Европы.

Тем временем, на Московской бирже курс доллара США к российскому рублю вырос до 78,5338 рублей, что выше предыдущего пятничного показателя на 0,4%. Новость о позитивном тесте Трампа на COVID-19 также негативно сказалась и на рубле, так как это послужило причиной для продажи рискованных и сырьевых активов.

Стоимость российского рубля выросла на 0,0004 тенге (+0,01%) до 5,5410 тенге. Евро подорожал к тенге на 8,43 тенге (+1,7%) до 505,90 тенге. Китайский юань подорожал на 0,9890 тенге (+1,6%) до 63,4690 тенге.

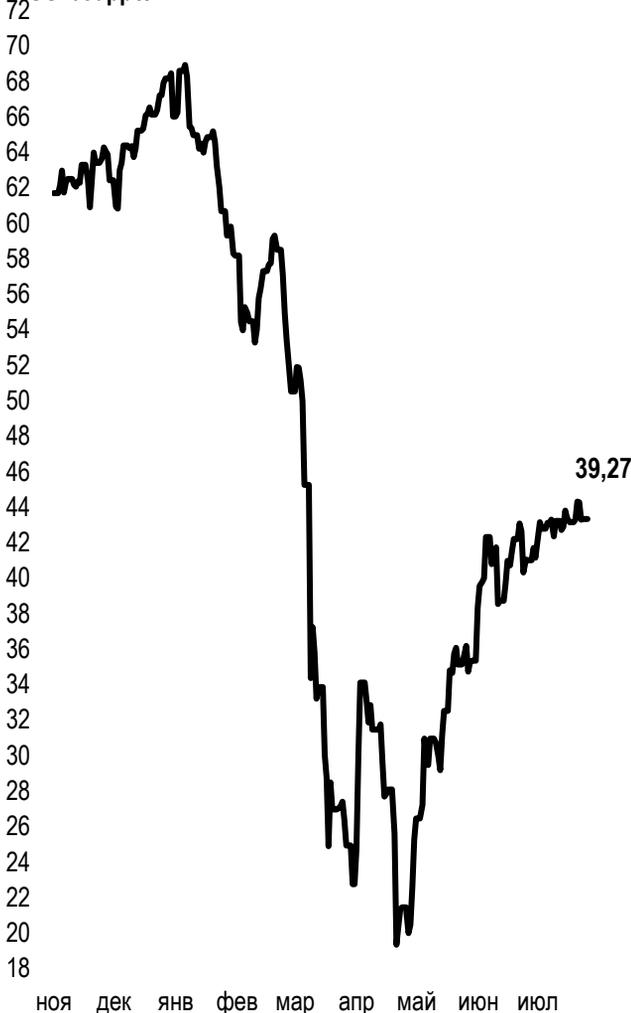
Динамика курсов иностранных валют

Δ %, база (01.01.20)



	Цена	Δ 7д, %	Δ 30д, %	Δ 2020, %
— GBPKZT	551,65	1,4	-2,1	10,3
— USDKZT	429,37	0,75	2,4	12,6
— EURKZT	504,34	1,6	0,42	18,2
— CNYKZT	63,24	1,3	2,9	15,9
— RUBKZT	5,55	0,4	-2,5	-10

Стоимость нефти Brent USD/баррель



Справка: График и таблица построены на основе официальных рыночных курсов НБК. Курсы НБК могут расходиться с биржевыми курсами KASE.



Международные индексы					Сырьевой рынок					02.10.2020		
Наименование	Значение	Тренд %			Фьючерс 7д	Наименование	Цена	Тренд %				
		7д	1м	1г				7д	1м	1г		
S&P 500	3 348,44	-0,1	-6,5	15,0	1,6	Нефть Brent	39,27	-7,4	-11,6	-32,0		
Dow Jones	27 682,81	0,4	-4,9	5,7	1,9	Нефть WTI	37,05	-8,7	-10,7	-29,4		
PTC	1 148,07	-1,6	-7,0	-12,2	-0,2	Природный газ	2,44	16,0	-1,9	4,7		
MMBБ	2 285,53	0,0	0,0	0,0	-0,2	Медь	297,75	-0,4	-0,8	16,6		
Hang Seng	23 459,05	-0,1	-6,6	-10,2	1,2	Железо	960,50	5,1	3,4	21,2		
SS CSI 300	4 587,40	0,1	-5,3	20,3	0,0	Золото	1 899,84	1,0	-2,2	26,0		
Euro Stoxx 50	3 190,93	-1,0	-4,4	-6,6	1,9	Серебро	24,03	2,1	-11,8	35,9		
FTSEuroFirst	3 521,00	-0,9	-3,5	-13,5	1,9	Пшеница	573,25	4,2	4,7	17,3		
FTSE 100	5 902,12	-0,4	-0,7	-16,6	1,0							
KASE	2 416,14	-0,5	-3,3	12,0								

Календарь экономических событий

		Валюта	Прогноз	Предыдущее
05.10	Индекс деловой активности в секторе услуг (сент)	GBP	55,7	59,1
06.10	Краткосрочный прогноз ситуации на рынках энергоносителей от EIA	USD		
07.10	Запасы сырой нефти	USD	1,569M	-1,980M
08.10	Заявление по монетарной политике ЕЦБ	EUR		
08.10	Число первичных заявок на получение пособий по безработице	USD	823K	837K
09.10	ВВП (кв/кв)	JPY		-7,9%
09.10	ВВП (м/м)	GBP		6,6%

Справка: Календарь содержит наиболее значимые по мнению KASE экономические события текущей недели

В – миллиарды
М – миллионы
К – тысячи

Макроэкономическая статистика Казахстана	Значение	На дату	Начало 2019г.
Годовая инфляция	7,0%	01.09.20	5,3 %
Валовые международные резервы НБК, млн USD	31 561	01.06.20	30 927
Денежная база, млрд KZT	8 428,3	01.06.20	5 995,7
Денежная масса, млрд KZT	22 438,2	01.06.20	20 813,4
Кредитные рейтинги Казахстана	Рейтинг	Дата	Предыдущее
S&P Global	BBB- стабильный	27.03.20	BBB- стабильный
Moody's	Вaa3 позитивный	22.08.19	Вaa3 стабильный
FitchRatings	BBB стабильный	21.08.20	BBB стабильный

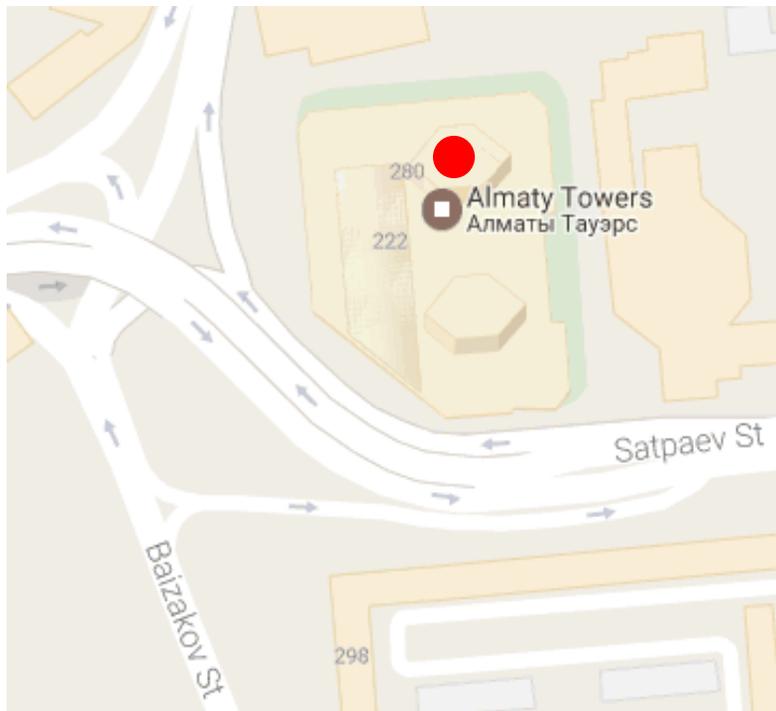
КОНТАКТНАЯ ИНФОРМАЦИЯ



АО "Казахстанская фондовая биржа"

Адрес: Республика Казахстан, 050040,
г. Алматы, ул. Байзакова, 280,
БЦ "Almaty Towers"

Тел.: 8 (727) 237 53 23; 8 (727) 237 53 28



Корпоративный вебсайт



Часто задаваемые вопросы



Связаться с нами

Информация и мнения, содержащиеся в настоящем отчете, были подготовлены специалистами АО "Казахстанская фондовая биржа" (далее - KASE). KASE не дает гарантий относительно полноты и точности приведенной в этом отчете информации, а также ее достоверности. Ни KASE, ни кто-либо из работников не несет ответственности за любые прямые или косвенные убытки (ущерб), наступившие в результате использования данного отчета или сведений/анализа, представленных в нем. KASE не берет на себя ответственности регулярно обновлять данный отчет, а также сообщать обо всех изменениях, произошедших с момента подготовки данного отчета.

KASE обращает внимание инвесторов на следующие факторы:

1. доход от инвестиций в финансовые инструменты зависит от множества рыночных и нерыночных факторов. В частности на фактический доход инвестора могут влиять колебания процентных ставок, изменение норм налогообложения, движение валютных курсов, изменения котировок ценных бумаг, рыночных индексов, изменения производственных и финансовых показателей компаний, а также другие факторы;
2. прошлые результаты не всегда указывают на то, какими будут будущие показатели. При этом оценки будущих результатов основаны на предположениях, которые могут не осуществиться. Стоимость любых инвестиций или дохода может понижаться и повышаться, в результате чего инвесторы могут не получить обратно всей инвестированной суммы. В случае инвестиций, для которых не существует общепризнанного рынка, инвесторы могут испытывать различные трудности, включая трудности с их продажей или получением надежной информации об их стоимости или связанных с ними рисках;
3. отчет подготовлен без учета индивидуальных финансовых особенностей и целей тех лиц, которые его получают.

KASE рекомендует инвесторам независимо оценивать целесообразность тех или иных инвестиций и стратегий и призывает инвесторов пользоваться услугами финансовых консультантов.

Все права на отчет принадлежат KASE. Частичное или полное воспроизведение и/или распространение данного аналитического материала не может быть осуществлено без письменного разрешения KASE.