

ЕЖЕНЕДЕЛЬНИК KASE

21–25 июня, 2021

НОВОСТИ KASE

- ▲ В официальный список KASE включены международные облигации [XS2351373134](#) (ASDBe8) Азиатского банка развития.
- ▲ Правление KASE [приняло](#) решение о включении международных облигаций KZX000000690 (AOILe1) ТОО "5A OIL (5A OIЛ)" в официальный список KASE по категории "облигации" альтернативной площадки.
- ▲ На KASE открыты торги простыми акциями [KZ1C00008077](#) (FHSE) АО "First Heartland Securities", облигациями KZ2C00007516 (KFUSb18) и KZ2C00007573 (KFUSb24) АО "Казахстанский фонд устойчивости" и акциями [US46137V1420](#) (US_PHO_) Invesco Water Resources ETF.
- ▲ На KASE приостановлены торги облигациями [KZ2P00003874](#) (FATNb1) ТОО "Компания Фазтон" и [KZ2C00006641](#) (BTDVb3) АО "Казахстанская Жилищная Компания".
- ▲ Облигации [KZ2C00007458](#) (KFUSb12) АО "Казахстанский фонд устойчивости" включены в корзину ГЦБ без ЦК.
- ▲ Облигации KZ2P00007420 (MFNKb1) ТОО "МФО "НИЕТ Кредит" [переведены](#) в режим торговли в "чистых" ценах.
- ▲ АО "Фридом Финанс" присвоен статус маркет-мейкера на KASE по ГДР [US48581R1068](#) (KSPId) АО Kaspi.kz и акциям [US46137V1420](#) (US_PHO_) Invesco Water Resources ETF.

НОВОСТИ ЭМИТЕНТОВ И АНОНСЫ

- ▲ Евразийский банк развития [привлек](#) на KASE 9,1 млрд тенге, разместив облигации KZ2D00005824 (EABRb13) под 9,55 % годовых.
- ▲ Азиатский банк развития [привлек](#) на KASE через подписку 13,3 млрд тенге, разместив международные облигации XS2351373134 (ASDBe8) с доходностью к погашению 10,45 % годовых.
- ▲ Министерство финансов Казахстана [привлекло](#) на KASE 29,1 млрд тенге, разместив MEYKAM-180 первого выпуска (KZKD00000105, MUM180_0001) со средневзвешенной доходностью к погашению 9,60 % годовых.
- ▲ АО "Казахстанский фонд устойчивости" [привлекло](#) на KASE 10,0 млрд тенге, разместив облигации KZ2C00007466 (KFUSb13) со средневзвешенной доходностью к погашению 9,79 % годовых.
- ▲ Акимат Северо-Казахстанской области [привлек](#) на KASE 1,1 млрд тенге, разместив облигации KZMJ00000974 (SKK024_097).
- ▲ Акимат Костанайской области [привлек](#) на KASE 1,9 млрд тенге, разместив облигации KZMJ00000982 (KSK024_098).
- ▲ S&P Global Ratings [подтвердило](#) рейтинги АО "First Heartland Jusan Bank" и отозвало их по инициативе банка.
- ▲ Компания NOSTRUM OIL & GAS PLC [сообщила](#) о продлении соглашения о воздержании от осуществления права.
- ▲ АО "КазТрансОйл" [выплатило](#) дивиденды по простым акциям KZ1C00000744 (KZTO) за 2020 год.
- ▲ АО "Банк "Bank RBK" [выплатило](#) дивиденды по привилегированным акциям KZ1P00000764 (INBNp) за 2020 год.
- ▲ Агентство Республики Казахстан по регулированию и развитию финансового рынка [лишило](#) АО "Capital Bank Kazakhstan" лицензии на проведение банковских и иных операций и деятельности на рынке ценных бумаг.



25.06.2021		Тренды (%)	
Индекс KASE	3 329,27	-0,6	-0,9
Первый класс ликвидности	Цена	Δ 7д	Δ 1м
Казахтелеком, прив. акции	19 300,0	8,4	14,2
Freedom Holding Corp.	26 814,4	3,9	34,0
Банк ВТБ	0,3	3,6	7,4
Казахтелеком	30 390,0	2,5	4,8
Bank of America Corporation	17 600,0	2,5	-4,2
Газпром	1 654,7	1,1	8,7
Народный банк	168,7	1,0	4,1
КазТрансОйл	1 116,0	0,5	-8,4
KEGOC	1 736,0	-0,3	-2,8
Банк ЦентрКредит	248,1	-0,8	0,9
Аэрофлот	426,0	-1,2	0,4
Сбербанк	1 852,2	-1,2	4,6
Kcell	2 445,0	-2,6	-4,6
НАК Казатомпром	13 013,0	-4,2	0,5

Значение Индекса KASE по итогам недели снизилось на 0,59% – до 3 329,27 пункта. Наибольшее количество сделок среди акций представительского списка было совершено с акциями Народного банка – 2 214. Наибольший объем сделок пришёлся на акции «Банка ЦентрКредит» (БЦК) – 406,8 млн тенге.

БЦК предоставил консолидированную финансовую отчётность за январь-март 2021 года, согласно которой чистая прибыль банка выросла в 2,4 раза по сравнению с аналогичным периодом 2020 года и составила 2,6 млрд тенге.

В банке отметили, что на рост прибыли повлияло увеличение процентных доходов на 15%, в том числе за счёт роста доходов по портфелю ценных бумаг и межбанковским кредитам. Кроме того, расходы на создание резервов сократились на 35% относительно I квартала 2020 года, что говорит об улучшении качества ссудного портфеля банка, добавили в БЦК. Рентабельность собственного капитала выросла в 2 раза и составила 7,9%.

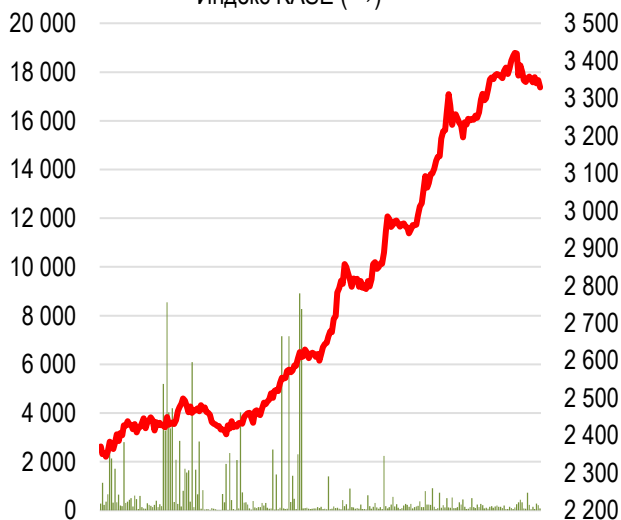
Кредитный портфель банка с начала года уменьшился на 3,2% – до 976,8 млрд тенге, депозитный портфель, напротив, увеличился на 4,6% и составил 1,2 трлн тенге. Обязательства увеличились на 1,9%, до 1,8 трлн тенге, собственный капитал – на 3,2%, до 136 млрд тенге.

Между тем, «КазТрансОйл» сообщил о выплате 18 июня 2021 года дивидендов по своим простым акциям. Размер дивиденда составил 132 тенге на одну акцию на общую сумму 50,8 млрд тенге.

Справка: зеленым цветом выделены индексные акции

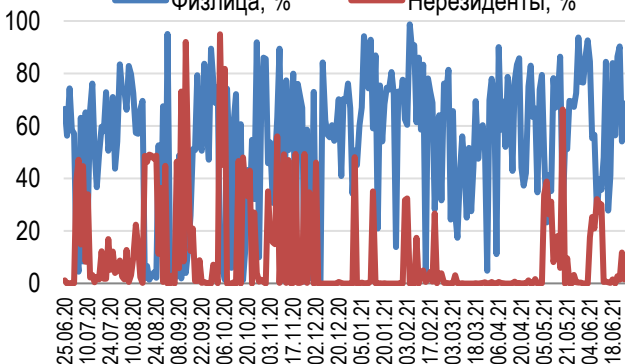
Акции Индекса KASE

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



Доли физ. лиц и нерезидентов, %

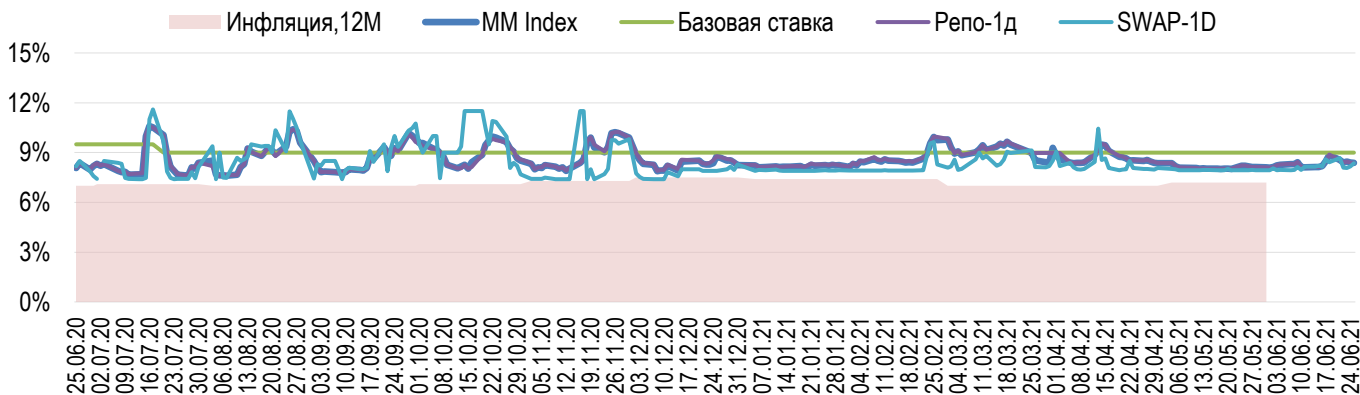
Физлица, % Нерезиденты, %



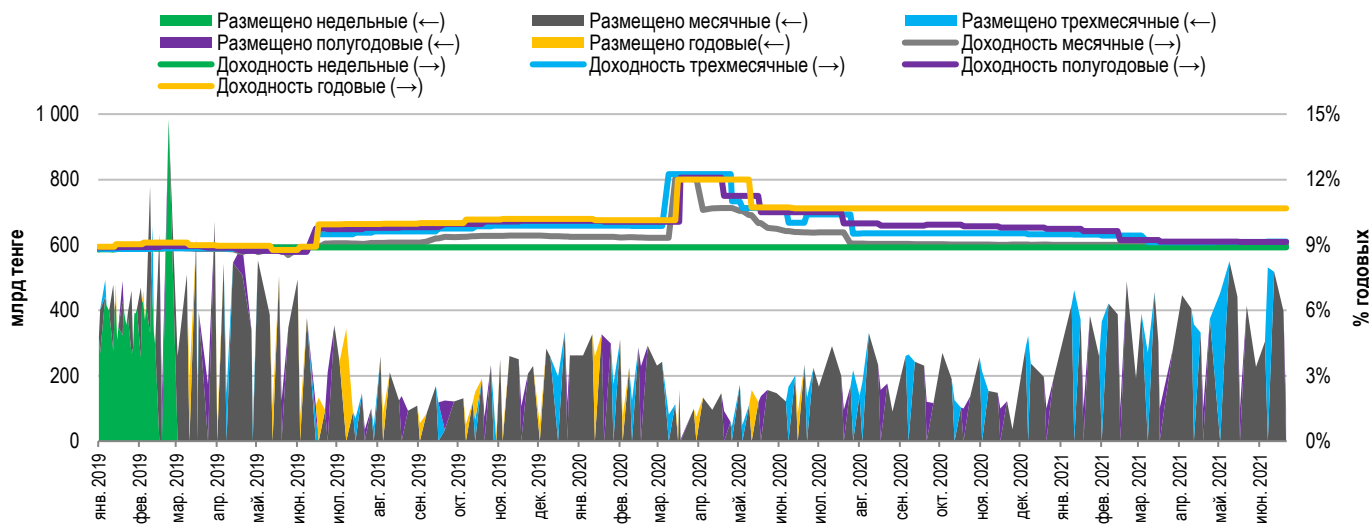


Доходность операций РЕПО с государственными ценными бумагами (ГЦБ) сроком на один день (TONIA) по итогам недели уменьшилась на 49 б.п. – до 8,39% годовых. Ставка заимствования тенге под залог долларов США сроком на один день (SWAP-1D (USD)) за неделю снизилась на 8 б.п. и составила 8,35% годовых. Средний объем торгов однодневными инструментами денежного рынка составил 340,9 млрд тенге, что на 6,2% ниже среднего значения за предыдущую неделю.

Инфляция и процентные ставки

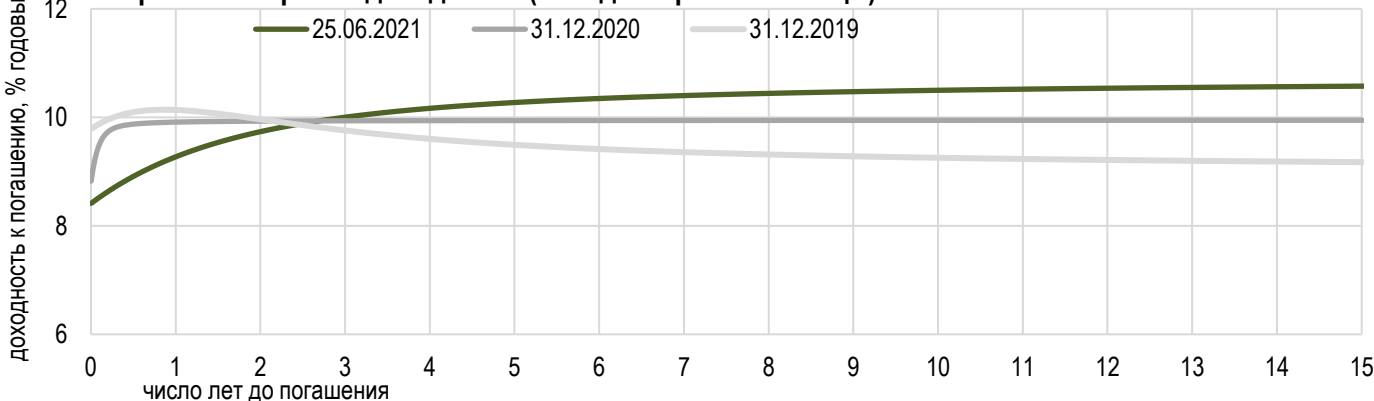


Основные параметры размещения нот НБРК



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

Безрисковая кривая доходности (неиндексированные ГЦБ)





Средневзвешенный курс доллара США к тенге со сроком расчётов «завтра» по итогам недели понизился на 0,96 тенге (0,22%) – до 426,87 тенге. Средний объём торгов составил \$175,4 млн, что на 12,7% выше среднего значения за предыдущую неделю. Всего было заключено 2 458 сделок. Минимальная цена составила 425,40 тенге за доллар США, максимальная – 427,95 тенге, цена последней сделки – 425,70 тенге.

Тенге укрепился на фоне подъёма цен на нефть по итогам пятой недели подряд. Поддержку нефтяным котировкам оказал оптимизм инвесторов в отношении спроса на фоне восстановления мировой экономики.

Согласно докладу министерства энергетики США, запасы нефти в стране сократились по итогам пятой недели подряд – это самый длительный период падения с января. Резервы «чёрного золота» за неделю, завершившуюся 18 июня, уменьшились на 7,6 млн баррелей, до 459,1 млн баррелей, минимума с марта 2020 года.

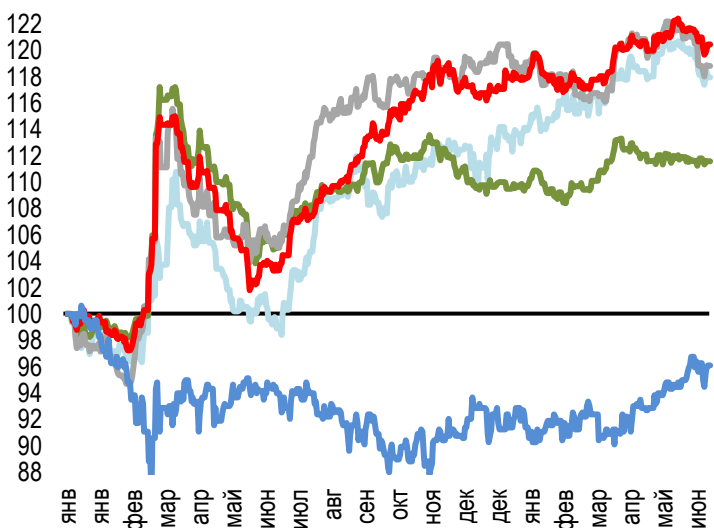
Между тем, ключевой спред между фьючерсными контрактами на нефть WTI в понедельник достигла \$1,12 за баррель, максимального уровня за семь лет, что говорит об обеспокоенности трейдеров ухудшающейся ситуацией с запасами нефти в США. В прошлом, по данным агентства Bloomberg, спред между третьим и четвёртым ближайшими по сроку фьючерсами на WTI превышал \$1 за баррель лишь дважды за 13 лет – в 2008 году, и в период с середины 2013 по середину 2014 гг. В каждый из этих двух периодов цена нефти была выше \$100 за баррель. За неделю цена WTI поднялась на 3,9% – до \$74,05 за баррель.

Тем временем, запасы нефти в Китае, по данным аналитической компании Kayross, находятся на минимальном уровне с начала текущего года.

Стоимость августовских фьючерсов на нефть Brent на лондонской бирже ICE Futures по итогам недели выросла на \$2,67 (3,63%) – до \$76,18 за баррель. Курс доллара США к российскому рублю на Московской бирже за неделю понизился на ¥0,6128 (0,84%) – до ¥72,2047.

Динамика курсов иностранных валют

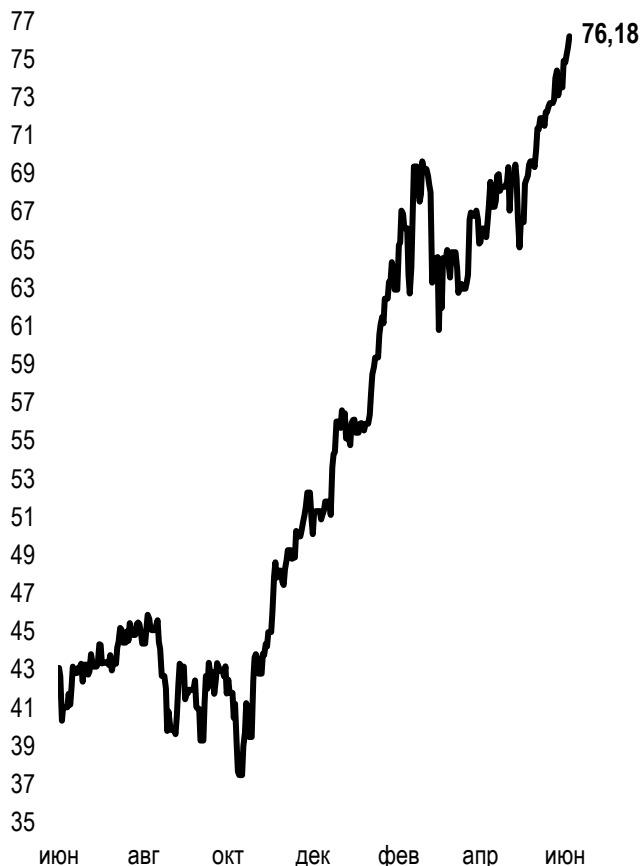
Δ %, база (01.01.20)



	Цена	Δ 7д, %	Δ 30д, %	Δ 2020, %
— GBPKZT	596,15	-0,02	-1,39	4,38
— USDKZT	427,01	0,06	0,12	1,50
— EURKZT	509,94	-0,00	-2,41	-1,20
— CNYKZT	66,02	-0,48	-0,86	2,37
— RUBKZT	5,91	0,34	1,72	4,60

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

25.06.2021

Наименование	Значение	Тренд %			Фьючерс 7д	Наименование	Цена	Тренд %		
		7д	1м	1г				7д	1м	1г
S&P 500	4 280,70	2,7	2,0	38,8	2,8	Нефть Brent	76,18	3,6	10,6	85,6
Dow Jones	34 433,84	3,4	0,3	33,7	3,6	Нефть WTI	74,05	3,4	11,8	91,2
PTC	1 672,08	1,5	5,1	33,0	1,6	Природный газ	3,50	8,7	17,2	135,9
МММБ	2 285,53	0,0	0,0	0,0	1,6	Медь	429,20	3,2	-5,3	61,2
Hang Seng	29 288,22	1,7	0,4	18,2	1,6	Железо	1 319,00	2,2	14,4	63,6
SS CSI 300	5 239,97	2,7	-1,5	26,6	3,0	Золото	1 781,44	1,0	-6,1	1,0
Euro Stoxx 50	4 120,66	0,9	2,2	28,0	1,1	Серебро	26,09	0,5	-6,3	45,8
FTSEuroFirst	4 509,00	0,1	1,3	23,5	1,2	Пшеница	637,00	-3,9	-1,8	30,9
FTSE 100	7 136,07	1,7	1,6	16,1	1,9					
KASE	3 329,27	-0,6	-0,9	40,5						

Календарь экономических событий

Валюта

Прогноз

Предыдущее

01.07	Индекс деловой активности в производственном секторе (PMI) от Caixin (июнь)	CNY	51,8	52,0
01.07	Число первичных заявок на получение пособий по безработице	USD	393K	411K
01.07	Индекс деловой активности в производственном секторе (PMI) от ISM (июнь)	USD	61,0	61,2
01.07	Выступление главы Банка Англии Бейли	GBP		
02.07	Уровень безработицы (июнь)	USD	5,7%	5,8%
02.07	Председатель ЕЦБ Лагард выступит с речью	USD		

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 2020г.

Годовая инфляция	7,2%	01.06.21	5,6%
Валовые международные резервы НБК, млн USD	34 674	01.02.21	35 638
Денежная база, млрд KZT	9 173,8	01.01.21	8 652,5
Денежная масса, млрд KZT	25 392,0	01.01.21	20 875,8

Кредитные рейтинги Казахстана

Рейтинг

Дата

Предыдущее

S&P Global	BBB-/A-3- стабильный	06.03.21	BBB-/стабильный
MOODY'S	Ваа3/позитивный	17.02.21	Ваа3/позитивный
FitchRatings	BBB/стабильный	20.02.21	BBB/стабильный

КОНТАКТНАЯ ИНФОРМАЦИЯ



АО "Казахстанская фондовая биржа"

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

Тел.: +7 (727) 237 53 23
+7 (727) 237 53 28



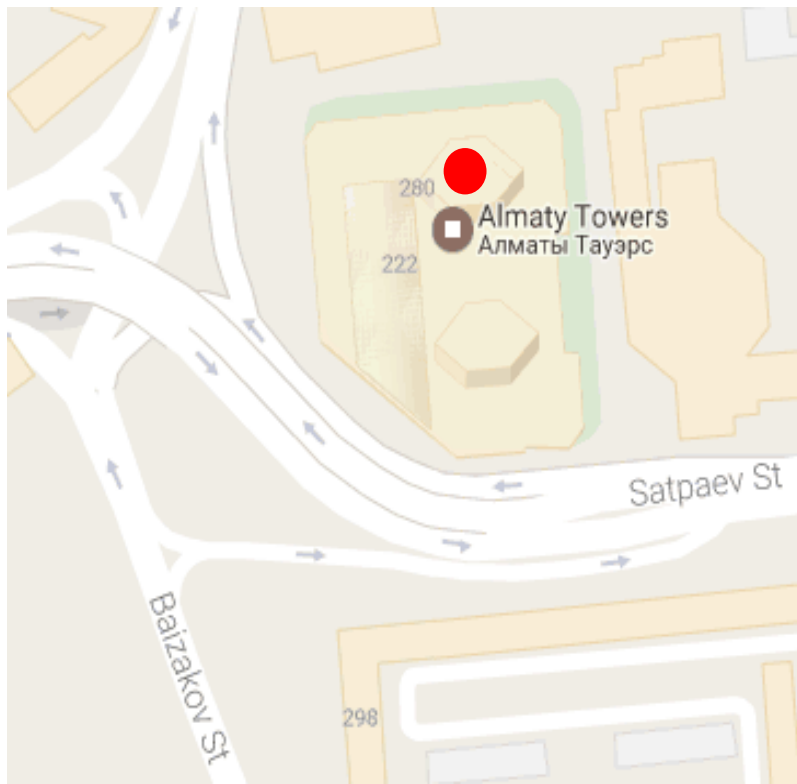
Корпоративный вебсайт



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.