

ЕЖЕНЕДЕЛЬНИК KASE

30 января – 03 февраля,
2023

НОВОСТИ KASE

- ▲ В представительский список для расчета Индекса KASE включены простые акции [KZ1C00001122](#) (KMGZ) АО "Национальная компания "КазМунайГаз".
- ▲ KASE [сформировала](#) списки ценных бумаг первого, второго и третьего классов ликвидности на февраль 2023 года.
- ▲ ТОО "Независимая аудиторская компания "Сопсорг" [переведено](#) со второго на первый уровень перечня аудиторских организаций, признаваемых KASE.
- ▲ Облигации [KZ2D00009354](#) (FNACpp2) Частной компании "Finaccord Limited" включены в официальный список KASE на площадку "Частное размещение".
- ▲ Из официального списка KASE в связи с истечением срока обращения исключены облигации [KZ2P00008295](#) (MFRFb2) ТОО "Микрофинансовая организация "R-Finance".
- ▲ На KASE открыты торги "зелеными" международными облигациями [XS2571803019](#) (ASDBe13) Азиатского банка развития, облигациями [KZ2C00008936](#) (KFUSb47) и [KZ2C00008944](#) (KFUSb48) АО "Казахстанский фонд устойчивости".
- ▲ На KASE приостановлены торги простыми акциями [US4781601046](#) (JNJ_KZ) Johnson & Johnson, [US4581401001](#) (INTC_KZ) Intel Corporation, [US7475251036](#) (QCOM_KZ) QUALCOMM Inc., [US5949181045](#) (MSFT_KZ) Microsoft Corporation, [US30231G1022](#) (XOM_KZ) Exxon Mobil Corporation, [US4592001014](#) (IBM_KZ) IBM corp. и облигациями [KZ000A0T88N8](#) (BTTRb1) АО "Батыс транзит".
- ▲ На KASE возобновлены торги простыми акциями [US7170811035](#) (PFE_KZ) Pfizer Inc.
- ▲ АО "Фридом Финанс" [присвоен](#) статус маркет-мейкера на KASE по облигациям [KZ2C00008936](#) (KFUSb47) и [KZ2C00008944](#) (KFUSb48) АО "Казахстанский фонд устойчивости".

НОВОСТИ ЭМИТЕНТОВ И АНОНСЫ

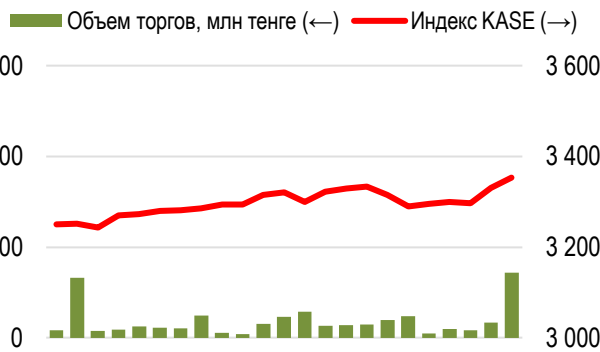
- ▲ Министерство финансов Казахстана разместило на KASE 906,0 млн МЕККАМ-12 выпуска 153 ([KZK100000282](#), MKM012_0153), 88,0 млн МЕУКАМ-96 выпуска 12 ([KZKD00001160](#), MUM096_0012) и 10,0 млн МЕУКАМ-180 выпуска 16 ([KZKD00001194](#), MUM180_0016).
- ▲ АО "Казахстанский фонд устойчивости" [привлекло](#) на KASE 6,5 млрд тенге, разместив облигации [KZ2C00008936](#) (KFUSb47) с доходностью к погашению 18,34 % годовых.
- ▲ АО "СК "Sinoasia B&R (Синоазия БиЭндАр)" [выплатило](#) дивиденды по привилегированным акциям [KZ1P00014559](#) (SABRp) за четвертый квартал 2022 года.
- ▲ Компания NOSTRUM OIL & GAS PLC [предоставила](#) информацию о получении необходимых лицензий.
- ▲ АО "Фонд развития промышленности" сообщило о подтверждении агентством Moody's Investors Service рейтингов общества, прогноз "Позитивный".
- ▲ АО "First Heartland Jusan Invest" [сообщило](#) о выплате дивидендов держателям паев [KZPF00000132](#) (FHJlag) ИПИФ "allGA" за октябрь–декабрь 2022 года.



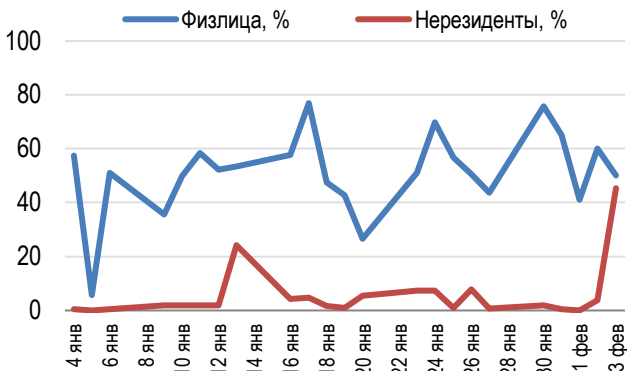
03.02.2023	Тренды (%)		
Индекс KASE	3 353,40	1,9 3,2	
Первый класс ликвидности	Цена	Δ 7д	Δ 1м
Tesla, Inc.	193,00	19,1	34,3
Advanced Micro Devices, Inc.	86,18	17,9	27,1
Intel Corporation	30,00	10,2	13,9
АО "Банк ЦентрКредит"	406,00	5,7	11,0
Ford Motor Company	14,66	5,3	5,5
АО "Кселл"	1 805,00	3,7	4,6
АО "Народный банк Казахстана"	127,36	3,6	0,7
АО Kaspi.kz	34 300,00	2,8	3,3
АО "НАК "Казатомпром"	14 469,00	2,4	12,4
АО "Баян Сулу"	433,97	2,1	45,1
Apple Inc.	145,29	1,9	11,9
Bank of America Corporation	35,88	1,3	9,3
АО "КазТрансОйл"	720,00	0,7	- 1,9
АО "KEGOC"	1 620,97	0,4	0,1
АО "Казхателеком"	29 440,00	0,4	3,8
АО "ForteBank"	4,34	0,2	6,4
AltynGold plc	880,00	0,0	29,1
АО "БАСТ"	10 000,00	-	- 6,5
American Airlines	17,85	- 0,2	11,6
АО "Банк ЦентрКредит"	628,02	- 0,5	- 1,9
Freedom Holding Corp.	63,17	- 2,4	13,4
АО "НК "КазМунайГаз"	9 414,99	- 2,8	- 0,2
NOSTRUM OIL & GAS PLC	22,20	- 3,9	- 2,7

Справка: зеленым цветом выделены индексные акции

Акции Индекса KASE



Доли физ. лиц и нерезидентов, %



С 3 февраля в представительский список акций для расчета Индекса KASE включены простые акции АО "Национальная компания "КазМунайГаз".

Объем торгов акциями в секторе "KASE Global" за январь составил 1 991,7 млн тенге (\$4 304,8 тыс.). За указанный период в секторе "KASE Global" было заключено 4 519 сделок с 93 020 акциями иностранных компаний.

Наибольший объем торгов за указанный период пришелся на следующие ценные бумаги:

- Apple Inc. – 541 сделка на общую сумму 449,4 млн тенге;
- Intel Corporation – 534 сделки на общую сумму 191,9 млн тенге;
- Advanced Micro Devices, Inc. – 272 сделки на общую сумму 177,3 млн тенге.

Среди основных категорий инвесторов на долю брокерско-дилерских организаций пришлось 17,8%, на долю прочих юридических лиц – 29,9% от суммарного объема сделок с акциями, наибольшая доля пришлась на физических лиц – 52,3%.

С 8 февраля дебютные выпуски корпоративных облигаций Республики Узбекистан будут включены в официальный список KASE:

- 1) АО "Национальный банк внешнеэкономической деятельности Республики Узбекистан";
- 2) АО "UzAuto Motors".

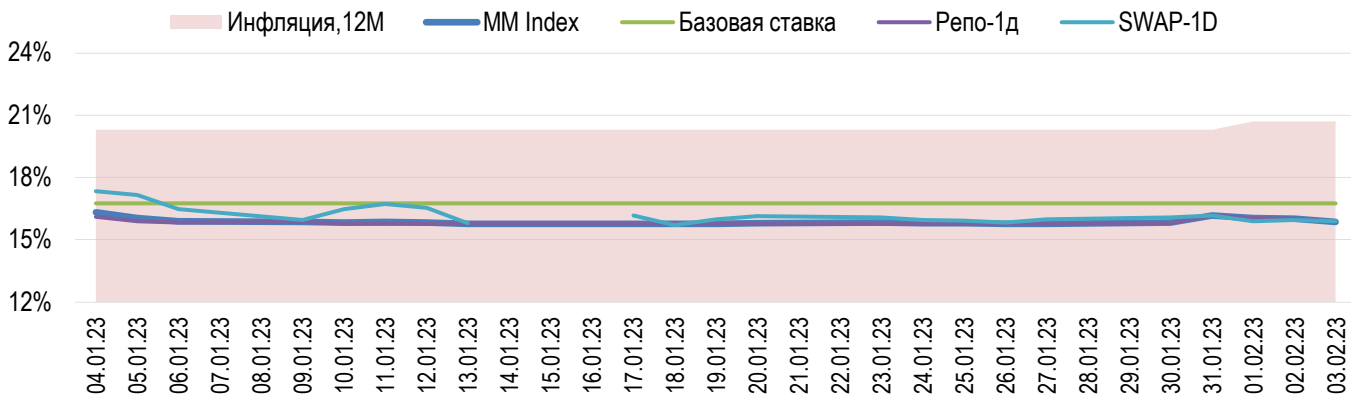
По итогам торгов 3 февраля рыночный курс тенге сложился на уровне 458,69 тенге за доллар США, укрепившись за неделю на 0,4% (с 460,43).

На внешнем валютном рынке в период с 27 января по 3 февраля 2023 года произошел ряд значимых событий. В частности, ведущие центральные банки продолжили повышение процентных ставок: ФРС США увеличил ставку на 25 б.п., до 4,5-4,75%, ЕЦБ - на 50 б.п., до 2,5-3,25%, Банк Англии - на 50 б.п., до 4%. В январе данные по рынку труда США оказались выше ожиданий аналитиков: число рабочих мест в экономике увеличилось на 517 тыс., безработица снизилась до 3,4%. Эти факторы привели к преимущественно негативной динамике валют развивающихся рынков.

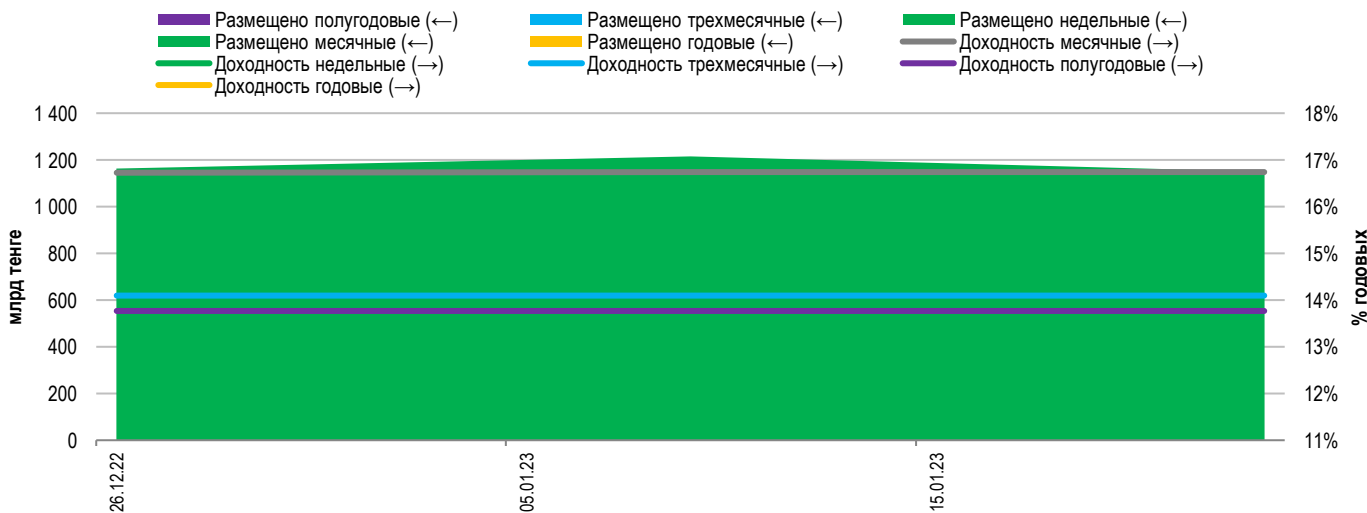


Доходность операций РЕПО с государственными ценными бумагами (ГЦБ) сроком на один день (TONIA) с 27 января по 3 февраля повысилась с 15,76% до 15,87% годовых. Ставка заимствования тенге под залог долларов США сроком на один день (SWAP-1D (USD)) за рассматриваемый период понизилась с 15,99% до 15,88%.

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 января курс тенге укрепился на 0,5% до 460,52 тенге за доллар США. Среднедневной объем торгов на Казахстанской фондовой бирже за месяц снизился со 141 до 103 млн долл. США. Общий объем торгов составил 2,1 млрд долл. США. В течение месяца валютный рынок был сбалансирован с точки зрения спроса и предложения, обменный курс формировался в зависимости от рыночных условий.

Продажи валютной выручки субъектами квазигосударственного сектора в течение прошедшего месяца составили порядка 453 млн долл. США. Компании квазигосударственного сектора самостоятельно осуществляют продажу на валютном рынке через банки второго уровня.

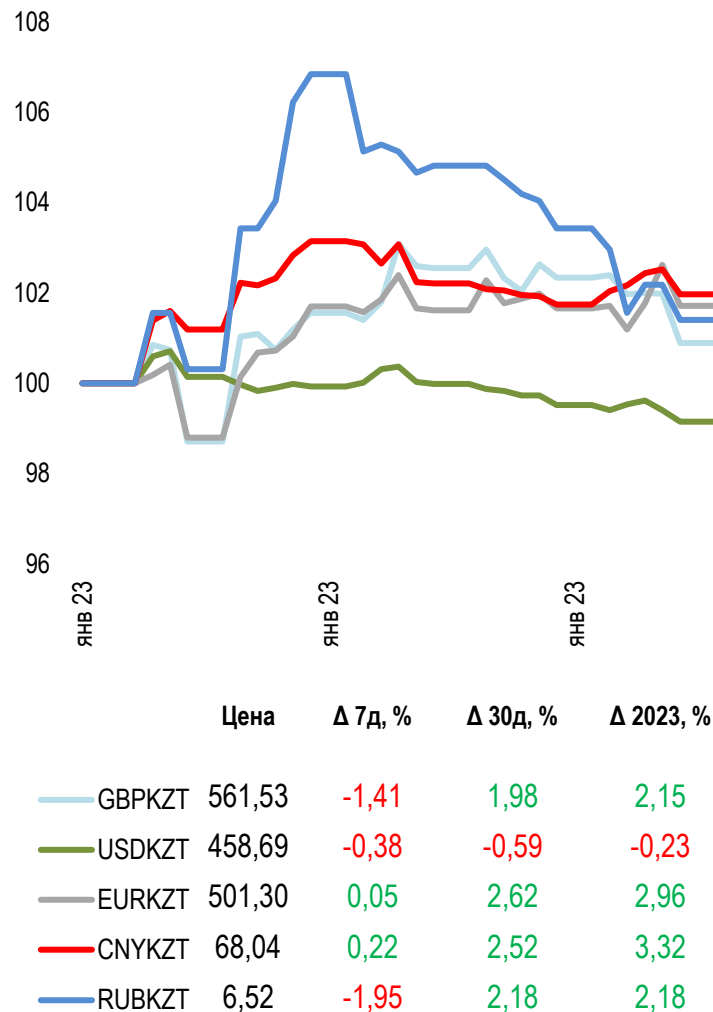
Продажи валюты для обеспечения трансфертов из Национального фонда в республиканский бюджет за январь составили 228 млн долларов США. Доля продаж из Национального фонда составила 11,1% от общего объема торгов и не более 12 млн долларов США в день. При проведении операций со средствами Национального Фонда, Национальным Банком соблюдается принцип рыночного нейтралитета, что подразумевает проведение регулярных и равномерных продаж иностранной валюты. Данная практика позволяет минимизировать влияние операций Национального Фонда на валютный рынок.

В целях поддержания валютной доли пенсионных активов ЕНПФ на уровне 30% Национальный Банк в январе осуществлял покупки иностранной валюты на биржевых торгах, общая сумма которых составила 120 млн долларов США или порядка 5,8% от общего объема рынка.

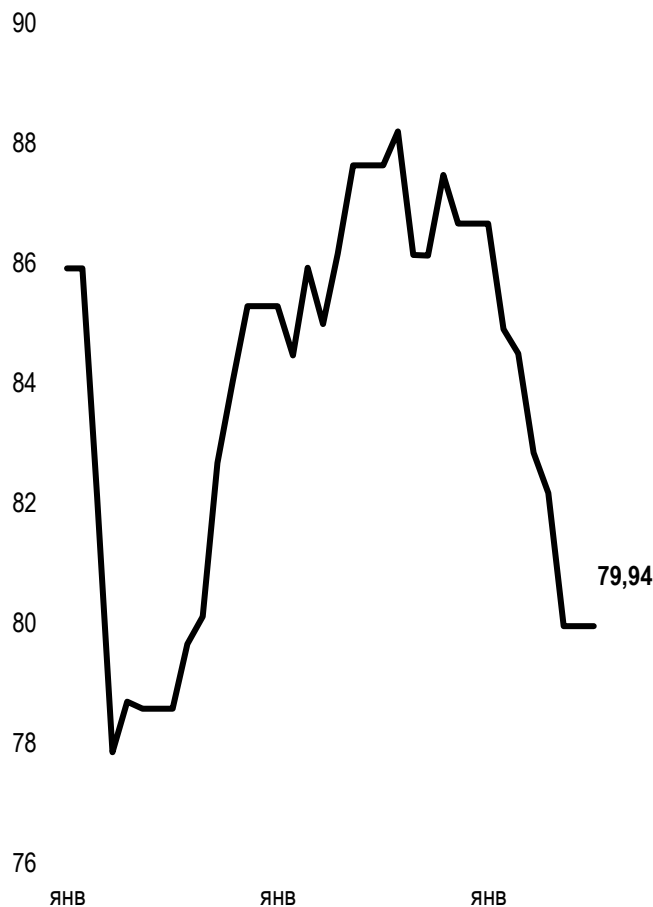
Валютных интервенций в январе Национальный Банк не проводил.

Динамика курсов иностранных валют

Δ %, база (01.01.23)



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

Наименование	Значение	Тренд %			Фьючерс
		7д	1м	1г	7д
S&P 500	4 136,48	1,6	7,4	-7,6	1,6
Dow Jones	33 926,01	-0,2	2,0	-3,4	-0,2
PTC	1 002,52	1,0	5,5	-30,0	0,6
ММББ	2 285,53	0,0	0,0	0,0	0,6
Hang Seng	21 660,47	-4,5	4,2	-9,0	-4,5
SS CSI 300	4 141,63	-1,0	6,4	-9,2	-1,2
Euro Stoxx 50	4 257,98	1,9	7,1	2,8	1,8
FTSEuroFirst	4 866,00	0,8	4,7	2,2	0,9
FTSE 100	7 901,80	1,8	4,2	5,0	1,7
KASE	3 353,40	1,9	3,2	-4,6	

Сырьевой рынок

03.02.2023

Наименование	Цена	Тренд %		
		7д	1м	1г
Нефть Brent	79,94	-7,8	2,7	-12,3
Нефть WTI	73,39	-7,9	0,8	-18,7
Природный газ	2,41	-22,5	-42,2	-50,7
Медь	405,65	-3,9	8,4	-9,3
Железо	887,00	1,8	3,0	10,7
Золото	1 864,97	-3,3	0,6	3,3
Серебро	22,41	-5,2	-6,5	0,1
Пшеница	756,75	0,9	1,5	0,7

Календарь экономических событий

	Валюта	Прогноз	Предыдущее
06.02 <u>Председатель ЕЦБ Лагард выступит с речью</u>	EUR		
07.02 <u>Выступление главы ФРС г-на Пауэрлла</u>	USD		
08.02 <u>Запасы сырой нефти</u>	USD	2,457M	4,140M
09.02 <u>Индекс потребительских цен (ИПЦ) Германии (г/г) (янв)</u>	EUR	8,9%	8,6%
09.02 <u>Саммит лидеров ЕС 9-10 февраля</u>	EUR		
09.02 <u>Число первичных заявок на получение пособий по безработице</u>	USD	190K	183K
10.02 <u>Решение по процентной ставке (фев)</u>	RUB	7,5%	7,5%

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

В – миллиарды
М – миллионы
К – тысячи

Макроэкономическая статистика Казахстана

	Значение	На дату	Предыдущий месяц
Годовая инфляция	20,7%	01.02.23	20,3%
Валовые международные резервы НБК, млрд USD	35,1	01.01.23	34,0
Денежная база, млрд KZT	11 874,4	01.01.23	11 719,9
Денежная масса, млрд KZT	34 295,9	01.01.23	32 768,4

Кредитные рейтинги Казахстана

	Рейтинг	Дата	Предыдущее
S&P Global	BBB-/A-3 негативный	02.09.22	BBB-/A-3 стабильный
MOODY'S	Ваа2/стабильный	11.08.21	Ваа3/позитивный
FitchRatings	BBB/стабильный	02.12.22	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



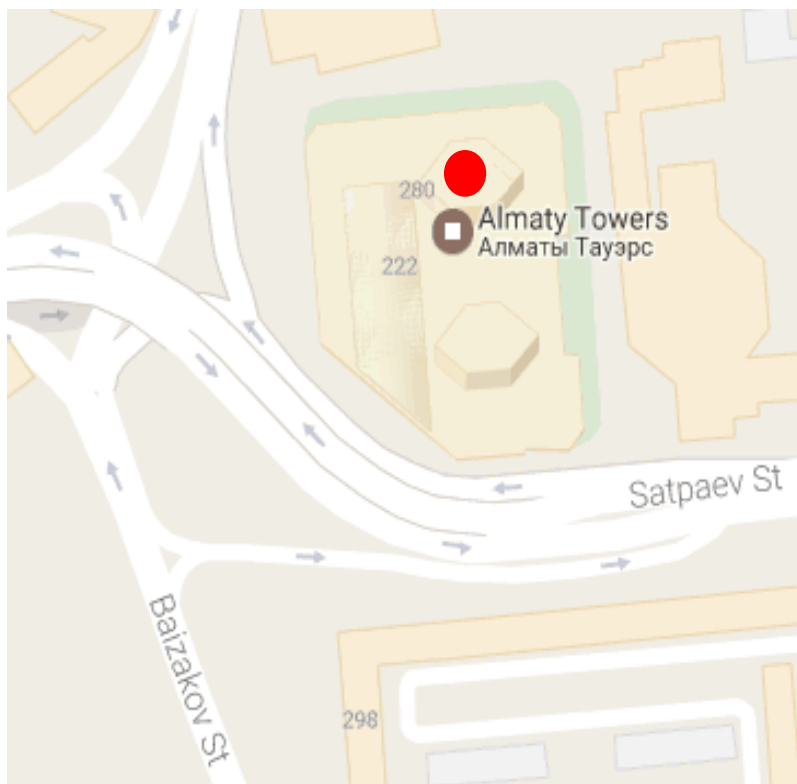
Корпоративный вебсайт



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.