

ЕЖЕНЕДЕЛЬНИК KASE

11 – 15 июня,
2018

СОБЫТИЯ KASE

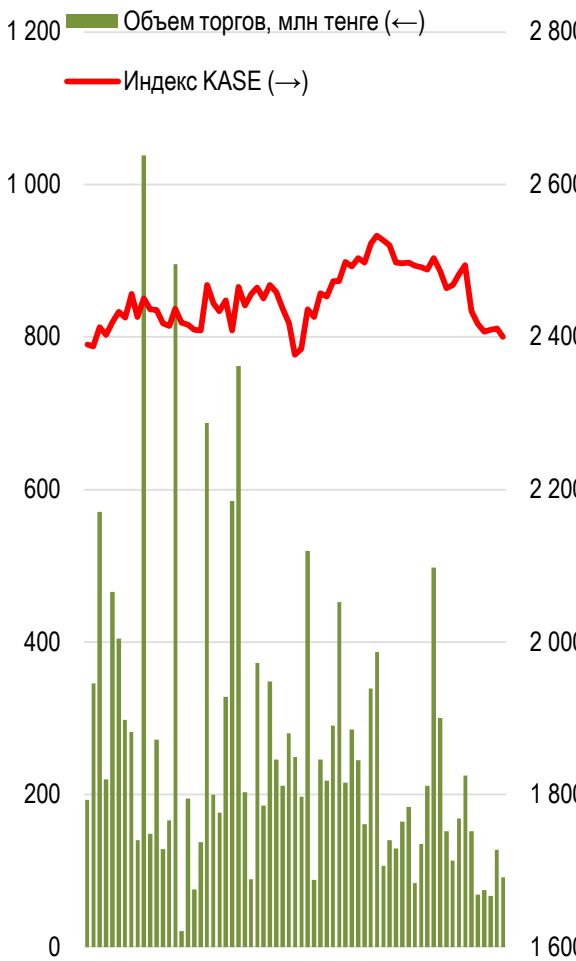
- ▲ 12 июня KASE провела медиа-брифинг для СМИ, посвященный итогам работы биржевого рынка за период январь - май 2018 года. Совокупный объем торгов на KASE за отчетный период достиг 54,7 трлн тенге, что ниже показателя января – мая 2017 года на 21,4 %. Положительную динамику показали рынки иностранных валют (+32,9 %), акций (+38,2 %), корпоративных облигаций (в 5,4 раза). Снижение наблюдалось на рынке денег (-25,8 %), государственных ценных бумаг (-10,4 %) и ценных бумаг инвестиционных фондов (-61,1 %).
- ▲ В мае количество счетов физических лиц, задействованных в сделках с акциями на KASE, увеличилось на 8,6 %.
- ▲ С 15 июня Казахстанская фондовая биржа запустила площадку KASE Private Market.

НОВОСТИ ЭМИТЕНТОВ И АНОНСЫ

- ▲ Министерство финансов привлекло на KASE 25,2 млрд тенге, разместив свои 13 летние облигации под 8,44% годовых.
- ▲ Евразийский банк развития привлек на KASE 20,0 млрд тенге, разместив трехлетние облигации EABRK120621_1 с доходностью к погашению 9,10 % годовых.
- ▲ Евразийский банк развития привлек на KASE 20,0 млрд тенге, разместив трехлетние облигации EABRK120621_2 с доходностью к погашению 9,10 % годовых.
- ▲ Евразийский банк развития привлек на KASE 10,0 млрд тенге, разместив трехлетние облигации EABRK120621_3 с доходностью к погашению 9,10 % годовых.
- ▲ Акимат Костанайской области привлек на KASE 3,4 млрд тенге, разместив двухлетние облигации под 0,35 % годовых.
- ▲ Акимат Атырауской области привлек на KASE 1,0 млрд тенге, разместив двухлетние облигации под 0,35 % годовых.
- ▲ Акимат Павлодарской области привлек на KASE 1,2 млрд тенге, разместив двухлетние облигации под 0,35 % годовых.
- ▲ Акимат Северо-Казахстанской области привлек на KASE 1,0 млрд тенге, разместив двухлетние облигации под 0,35 % годовых.
- ▲ Акимат Западно-Казахстанской области привлек на KASE 800,3 млн тенге, разместив двухлетние облигации под 0,35 % годовых.

Индекс KASE закрывает четвертую неделю подряд снижением, в последний раз такая тенденция была зафиксирована в апреле 2016 года. По итогам торговой недели индекс голубых фишек снизился на 0,47%, и достиг отметки 2 400,03 пунктов. Из 7 наименований акций, входящих в индекс, 4 компонента закрылись в минусе.

Акции Индекса KASE



Доли физ. лиц и нерезидентов, %



15.06.2018

Индекс KASE	2 400,0	Тренды (%)	
		-1,4	-3,9
Первый класс ликвидности	Цена	Δ 7д	Δ 1м
QAZKOM	110,0	15,8	4,8
Казахтелеком (прив.)	14 000,0	3,0	15,7
Bank of America	10 050,0	1,5	0,5
Казахтелеком	33 301,0	0,9	6,2
Аэрофлот (Россия)	782,7	0,8	1,5
Банк ЦентрКредит	290,0	0,4	-1,4
Народный банк	102,4	0,2	-2,7
Банк Астаны	860,4	0,0	-1,2
АЗМ	10 581,2	-0,2	-3,8
KEGOC	1 412,0	-0,2	-1,1
БАСТ	53 170,0	-1,4	0,3
Kcell	1 520,0	-1,9	-6,7
Сбербанк (Россия)	1 133,9	-2,2	-8,0
КазТрансОйл	1 345,0	-3,8	-15,8
Газпром (Россия)	744,8	-3,9	-5,7
Банк ВТБ (Россия)	0,2	-4,0	-11,1
KAZ Minerals	4 301,0	-4,9	-5,5
РД КазМунайГаз (прив.)	8 299,0	-5,7	-12,8

Справка: зеленым цветом выделены индексные акции

Наибольшее падение на фоне снижения котировок на медь продемонстрировали акции Kaz Minerals PLC, цена акций упала на 4,87% до 4 301,03 тенге. За неделю медь подешевела на 5,3% или на 367 долларов до уровня 6908,2 долларов за тонну.

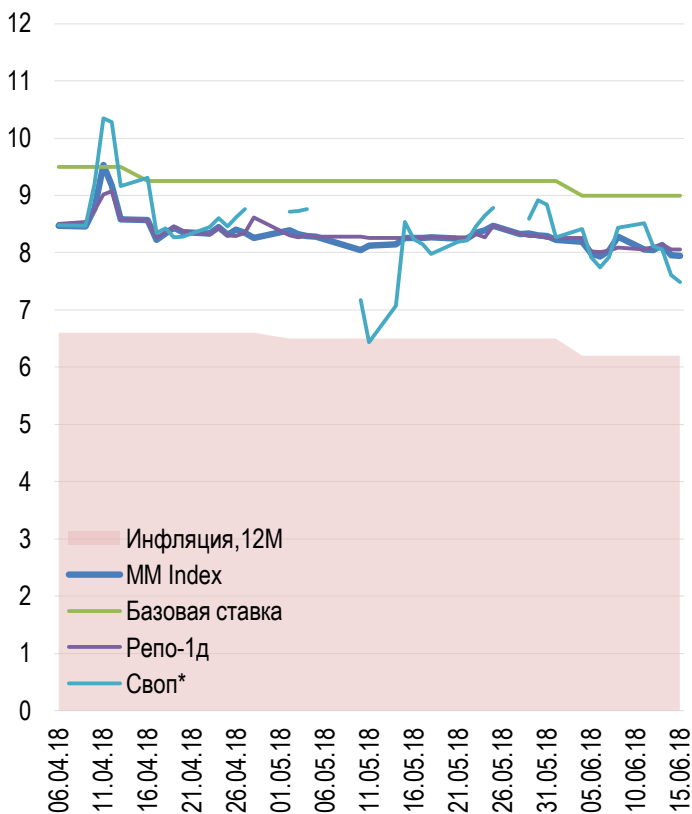
Ощутимое снижение продемонстрировали акции Казтрансойл и Кселл. Акции первой снизились на 3,85%, долевые инструменты мобильного оператора сократились в цене на 1,94%.

Рост почти в один процент показали акции Казахтелеком, долевые инструменты банков входящих в индекс выросли менее чем на 0,5%.

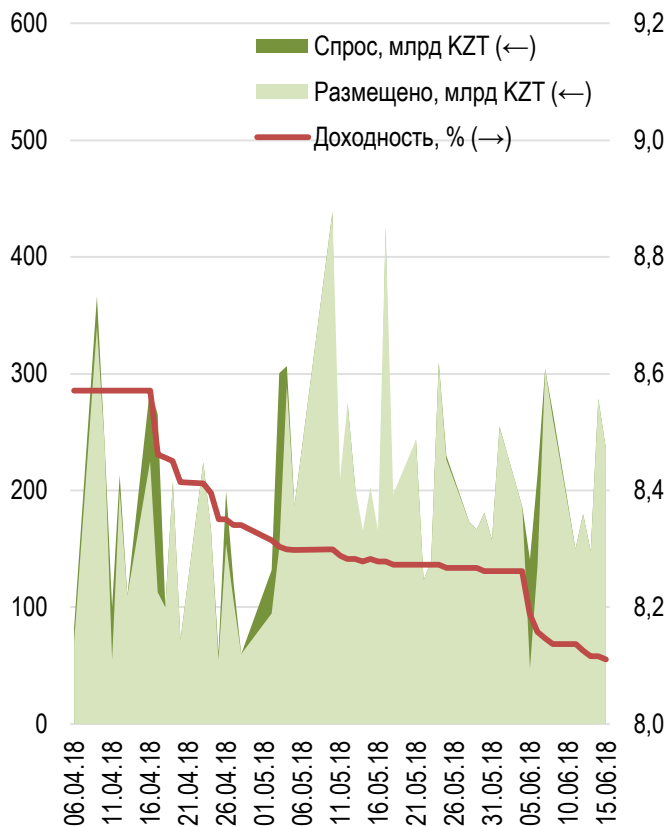
Доходность по однодневным валютным свопам после пятничного скачка на прошлой неделе, вернулась к более привычным значениям, снизившись за неделю на 4,3 п.п. до 6,68%. Доходность операций репо с государственными ценными бумагами сроком на один день снизилась на 3 б.п. и остановилась на уровне 8,06 % годовых.

Открытая позиция по нотам Нацбанка на этой неделе находилась выше 4 трлн тенге. Регулятор путем почти 100%-го удовлетворения спроса увеличил на 128,6 млрд тенге объем размещённых нот в сравнении с прошлой неделей. За неделю Нацбанк вне биржи разместил 7 выпусков нот. Общий объем достиг 1,2 трлн тенге.

Инфляция и процентные ставки

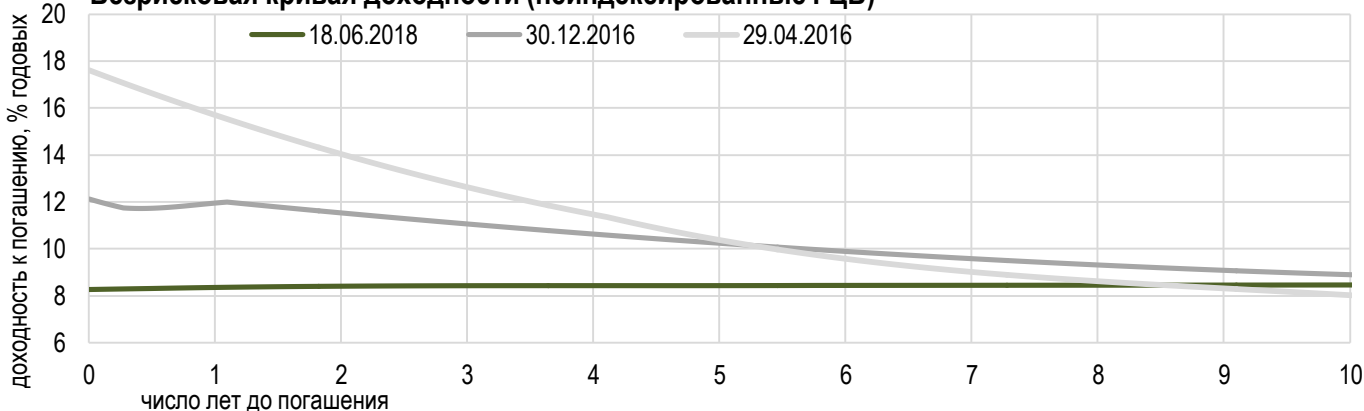


Размещения недельных нот Нацбанка



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

Безрисковая кривая доходности (неиндексированные ГЦБ)





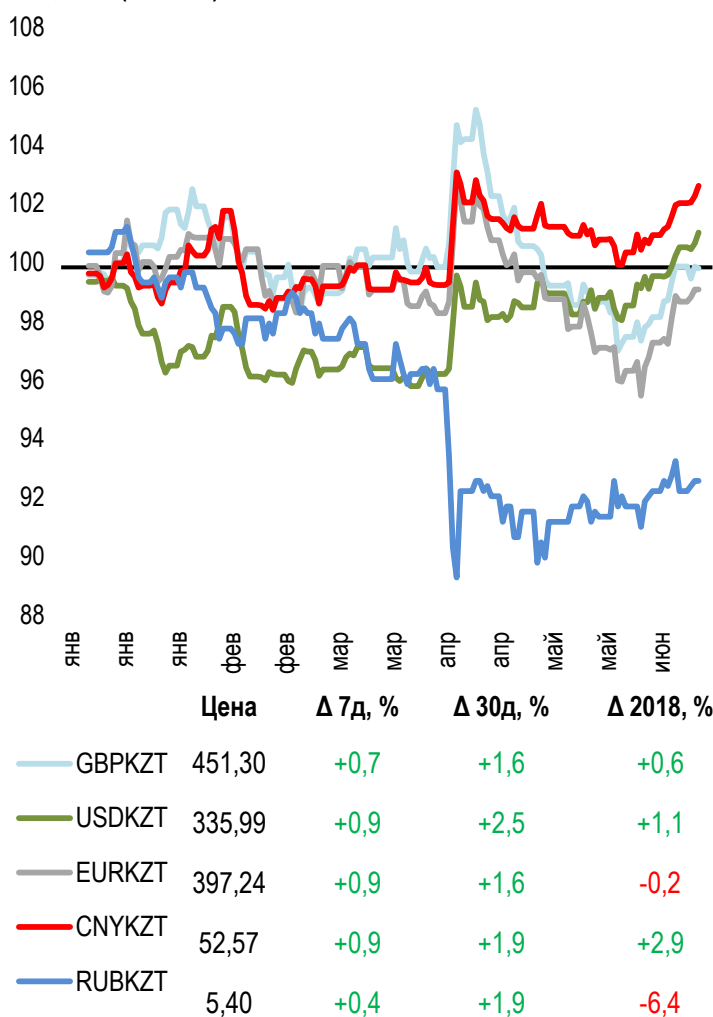
Средневзвешенный курс доллара по итогам недели вырос на 0,7 % или на 2,37 тенге до 336,39 тенге. По итогам этой недели объем торгов по сравнению с прошлой снизился на 27 % до 581,5 млн долларов.

Курс валютной пары доллар/тенге продолжил расти третью неделю подряд. Доллар подорожал до максимальных уровней с середины октября 2017 года. Определенное давление на тенге на этой неделе оказали ряд факторов, в их числе: дешевеющая нефть и рубль, а также повышение резервной ставки ФРС США. В среду ФРС подняла базовую процентную ставку на 25 б.п.

Российская валюта по итогам недели выросла на 0,0349 тенге до 5,3785 тенге. Суммарный объем торгов за текущую неделю достиг 157,0 млн рублей. Курс евро на протяжении всей недели демонстрировал рост на фоне ослабления тенге. Однако в пятницу евро подешевел сразу на 8 тенге. Снижение европейской валюты произошло на фоне прошедшей пресс-конференции, на которой ЕЦБ сохранил нулевую процентную ставку, а также снизил прогноз роста экономики еврозоны на 2018 год с 2,4% до 2,1 %. По итогам недели курс евро снизился на 1,5 тенге до 388,90 тенге.

Курс юаня по итогам недели вырос на 0,1841 тенге остановившись на уровне 52,3941 тенге при объеме сделок 9,1 млн юаней.

Динамика курсов иностранных валют
Δ %, база (01.01.18)



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	2 779,66	0,0	2,1	14,3	0,1
Dow Jones	25 090,48	-0,9	1,3	17,5	-0,8
PTC	1 117,04	-2,3	-6,1	12,6	-2,8
MMBБ	2 285,53	0,0	0,0	25,7	-2,8
Hang Seng	30 309,49	-2,1	-2,6	18,6	-1,9
SS CSI 300	3 753,43	-0,7	-3,6	6,4	-1,0
Euro Stoxx 50	3 505,02	1,7	-1,6	-0,6	1,8
FTSEuroFirst	4 318,60	2,2	-0,7	0,9	0,9
FTSE 100	7 633,91	-0,6	-1,3	2,9	-1,3
KASE	2 400,03	-1,4	-3,9	56,4	

Сырьевой рынок

15.06.2018

Наименование	Цена	Тренд %	
		7д	1м
Нефть	73,44	-3,9	-7,4
	65,06	-1,0	-9,0
Природный газ	3,02	4,6	7,4
Медь	314,45	-4,7	2,8
Железо	431,00	-12,0	-15,3
Золото	1 278,94	-1,5	-0,9
Серебро	16,48	-1,6	1,1
Пшеница	499,50	-3,9	1,1

Календарь экономических событий

Валюта

Прогноз

Предыдущее

18.06	Выступление главы ЕЦБ Драги	EUR		
19.06	Выступление главы ФРС г-на Пауэлла	USD		
20.06	Продажи на вторичном рынке жилья (май)	USD	5,52M	5,46M
20.06	Запасы сырой нефти	USD	-1,033M	-4,143M
21.06	Решение по процентной ставке (июнь)	GBP	0,50%	0,50%
21.06	Индекс производственной активности от ФРБ Филадельфии (июнь)	USD	29,0	34,4
22.06	Выступление главы Банка Англии Карни	GBP		

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 2018г.

Годовая инфляция	6,2 %	01.06.18	7,1 %
Валовые международные резервы НБК, млн USD	31 172	01.06.18	30 745
Денежная база, млрд KZT	4 787,6	01.06.18	5 538,7
Денежная масса, млрд KZT	18 940,9	01.05.18	19 456,0

Кредитные рейтинги Казахстана

Рейтинг

Дата

Предыдущее

S&P Global

Moody's

FitchRatings

BBB- стабильный	12.03.18	BBB-стабильный
Ваа3 стабильный	26.07.17	Ваа3 негативный
BBB стабильный	17.04.18	BBB стабильный

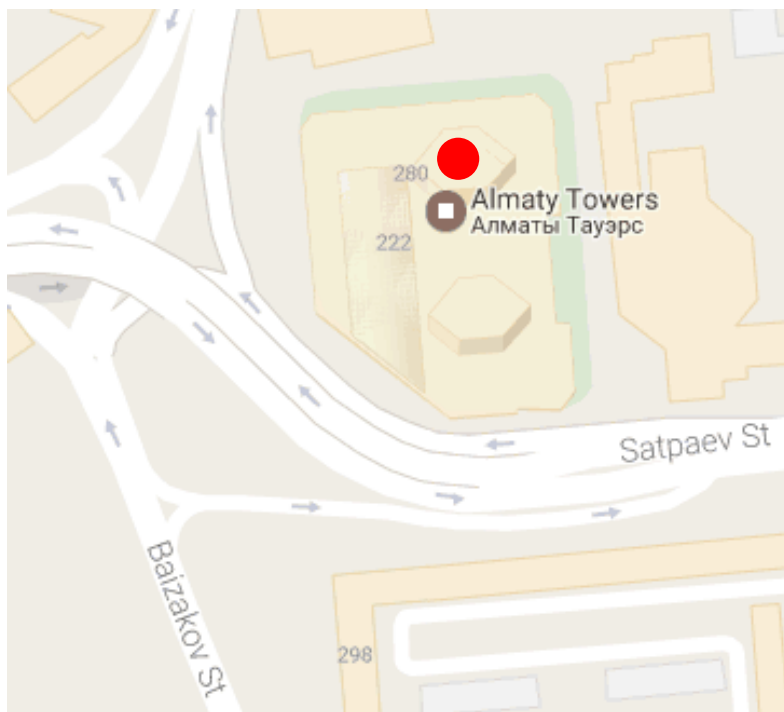
КОНТАКТНАЯ ИНФОРМАЦИЯ



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



Связаться с нами



**Календарь корпоративных
событий листинговых компаний**

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.