



Ежедневный обзор

Преимущественно отрицательная динамика

8 июня 2021 г.

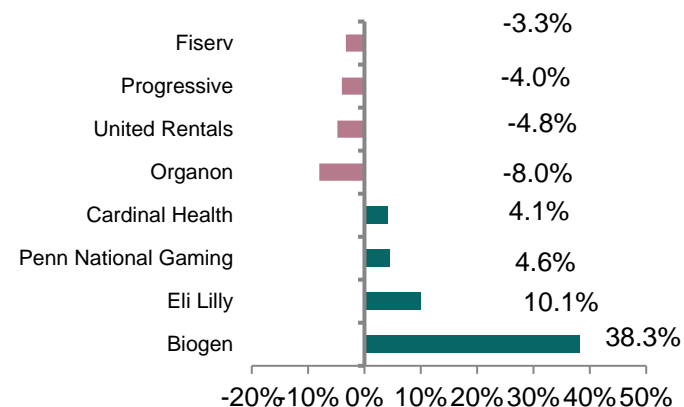
>> Преимущественно отрицательная динамика

Рынок акций США начал неделю преимущественно в красной зоне, оказавшись под давлением снижения секторов финансов (-0,6%), промышленности (-0,7%) и материалов (-1,2%). В фокусе внимания рыночного сообщества на этой неделе значится выход в четверг данных по инфляции. В условиях всплеска инфляционных опасений и подтверждения опережающего подъема потребительских цен на рынке затаилась определенная интрига, которую частично могут развеять майские данные. Согласно прогнозам аналитиков, темп роста потребительских цен в мае составит 4,7% в сравнении с ростом на 4,2% месяцем ранее.

>> Подъем сменился снижением

Попытка нефтяных котировок преодолеть уровень в \$72 за баррель не увенчалась успехом. Нефть марки Brent снизилась на 0,6% до \$71,5 за баррель и в настоящий момент ускорила нисходящую динамику, снижаясь в моменте на 0,8%. Возвращение за стол переговоров Ирана в вопросе исполнения ядерной сделки, а также снижение спроса на нефть в Китае оказали основное давление на цены. Импорт нефти в Китае в мае упал до минимума с начала года и снизился в годовом выражении на 14,6% до 9,65 млн. б/с в сравнении с 9,82 млн. б/с в апреле и 11,3 млн. б/с в мае прошлого года.

Лидеры и аутсайдеры индекса S&P 500



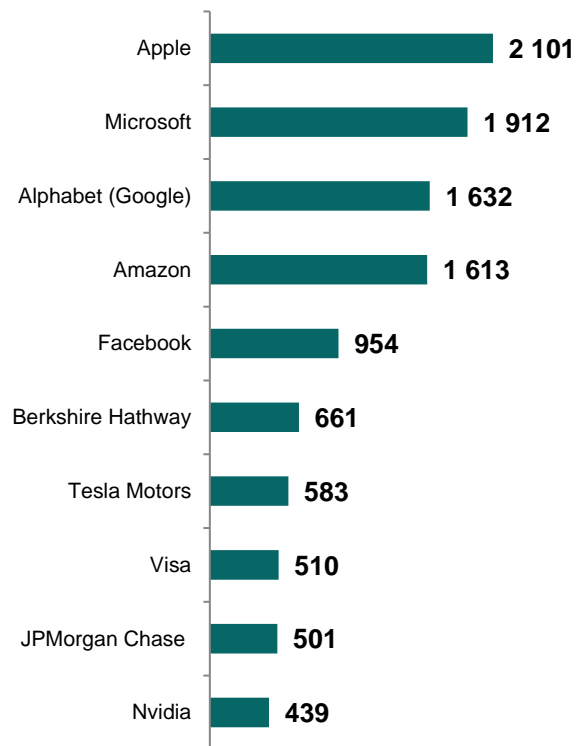
Товарный рынок

	Знач.	Изменение			
		1D	1W	1M	YTD
Brent	71,5	-0,6%	3,1%	4,7%	38,0%
LME Copper	9 901	-0,5%	-3,5%	-1,9%	27,5%
Zinc	3 000	-0,4%	-2,0%	1,9%	9,0%
Gold	1 895,15	0,2%	-0,6%	3,5%	0,0%
Silver	27,9	0,4%	-0,5%	1,7%	5,9%
Natural Gas	3,1	-0,9%	2,8%	3,8%	20,9%
Aluminum	2 426	-1,2%	-2,3%	-2,5%	22,6%

Ежедневный обзор

8 июня 2021 г.

>> Рыночная капитализация 10 крупнейших публичных компаний США, млрд. \$



>> Динамика изменения индекса S&P 500

	Изменение		Количество эмитентов	Вес, (%)
	в %	в пунктах		
S&P 500	-0,1%	-3,4	505	100%
Information Technology	0,0%	-0,2	74	26,2%
Health Care	0,4%	1,9	63	13,0%
Consumer Discretionary	-0,1%	-0,2	63	12,1%
Financials	-0,6%	-3,2	65	11,9%
Communication Services	0,5%	2,2	26	11,1%
Industrials	-0,7%	-2,6	74	8,9%
Consumer Staples	-0,2%	-0,5	32	6,0%
Materials	-1,2%	-1,5	28	2,8%
Energy	-0,4%	-0,5	23	2,8%
Utilities	0,2%	0,2	28	2,6%
Real Estate	0,9%	1,0	29	2,6%

>> Преимущественно отрицательная динамика

Рынок акций США начал неделю преимущественно в красной зоне, оказавшись под давлением снижения секторов финансов (-0,6%), промышленности (-0,7%) и материалов (-1,2%). В фокусе внимания рыночного сообщества на этой неделе значится выход в четверг данных по инфляции. В условиях всплеска инфляционных опасений и подтверждения опережающего подъема потребительских цен на рынке затаилась определенная интрига, которую частично могут развеять майские данные. Согласно прогнозам аналитиков, темп роста потребительских цен в мае составит 4,7% в сравнении с ростом на 4,2% месяцем ранее. Базовая инфляция (Core Inflation) без учета затрат на еду и энергоносители в годовом выражении увеличится на 3,4%, что станет самым сильным подъемом с 1993 года.

>> Июньская встреча ФРС

На следующей неделе состоится двухдневное заседание американского регулятора (15-16 июня). Головной болью для Федрезерва может стать очередной сильный подъем инфляции, который потенциально может привести к ужесточению денежно-кредитной политики раньше, чем предполагалась ранее.

В недавнем прошлом ФРС пыталась успокоить рынки, что резкий рост потребительских цен носит лишь кратковременный характер. Однако в случае нового резкого роста инфляции, рынок едва ли оценит попытки Федрезерва сгладить острые углы вновь.

>> Корпоративный блок

В последние несколько торговых дней бумаги поставщиков репетиторских услуг Китая перешли к заметному снижению на фоне ужесточения регулирования их деятельности со стороны властей. В первые три торговых дня июня капитализация основных игроков рынка Tal Education Group (-6.4%), New Oriental Education (-3,8%) и GSX Techedu (-0,4%) показала двузначную динамику падения и вчера их котировки отметились преимущественно сильным снижением.

Фондовые индексы	Регион	Посл. знач.	Изменение	
			За день	С начала года
Americas				
S&P500	США	4 226,5	-0,08%	12,53%
Dow Jones	США	34 630,2	-0,36%	13,15%
NASDAQ	США	13 881,7	0,49%	7,71%
EMEA				
Euro Stoxx 50	Еврозона	4 097,7	0,20%	15,34%
FTSE 100	Великобритания	7 077,2	0,12%	9,55%
CAC 40	Франция	6 543,6	0,43%	17,87%
DAX	Германия	15 677,2	-0,10%	14,28%
IBEX 35	Испания	9 163,6	0,83%	13,50%
FTSE MIB	Италия	25 824,7	0,99%	16,16%
Asia/Pacific				
Nikkei 225	Япония	29 050,7	0,11%	5,85%
Hang Seng	Гонконг	28 854,1	0,23%	5,96%
CSI 300	Китай	5 286,0	0,16%	1,43%
Shanghai	Китай	3 605,5	0,17%	3,81%
Sensex	Китай	52 328,5	0,44%	9,59%
Singapore	Сингапур	3 171,6	-0,13%	11,53%
Emerging markets				
Bovespa	Бразилия	130 776,3	0,50%	9,88%
RTSI\$	Россия	1 653,0	0,36%	19,14%
NIFTY 50	Индия	15 751,7	0,52%	12,66%
TOP 40	ЮАР	61 387,8	-0,37%	12,89%
Borsa Index	Турция	1 432,9	0,34%	-2,97%
KASE	Казахстан	3 421,3	0,24%	27,87%

Ежедневный обзор

8 июня 2021 г.

>> Валютный рынок

- Индекс доллара США (DXY), показывающий отношение доллара относительно корзины из шести мировых валют, просел на 0,2% до 90.
- Российский рубль к доллару США ослаб на 0,1% до 72,8.
- Курс тенге к доллару США подрос на 0,1% до 427,2.

>> Главные новости

- Нацбанк Казахстана сохранил базовую ставку на уровне 9%
- Нацбанк Казахстана считает, что инфляция может превысить коридор 4-6% по итогам 2021г

LIBOR (USD)

	Знач.	Значение на дату			
		1D	1W	1M	YTD
LIBOR Overnight	0,06%	0,05%	0,06%	0,06%	0,08%
LIBOR1M	0,08%	0,08%	0,09%	0,11%	0,14%
LIBOR3M	0,13%	0,13%	0,13%	0,17%	0,24%
LIBOR6M	0,16%	0,16%	0,17%	0,20%	0,26%
LIBOR12M	0,25%	0,25%	0,25%	0,28%	0,34%

Валютный рынок

	Знач.	Изменение валютных пар			
		1D	1W	1M	YTD
DXY	90,0	-0,2%	0,1%	-0,3%	0,0%
USD/KZT	427,2	0,1%	0,3%	-0,1%	-1,4%
USD/RUB	72,8	-0,1%	1,0%	1,8%	2,1%
EUR/USD	1,22	0,2%	-0,3%	0,2%	-0,2%
GBP/USD	1,42	0,2%	-0,2%	1,4%	3,9%
USD/JPY	109,28	0,2%	0,2%	-0,6%	-5,8%

Долговой рынок

	Валюта	YTM	YTM на			
			1D	1W	1M	YTD
US Treasuries (10YR)	US\$	1,57%	1,55%	1,59%	1,58%	0,91%
US Treasuries (30YR)	US\$	2,25%	2,23%	2,28%	2,28%	1,64%
UK Gilts (30YR)	GBP	0,79%	0,84%	0,80%	0,79%	0,20%
Germany (10YR)	EUR	-0,21%	-0,18%	-0,18%	-0,23%	-0,57%
Russia (10YR)	RUB	7,16%	7,11%	7,07%	6,99%	5,89%
Kazakhstan (5YR)	US\$	0,96%	1,00%	0,98%	1,00%	0,88%

- **Нацбанк Казахстана сохранил базовую ставку на уровне 9%**

Национальный банк Казахстана принял решение сохранить базовую ставку на уровне 9% годовых с процентным коридором +/- 1 п.п., сообщила пресс-служба регулятора в понедельник. Соответственно, ставка по операциям постоянного доступа по предоставлению ликвидности составит 10% и по операциям постоянного доступа по изъятию ликвидности - 8%.

"Решение принято с учетом баланса рисков инфляции в краткосрочной и среднесрочной перспективе. Наблюдается сохранение внешнего инфляционного давления, обусловленного ростом мировых продовольственных цен и ускорением инфляции в странах - основных торговых партнерах Казахстана. Во внутренней экономике продолжается процесс постепенного восстановления деловой активности и потребительского спроса", - говорится в сообщении.

Как говорится в информации, основные риски инфляции в Казахстане в среднесрочной перспективе связаны с более сильным фискальным стимулированием экономики, дальнейшим ростом внутренних цен на ГСМ, более высокой продовольственной инфляцией в результате увеличения цен на мировых рынках и возникновением дисбалансов на внутреннем рынке продовольствия, а также сворачиванием стимулов центральными банками развитых стран.

По итогам мая 2021 года годовая инфляция составила 7,2%. Рост цен на непродовольственные товары и платные услуги был частично нивелирован дезинфляционными процессами на продовольственном рынке.

Источник: Интерфакс-Казахстан, Bloomberg

- **Нацбанк Казахстана считает, что инфляция может превысить коридор 4-6% по итогам 2021г**

Национальный банк Казахстана прогнозирует, что по итогам 2021 года инфляция может превысить целевой коридор 4-6%, сообщила пресс-служба регулятора в понедельник. "По оценкам Национального банка, снижение темпов замедления инфляции может привести к превышению целевого коридора 4-6% по итогам 2021 года.

Основными факторами пересмотра прогноза инфляции стали рост цен на ГСМ по итогам 5 месяцев 2021 года, увеличение тарифов энергопроизводящих организаций, а также сохранение внешнего инфляционного давления", - говорится в распространенном в понедельник сообщении.

В Нацбанке отмечают, что влияние дополнительного фискального импульса, связанное с уточнением республиканского бюджета, будет перераспределено между 2021 и 2022 годами.

В 2022 году регулятор ожидает, что инфляция в Казахстане может вернуться обратно в диапазон 4-6%, и причиной тому станет "недостижение инфляции в Китае и ЕС своих целевых уровней и стабилизация инфляции в России".

Источник: Интерфакс-Казахстан, Bloomberg

Ежедневный обзор

8 июня 2021 г.

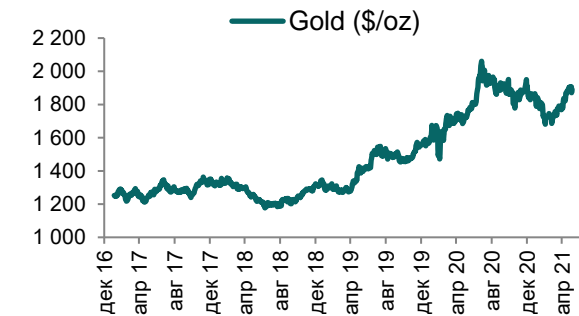
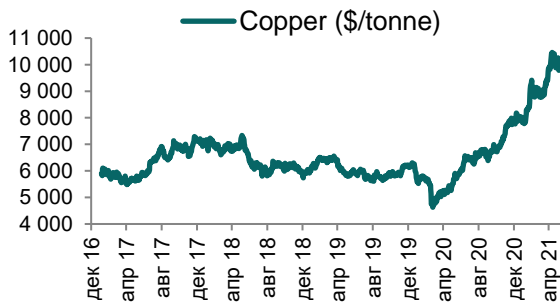
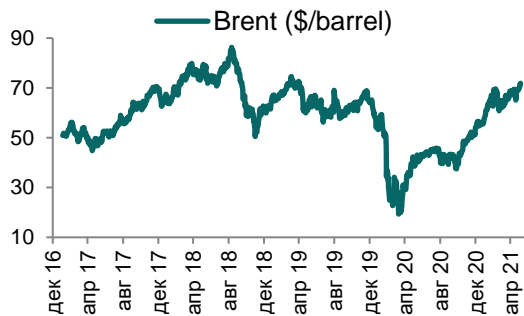
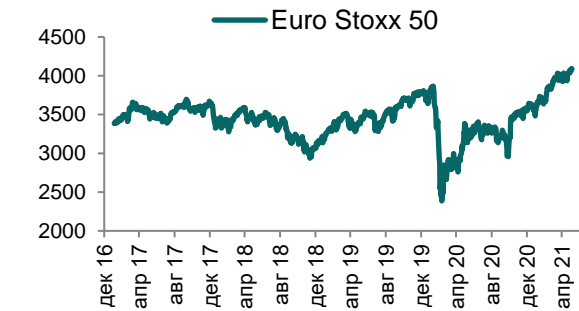
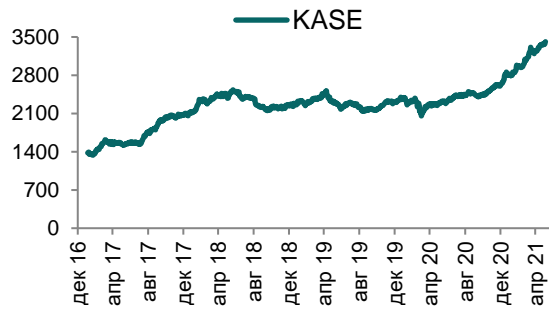
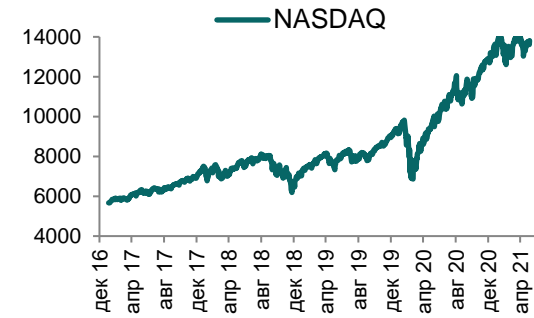
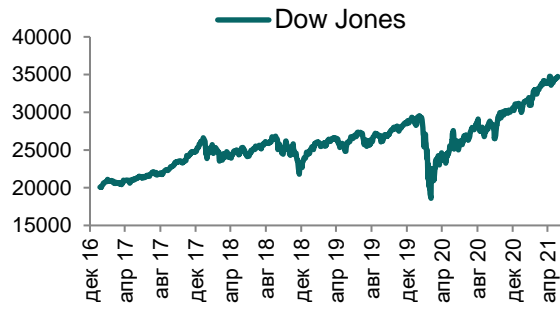
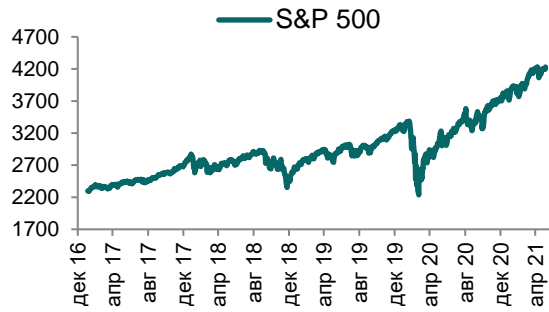
Таблица 1. Динамика изменения валют стран СНГ, развивающихся и развитых стран

Валютная пара (индекс)	Страна	Базовая ставка	Инфляция 2020	Доля в товарообороте*	Курс	1D	1W	1M	YTD
USD/RUB	Россия	5,00%	3,4%	19,3%	72,8	-0,1%	1,0%	1,8%	2,1%
USD/GEL	Грузия	8,25%	5,3%	-	3,2	0,1%	2,0%	8,0%	4,3%
USD/BYN	Беларусь	8,50%	6,0%	0,7%	2,53	0,4%	0,4%	1,1%	4,1%
USD/KGS	Кыргызстан	5,50%	7,9%	0,9%	84,62	0,0%	-0,1%	1,1%	-0,7%
USD/TJS	Таджикистан	11,00%	8,8%	0,9%	11,31	-0,1%	-0,1%	0,0%	-0,1%
USD/UZS	Узбекистан	14,00%	11,1%	2,9%	10 534,35	0,1%	0,1%	-0,2%	-0,7%
USD/UAH	Украина	7,50%	2,7%	1,0%	27,22	0,1%	0,4%	1,9%	3,9%
Развивающиеся страны									
USD/CNY	Китай	4,35%	2,6%	15,5%	6,40	0,0%	-0,4%	0,6%	2,0%
USD/BRL	Бразилия	3,50%	3,2%	0,0%	5,05	0,1%	3,3%	3,5%	2,9%
USD/INR	Индия	4,00%	6,9%	4,2%	72,81	0,3%	0,1%	1,3%	0,4%
USD/ZAR	ЮАР	3,50%	3,3%	-	13,52	-0,7%	1,6%	3,8%	7,8%
USD/TRY	Турция	19,00%	12,3%	3,9%	8,61	0,7%	-1,4%	-4,5%	-15,9%
Развитые страны									
DXY	США	0,25%	1,2%	2,2%	89,95	-0,2%	0,1%	-0,3%	0,0%
USD/CAD	Канада	0,25%	0,7%	0,3%	1,21	0,2%	0,1%	0,6%	5,5%
GBP/USD	Великобритания	0,10%	0,9%	0,7%	1,42	0,2%	-0,2%	1,4%	3,9%
USD/CHF	Швейцария	-0,75%	-0,7%	2,6%	0,90	0,2%	0,2%	0,4%	-1,4%
USD/JPY	Япония	-0,10%	0,0%	2,0%	109,28	0,2%	0,2%	-0,6%	-5,8%
USD/KRW	Южная Корея	0,50%	0,7%	2,9%	1 112,80	0,3%	-0,2%	1,2%	-2,4%

Источник: Bloomberg; *доля в товарообороте в торговле с Казахстаном (1К2020 г.)

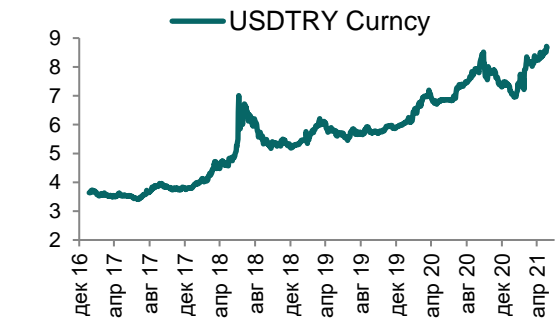
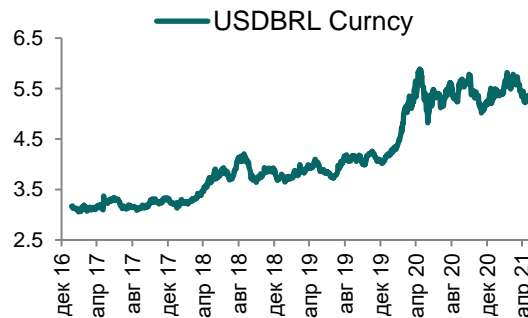
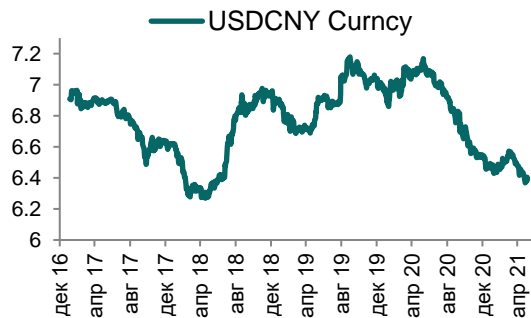
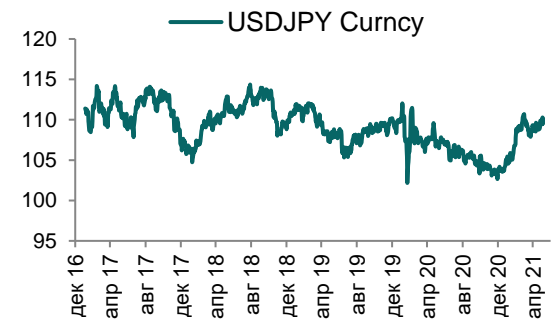
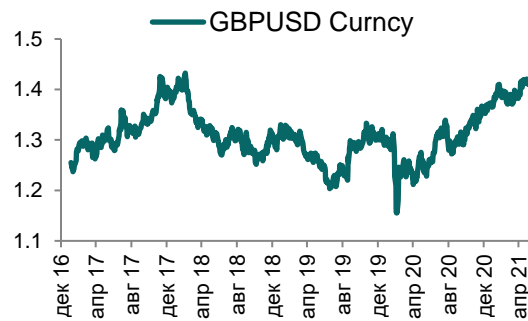
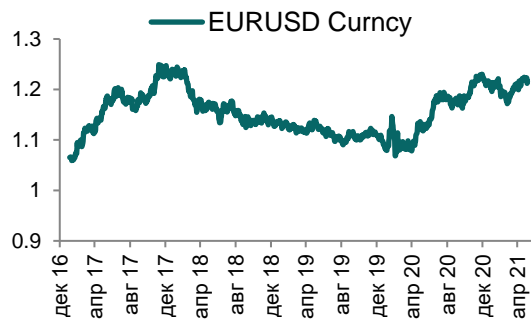
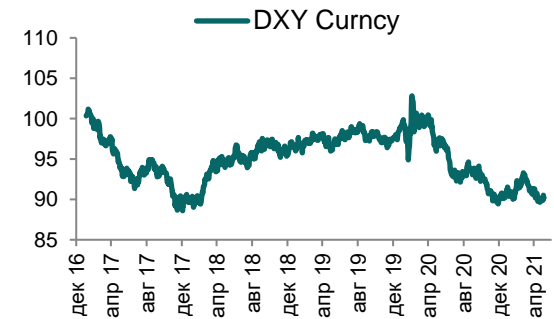
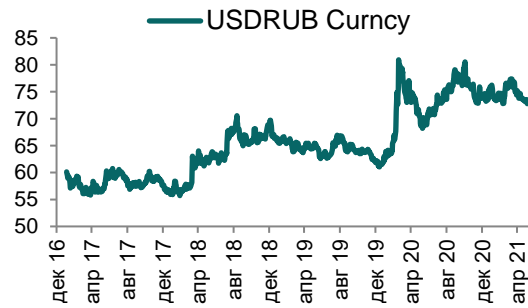
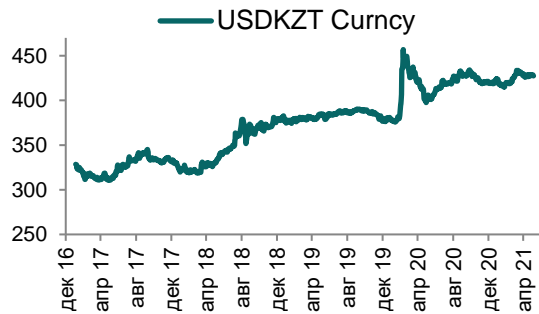
Ежедневный обзор

8 июня 2021 г.



Ежедневный обзор

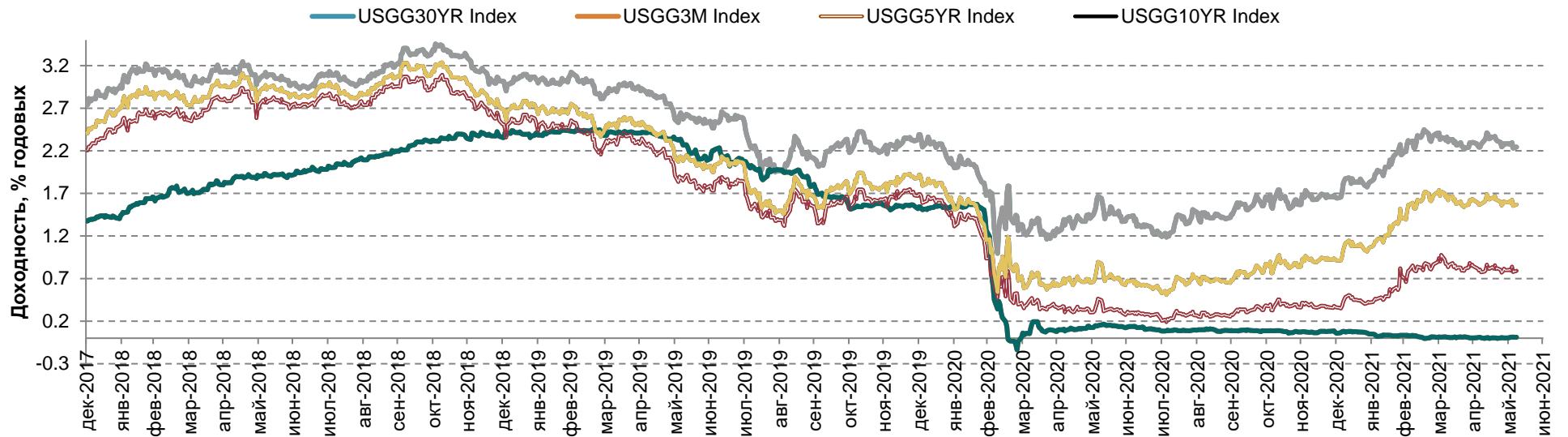
8 июня 2021 г.



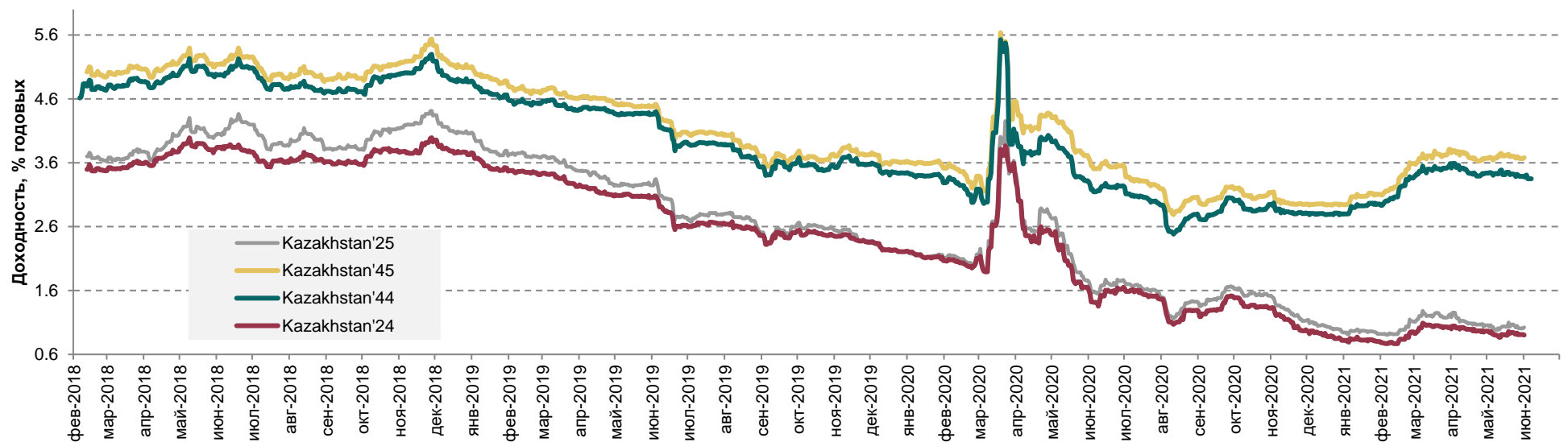
Ежедневный обзор

8 июня 2021 г.

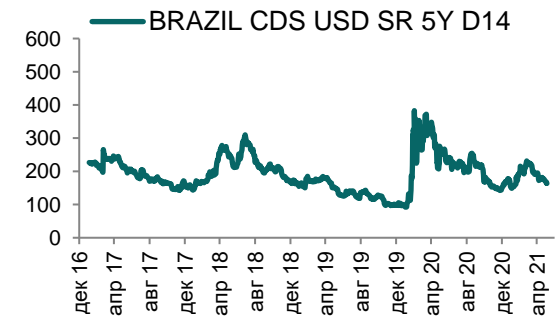
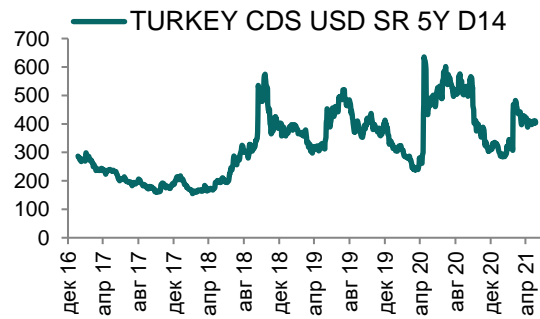
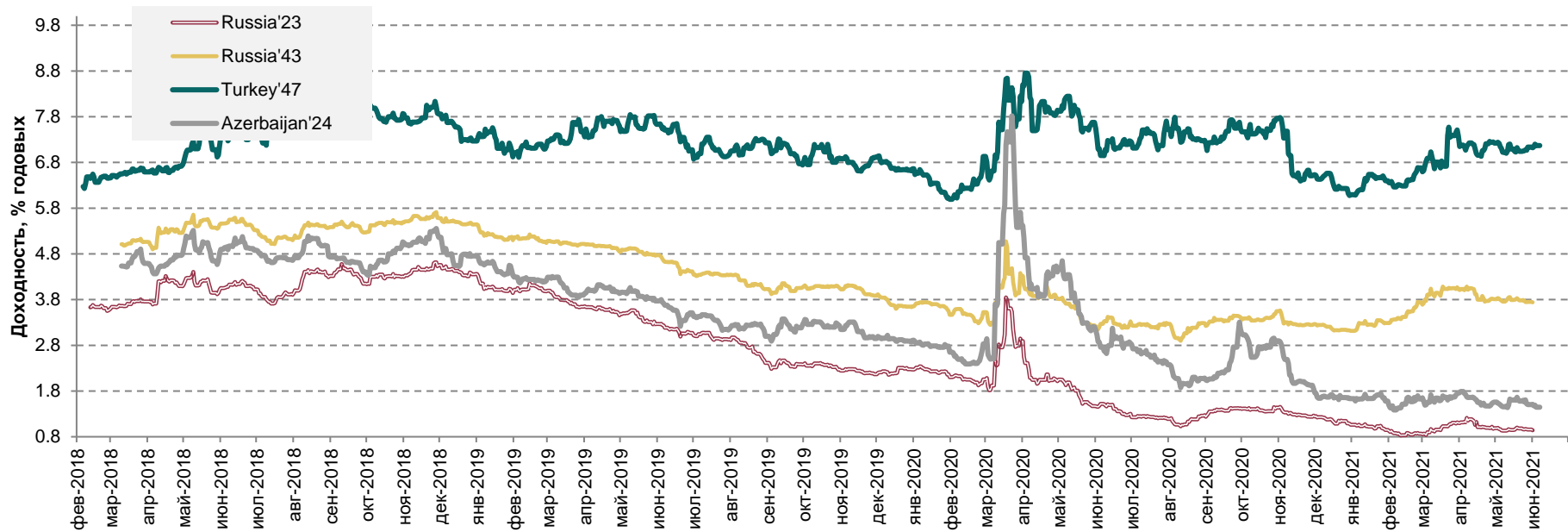
Доходность государственных ценных бумаг США



Динамика доходностей суверенных облигаций РК



Динамика доходностей суверенных еврооблигаций России, Турции и Азербайджана



Ежедневный обзор

8 июня 2021 г.

Таблица 2. Информация по казахстанским еврооблигациям

Выпуск	Валюта	Купон	Цена		Доходность		Спред		Дата погашения	Объем бумаг в обращении, млн.	Дюрация
			Покупка	Продажа	Покупка	Продажа	Z-Sprd	G-Sprd			
НК КМГ											
KZOKZ 4.750 2025	USD	4,75%	112,08	112,83	1,53	1,34	73,8	81,2	24.04.2025	500	3,56
KZOKZ 4.750 2027	USD	4,75%	113,95	114,73	2,20	2,07	107,5	108,0	19.04.2027	1000	5,15
KZOKZ 5.375 2030	USD	5,375%	119,00	120,09	2,93	2,80	143,1	135,2	24.04.2030	1250	7,20
KZOKZ 3.5 2033	USD	3,50%	103,45	104,21	3,15	3,07	146,6	140,5	14.04.2033	750	9,31
KZOKZ 5.750 2047	USD	5,75%	122,78	123,91	4,28	4,22	236,8	201,0	19.04.2047	1250	14,57
KZOKZ 6.375 2048	USD	6,375%	131,24	132,27	4,40	4,35	249,7	212,3	24.10.2048	1500	14,62
БРК											
DBKAZ 4.125 2022	USD	4,125%	104,09	104,76	1,37	0,93	76,3	83,4	10.12.2022	1264	1,44
DBKAZ 6 2026	USD	6%	115,53	117,71	2,54	2,10	131,0	134,8	23.03.2026	107	4,19
ЕАБР											
EURDEV 4.767 2022	USD	4,767%	104,51	104,55	1,22	1,18	102,0	110,2	20.09.2022	500	1,24
EURDEV 1 2026	EUR	1,000%	99,95	100,53	1,01	0,89	113,8	144,8	17.03.2026	300	4,63
КТЖ											
KTZKZ 3.638 2022	CHF	3,638%	103,24	103,67	0,48	0,08	76,2	93,4	20.06.2022	185	0,99
KTZKZ 6.95 2042	USD	6,95%	134,93	136,23	4,39	4,32	251,6	214,3	10.07.2042	883	12,22
Республика Казахстан											
KAZAKS 5.4 2023	RUB	5,40%	97,33	97,35	6,78	6,77	-36,1	50,8	20.09.2023	20 000	2,02
KAZAKS 1.55 2023	EUR	1,55%	103,25	103,83	0,20	-0,03	41,8	65,8	09.11.2023	525	2,37
KAZAKS 3.875 2024	USD	3,875%	109,41	110,02	1,01	0,84	37,5	46,0	14.10.2023	1 500	3,15
KAZAKS 5.125 2025	USD	5,125%	116,25	116,82	1,08	0,95	30,1	36,8	21.07.2025	10 000	3,71
KAZAKS 6.55 2027	RUB	6,55%	96,64	96,99	7,35	7,28	2,8	38,4	15.09.2027	10 000	4,81
KAZAKS 2.375 2028	EUR	2,375%	111,40	112,50	0,79	0,64	93,8	122,7	09.11.2028	525	6,79
KAZAKS 7 2030	RUB	7%	96,15	96,16	7,73	7,72	39,0	57,0	11.09.2030	10 000	6,33
KAZAKS 4.875 2044	USD	4,875%	123,21	124,20	3,42	3,37	147,6	115,1	14.10.2044	1 000	14,83
KAZAKS 6.5 2045	USD	6,500%	144,03	145,15	3,72	3,66	179,1	143,8	21.07.2045	1 500	13,94
Forte Bank											
ALLIBK 14 2022	USD	14%	114,51	115,87	0,30	-0,86	305,4	-93,8	30.06.2022	75	0,97
Банк ЦентрКредит											
CCBNKZ Float perp	USD	7,483%	44,25	46,25	13,90	13,29			бессрочные		n/a
КазТрансГаз											
KZTGKZ 4.375 2027	USD	4,375%	111,10	111,89	2,46	2,33	126,4	124,7	26.09.2027	706	5,51
ТенгизШевройл											
TENGIZ 4 2026	USD	4,00%	107,97	108,85	2,36	2,19	127,2	132,1	15.09.2026	1 000	4,45

Таблица 3. Информация по узбекским еврооблигациям

Выпуск	Валюта	Купон	Цена		Доходность		Спред		Дата погашения	Объем бумаг в обращении, млн.	Дюрация
			Покупка	Продажа	Покупка	Продажа	Z-Sprd	G-Sprd			
Республика Узбекистан											
UZBEK 4,75 2024	USD	4,75%	106,33	107,06	2,32	2,05	169,53	178,11	20.02.2024	500	2,51
UZBEK 5,375 2029	USD	5,38%	111,68	112,51	3,62	3,51	225,42	218,32	20.02.2029	500	6,29
UZBEK 3,7 2030	USD	3,70%	99,07	99,92	3,82	3,71	226,36	219,41	25.11.2030	555	7,91
НБ Республики Узбекистан											
NBUZB 4,85 2025	USD	4,85%	104,25	105,13	3,78	3,57	290,43	296,25	21.10.2025	300	3,90
Узпромстройбанк											
SQBNZU 5,75 2024	USD	5,75%	105,43	106,78	4,06	3,66	314,40	322,07	02.12.2024	300	3,15
Ипотека Банк											
IPTBZU 5,5 2025	USD	5,50%	104,65	105,58	4,34	4,11	339,38	344,57	19.11.2025	300	3,92

Кривая доходности ГЦБ

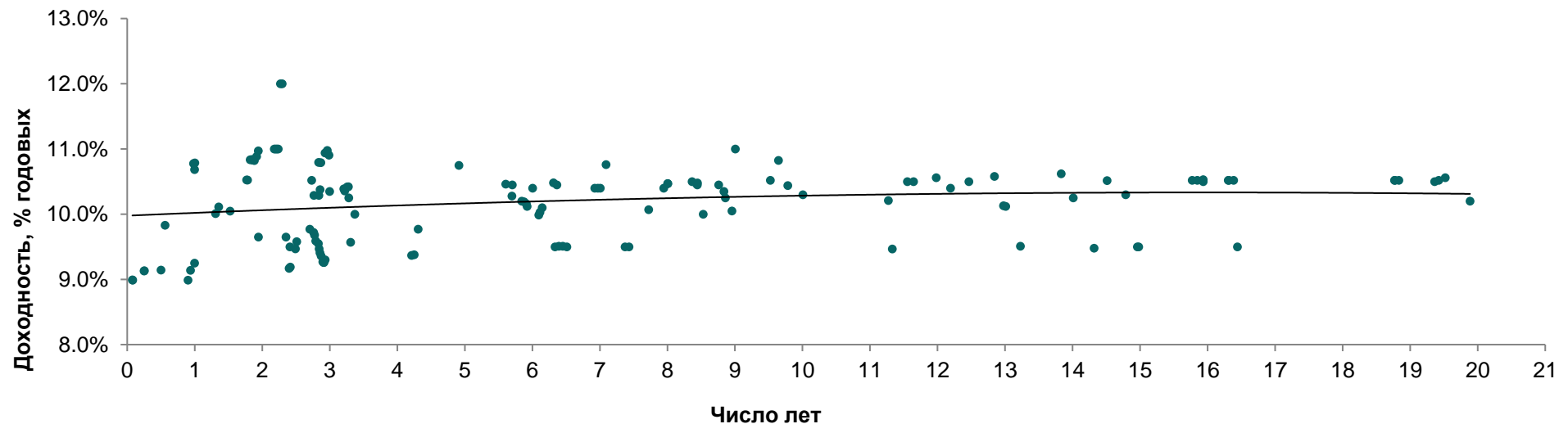


Таблица 4. Последние размещения нот и ГЦБ

Эмитент	Тикер	Доходность	Лет до погашения	Дата размещения	Дней прошло с размещения
Краткосрочные ноты					
Национальный Банк РК	NTK028_2716	8,99%	0,08	17-май-2021	3
Национальный Банк РК	NTK029_2703	8,99%	0,08	22-февр.-2021	87
Национальный Банк РК	NTK091_2713	9,13%	0,25	14-апр.-2021	36
Национальный Банк РК	NTK092_2717	9,13%	0,25	4-май-2021	16
Национальный Банк РК	NTK182_2715	9,14%	0,50	19-май-2021	1
Национальный Банк РК	NTK364_2651	10,69%	1,00	17-июнь-2020	337
Ценные бумаги Министерства Финансов					
Министерство Финансов	MUM072_0013	10,40%	6	19-май-2021	1
Министерство Финансов	MUM084_0017	9,77%	2,7	18-май-2021	2
Министерство Финансов	MUM144_0003	9,65%	1,94	17-май-2021	3
Министерство Финансов	MUM168_0005	10,62%	13,83	14-май-2021	6
Министерство Финансов	MUM084_0018	10,40%	6,92	12-май-2021	8
Министерство Финансов	MUM180_0012	10,45%	8,76	5-май-2021	15
Министерство Финансов	MUM120_0017	10,20%	5,84	4-май-2021	16
Министерство Финансов	MUM084_0017	9,72%	2,76	28-апр.-2021	6
Министерство Финансов	MUM084_0018	10,40%	6,97	26-апр.-2021	8

Ежедневный обзор

8 июня 2021 г.

Эмитент	Тикер	Доходность	Лет до погашения	Дата размещения	Дней прошло с размещения
Министерство Финансов	MUM084_0017	9,68%	2,77	23-апр.-2021	11
Министерство Финансов	MUM120_0017	10,19%	5,88	21-апр.-2021	13
Министерство Финансов	MUM156_0007	10,58%	12,84	19-апр.-2021	15
Министерство Финансов	MUM084_0017	9,59%	2,79	16-апр.-2021	18
Министерство Финансов	MUM180_0013	10,56%	11,98	14-апр.-2021	20
Министерство Финансов	MUM084_0018	10,40%	7,01	12-апр.-2021	22
Министерство Финансов	MUM120_0017	10,16%	5,91	9-апр.-2021	25
Министерство Финансов	MUM180_0012	10,35%	8,84	7-апр.-2021	27
Министерство Финансов	MUM120_0017	10,12%	5,92	5-апр.-2021	29
Министерство Финансов	MUM084_0017	9,55%	2,83	2-апр.-2021	32
Министерство Финансов	MUM180_0012	10,25%	8,86	30-мар.2021	35
Министерство Финансов	MUM084_0017	9,47%	2,84	29-мар.2021	36
Министерство Финансов	MUM132_0003	9,25%	1	26-мар.2021	39
Министерство Финансов	MUM084_0017	9,41%	2,85	25-мар.2021	40
Министерство Финансов	MUM084_0017	9,36%	2,87	18-мар.2021	47
Министерство Финансов	MUM120_0019	10,30%	10,01	17-мар.2021	48
Министерство Финансов	MUM120_0016	9,37%	4,21	12-мар.2021	53
Министерство Финансов	MUM168_0005	10,25%	14,01	10-мар.2021	55
Министерство Финансов	MUM084_0017	9,27%	2,9	09-мар.2021	56
Министерство Финансов	MUM084_0017	9,26%	2,91	05-мар.2021	60
Министерство Финансов	MUM084_0017	9,26%	2,91	03-мар.2021	62
Министерство Финансов	MUM156_0007	10,13%	12,98	01-мар.2021	64
Министерство Финансов	MKM012_0149	8,99%	0,9	26-февр.2021	67
Министерство Финансов	MUM120_0016	9,38%	4,25	26-февр.2021	67
Министерство Финансов	MUM156_0002	9,17%	2,4	25-февр.2021	68
Министерство Финансов	MUM084_0017	9,30%	2,93	24-февр.2021	69
Министерство Финансов	MUM180_0012	10,05%	8,95	23-февр.2021	70
Министерство Финансов	MUM156_0002	9,19%	2,41	19-февр.2021	74
Министерство Финансов	MUM156_0007	10,12%	13,01	17-февр.2021	76
Министерство Финансов	MKM012_0149	9,14%	0,94	12-февр.2021	81
Министерство Финансов	MUM096_0011	10,07%	7,72	8-февр.2021	85
Министерство Финансов	MUM120_0016	9,77%	4,31	5-февр.2021	88
Министерство Финансов	MUM180_0011	10,00%	8,53	3-февр.2021	90
Министерство Финансов	MUM120_0017	9,99%	6,09	1-февр.2021	92
Министерство Финансов	MUM180_0001	9,57%	3,31	29-январ.2021	95
Министерство Финансов	MUM156_0002	9,47%	2,49	29-январ.2021	95
Министерство Финансов	MUM180_0013	10,40%	12,19	27-январ.2021	97
Министерство Финансов	MUM120_0017	10,03%	6,11	25-январ.2021	99
Министерство Финансов	MUM156_0002	9,58%	2,51	22-январ.2021	102
Министерство Финансов	MUM240_0001	10,21%	11,27	18-январ.2021	106

Ежедневный обзор

8 июня 2021 г.

Эмитент	Тикер	Доходность	Лет до погашения	Дата размещения	Дней прошло с размещения
Министерство Финансов	MUM120_0017	10,10%	6,15	13-январь.2021	111
Министерство Финансов	MUM180_0001	10,00%	3,37	6-январь.2021	118
Министерство Финансов	MUM120_0011	10,01%	1,31	27-ноябрь.2020	158
Министерство Финансов	MUM108_0012	10,46%	5,61	25-ноябрь.2020	160
Министерство Финансов	MUM108_0011	10,29%	2,76	23-ноябрь.2020	162
Министерство Финансов	MUM108_0013	10,50%	8,36	20-ноябрь.2020	165
Министерство Финансов	MUM096_0011	10,40%	7,95	18-ноябрь.2020	167
Министерство Финансов	MUM084_0017	10,39%	3,21	16-ноябрь.2020	169
Министерство Финансов	MUM120_0017	10,48%	6,31	13-ноябрь.2020	172
Министерство Финансов	MUM084_0017	10,36%	3,22	11-ноябрь.2020	174
Министерство Финансов	MUM120_0011	10,11%	1,35	10-ноябрь.2020	175
Министерство Финансов	MUM084_0017	10,42%	3,26	28-октябрь.2020	188
Министерство Финансов	MUM108_0013	10,47%	8,43	28-октябрь.2020	188
Министерство Финансов	MUM096_0011	10,47%	8	28-октябрь.2020	188
Министерство Финансов	MUM216_0002	10,52%	16,3	27-октябрь.2020	189
Министерство Финансов	MUM108_0011	10,29%	2,84	27-октябрь.2020	189
Министерство Финансов	MUM096_0011	10,47%	8,01	27-октябрь.2020	189
Министерство Финансов	MUM216_0001	10,52%	15,77	26-октябрь.2020	190
Министерство Финансов	MUM120_0017	10,45%	6,36	26-октябрь.2020	190
Министерство Финансов	MUM144_0001	10,05%	1,52	26-октябрь.2020	190
Министерство Финансов	MKM012_0148	9,83%	0,56	23-октябрь.2020	193
Министерство Финансов	MUM216_0002	10,52%	16,32	23-октябрь.2020	193
Министерство Финансов	MUM108_0012	10,28%	5,7	23-октябрь.2020	193
Министерство Финансов	MUM300_0002	10,52%	18,77	22-октябрь.2020	194
Министерство Финансов	MUM108_0013	10,48%	8,44	22-октябрь.2020	194
Министерство Финансов	MUM084_0017	10,42%	3,27	22-октябрь.2020	194
Министерство Финансов	MUM300_0003	10,50%	19,36	21-октябрь.2020	195
Министерство Финансов	MUM108_0012	10,45%	5,7	21-октябрь.2020	195
Министерство Финансов	MUM108_0011	10,38%	2,85	21-октябрь.2020	195
Министерство Финансов	MUM300_0002	10,52%	18,77	20-октябрь.2020	196
Министерство Финансов	MUM180_0013	10,50%	12,46	20-октябрь.2020	196
Министерство Финансов	MUM084_0017	10,25%	3,28	20-октябрь.2020	196
Министерство Финансов	MUM300_0003	10,52%	19,42	29-сентябрь.2020	217
Министерство Финансов	MUM300_0002	10,52%	18,83	29-сентябрь.2020	217
Министерство Финансов	MUM168_0003	10,50%	11,55	29-сентябрь.2020	217
Министерство Финансов	MUM216_0002	10,52%	16,38	28-сентябрь.2020	218
Министерство Финансов	MUM216_0001	10,52%	15,85	28-сентябрь.2020	218
Министерство Финансов	MUM216_0001	10,50%	15,93	27-август.2020	250
Министерство Финансов	MUM168_0003	10,50%	11,64	27-август.2020	250
Министерство Финансов	MUM216_0001	10,53%	15,93	27-август.2020	250

Ежедневный обзор

8 июня 2021 г.

Эмитент	Тикер	Доходность	Лет до погашения	Дата размещения	Дней прошло с размещения
Министерство Финансов	MUM300_0003	10,56%	19,52	25-авг.2020	252
Министерство Финансов	MUM108_0013	10,45%	8,44	25-авг.2020	252
Министерство Финансов	MUM240_0004	10,52%	14,51	30-июл.2020	278
Министерство Финансов	MUM180_0014	10,52%	2,73	30-июл.2020	278
Министерство Финансов	MUM180_0012	10,52%	9,52	30-июл.2020	278
Министерство Финансов	MUM144_0001	10,53%	1,77	29-июл.2020	279
Министерство Финансов	MUM144_0001	10,53%	1,78	24-июл.2020	284
Министерство Финансов	MUM132_0005	10,80%	2,83	15-июл.2020	293
Министерство Финансов	MUM144_0001	10,84%	1,82	10-июл.2020	298
Министерство Финансов	MUM132_0005	10,79%	2,87	03-июл.2020	305
Министерство Финансов	MUM144_0001	10,84%	1,84	01-июл.2020	307
Министерство Финансов	MUM120_0016	10,75%	4,91	29-июн.2020	309
Министерство Финансов	MUM144_0001	10,83%	1,86	26-июн.2020	312
Министерство Финансов	MUM144_0001	10,82%	1,88	17-июн.2020	321
Министерство Финансов	MUM180_0012	10,82%	9,64	16-июн.2020	322
Министерство Финансов	MUM132_0005	10,94%	2,93	10-июн.2020	328
Министерство Финансов	MUM144_0001	10,89%	1,92	05-июн.2020	333
Министерство Финансов	MUM120_0018	10,76%	7,09	01-июн.2020	337
Министерство Финансов	MUM132_0005	10,98%	2,96	29-май.2020	340
Министерство Финансов	MUM144_0001	10,97%	1,94	27-май.2020	342
Министерство Финансов	MKM012_0148	10,78%	0,98	22-май.2020	347
Министерство Финансов	MUM132_0005	10,91%	2,99	20-май.2020	349
Министерство Финансов	MKM012_0148	10,79%	1	15-май.2020	354
Министерство Финансов	MOM060_0051	11,00%	2,18	29-апр.2020	370
Министерство Финансов	MUM180_0012	10,44%	9,78	27-апр.2020	372
Министерство Финансов	MUM180_0014	10,35%	3	24-апр.2020	375
Министерство Финансов	MOM060_0051	11,00%	2,2	22-апр.2020	377
Министерство Финансов	MUM240_0004	10,30%	14,79	20-апр.2020	379
Министерство Финансов	MOM060_0051	11,00%	2,22	15-апр.2020	384
Министерство Финансов	MUM300_0003	10,20%	19,88	13-апр.2020	386
Министерство Финансов	MOM060_0051	11,00%	2,24	8-апр.2020	391

Таблица 5. Доля владения нот НБК нерезидентами, млрд. тенге

Дата	Доля владения нот НБК нерезидентами					
	Резиденты	Нерезиденты	Всего в обращении	Резиденты	Нерезиденты	Изменение (нерезиденты)
14.05.2021	2 583,91	512,37	3 096,28	83,5%	16,5%	56,68
06.05.2021	2 668,79	455,69	3 124,48	85,4%	14,6%	6,53
30.04.2021	3 036,14	449,16	3 485,31	87,1%	12,9%	48,61
23.04.2021	2 989,95	400,55	3 390,50	88,2%	11,8%	-104,03
16.04.2021	2 856,56	504,58	3 361,14	85,0%	15,0%	-32,78
09.04.2021	2 982,52	537,36	3 519,89	84,7%	15,3%	-9,34
02.04.2021	2 915,59	546,7	3 462,29	84,2%	15,8%	-18,26
26.03.2021	2 891,13	564,96	3 456,08	83,7%	16,3%	1,81
19.03.2021	3 103,20	563,15	3 666,17	84,6%	15,4%	39,58
12.03.2021	3 110,10	523,57	3 633,68	85,6%	14,4%	-32,05
05.03.2021	3 161,39	555,62	3 717,01	85,1%	14,9%	-44,62
26.02.2021	3 184,01	600,24	3 784,25	84,1%	15,9%	79,60
19.02.2021	3 157,94	520,64	3 678,58	85,8%	14,2%	14,79
12.02.2021	3 215,93	505,85	3 721,77	86,4%	13,6%	52,20
05.02.2021	3 265,40	453,65	3 719,05	87,8%	12,2%	65,81
29.01.2021	2 998,15	387,84	3 385,99	88,5%	11,5%	-11,49
22.01.2021	2 787,13	399,33	3 186,46	87,5%	12,5%	101,79
15.01.2021	2 710,42	297,54	3 007,96	90,1%	9,9%	-48,83
08.01.2021	2 421,39	346,37	2 767,76	87,5%	12,5%	-4,88
31.12.2020	2 703,94	351,25	3 055,19	88,5%	11,5%	34,55
25.12.2020	2 588,32	316,7	2 905,02	89,1%	10,9%	0,49
20.12.2020	2 549,40	316,21	2 865,61	89,0%	11,0%	-10,51
11.12.2020	2 448,78	326,72	2 775,50	88,2%	11,8%	32,94
04.12.2020	2 291,64	293,78	2 585,42	88,6%	11,4%	-0,85
27.11.2020	2 568,28	294,63	2 862,91	89,7%	10,3%	11,38
20.11.2020	2 593,11	283,25	2 876,36	90,2%	9,8%	112,19
13.11.2020	2 700,93	171,06	2 871,99	94,0%	6,0%	-27,84
06.11.2020	2 709,74	198,9	2 908,64	93,2%	6,8%	1,91
30.10.2020	2 718,02	196,99	2 915,01	93,2%	6,8%	14,21
23.10.2020	2 957,30	182,78	3 140,08	94,2%	5,8%	-15,65
16.10.2020	3 063,48	198,43	3 261,91	93,9%	6,1%	46,78
09.10.2020	3 128,26	151,65	3 279,91	95,4%	4,6%	9,60
02.10.2020	3 185,66	142,05	3 327,71	95,7%	4,3%	13,49
25.09.2020	3 172,00	128,56	3 300,56	96,1%	3,9%	

Источник: Национальный Банк РК

Подготовлено АО «Halyk Global Markets»

АО «Halyk Finance»

Департамент исследований

Станислав Чуев	Директор
Асан Курманбеков	Макроэкономика
Дмитрий Шейкин	Макроэкономика
Владислав Бенберин	Долговые инструменты
Мадина Метеркулова	Долевые инструменты
Алмас Альмаганбетов	Долевые инструменты

E-mail

s.chuyev@halykfinance.kz
a.kurmanbekov@halykfinance.kz
d.sheikin@halykfinance.kz
v.benberin@halykfinance.kz
m.meterkulova@halykfinance.kz
a.almaganbetov@halykfinance.kz

Bloomberg

HLFN

Thomson Reuters

Halyk Finance

Factset

Halyk Finance

Capital IQ

Halyk Finance

Адрес:

Halyk Finance
пр. Абая, 109 «В», 5 этаж
А05А1В4, Алматы, Республика Казахстан
Тел. +7 727 331 59 77
www.halykfinance.kz

Заявление об ограничении ответственности

Настоящая публикация носит исключительно информационный характер и не является предложением или попыткой со стороны АО «Halyk Finance» купить, продать или вступить в иную сделку в отношении каких-либо ценных бумаг и иных финансовых инструментов, на которые в настоящей публикации может содержаться ссылка, предоставить какие-либо инвестиционные рекомендации или услуги. Указанные предложения могут быть направлены исключительно в соответствии с требованиями применимого законодательства. Настоящая публикация основана на информации, которую мы считаем надежной, однако мы не утверждаем, что все приведенные сведения абсолютно точны. При этом, отмечаем, что прошлая доходность не является показателем доходности инвестиций в будущем. Мы не несем ответственности за использование клиентами информации, содержащейся в настоящей публикации, а также за сделки и операции с ценными бумагами и иными финансовыми инструментами, упоминающимися в ней. Мы не берем на себя обязательство регулярно обновлять информацию, которая содержится в настоящей публикации или исправлять возможные неточности. HF, его аффилированные и должностные лица, партнеры и сотрудники, в том числе лица, участвующие в подготовке и выпуске этого материала, оставляют за собой право участвовать в сделках в отношении упоминающихся в настоящей публикации ценных бумаг и иных финансовых инструментов. Также отмечаем, что на ценные бумаги и иные финансовые инструменты, рассматриваемые в настоящей публикации и номинированные в иностранной валюте, могут оказывать влияние обменные курсы валют. Изменение обменных курсов валют может вызвать снижение стоимости инвестиций в указанные активы. Следует иметь в виду, что инвестирование в Американские депозитарные расписки также подвержено риску изменения обменного курса валют, а инвестирование в казахстанские ценные бумаги и иные финансовые инструменты имеет значительный риск. В указанной связи, инвесторы до принятия решения об участии в сделках с ценными бумагами и иными финансовыми инструментами, рассматриваемыми в настоящей публикации, должны проводить собственное исследование относительно надежности эмитентов данных ценных бумаг и иных финансовых инструментов.

Настоящая информация не предназначена для публичного распространения и не может быть воспроизведена, передана или опубликована, целиком или по частям, без предварительного письменного разрешения АО «Halyk Finance».

© 2021, все права защищены.