



Ежедневный обзор

Снижение индексов

16 июня 2021 г.

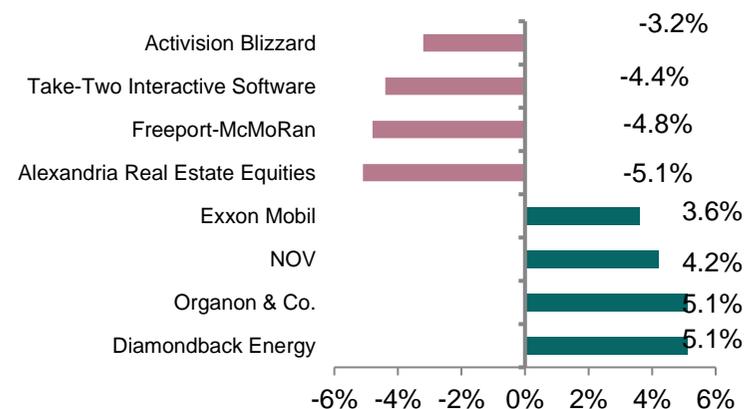
>> Снижение индексов

Ослабление сектора информационных технологий (-0,6%) отравило основные американские фондовые индексы вниз на 0,2-0,7%. Подъем нефтяных котировок до уровня в \$74 за баррель (впервые с апреля 2019 года) значительно усилил спрос на активы сектора энергетики (+2,1%). В составе лидеров индекса S&P 500 (-0,20%) оказались сразу несколько представителей энергетического сектора, а именно Diamondback Energy (+5,1%), NOV (+4,2%) и Exxon Mobil (+3,6%). Давление на рынок оказал выход умеренно негативной статистики, а также снижение торговой активности в преддверии объявления итогов двухдневного заседания ФРС США (15-16 июня).

>> Нефть штурмует максимумы

Нефть марки Brent впервые с апреля 2019 года поднялась до уровня в \$74 за баррель (+1,6%) и в настоящий момент продолжает позитивную динамику. Подъем нефтяных котировок продолжает подпитываться высокими ожиданиями восстановления спроса, который может произойти раньше запланированного срока.

Лидеры и аутсайдеры индекса S&P 500



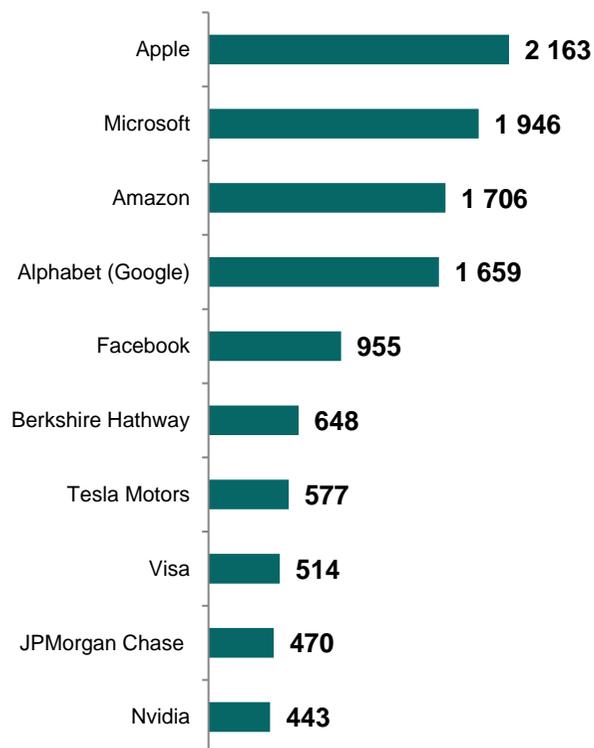
Товарный рынок

	Знач.	Изменение			
		1D	1W	1M	YTD
Brent	74,0	1,6%	2,5%	6,5%	42,8%
LME Copper	9 570	-4,0%	-4,0%	-6,6%	23,2%
Zinc	3 029	-0,5%	0,4%	3,1%	10,1%
Gold	1 852,36	-0,6%	-2,1%	-0,8%	-2,2%
Silver	27,5	-1,4%	-0,4%	-2,4%	4,4%
Natural Gas	3,2	-3,3%	3,6%	4,2%	27,6%
Aluminum	2 467	-1,1%	0,6%	0,2%	24,6%

Ежедневный обзор

16 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	-0,2%	-8,6	505	100%
Information Technology	-0,6%	-7,3	74	26,2%
Health Care	0,0%	-0,1	63	13,0%
Consumer Discretionary	-0,5%	-2,4	63	12,1%
Financials	0,2%	1,1	65	11,9%
Communication Services	-0,5%	-2,3	26	11,1%
Industrials	0,5%	1,8	74	8,9%
Consumer Staples	-0,3%	-0,7	32	6,0%
Materials	-0,2%	-0,2	28	2,8%
Energy	2,1%	2,5	23	2,8%
Utilities	0,4%	0,4	28	2,6%
Real Estate	-1,0%	-1,1	29	2,6%

Ежедневный обзор

16 июня 2021 г.

>> Снижение индексов

Ослабление сектора информационных технологий (-0,6%) отправило основные американские фондовые индексы вниз на 0,2-0,7%. Подъем нефтяных котировок до уровня в \$74 за баррель (впервые с апреля 2019 года) значительно усилил спрос на активы сектора энергетики (+2,1%). В составе лидеров индекса S&P 500 (-0,20%) оказались сразу несколько представителей энергетического сектора, а именно Diamondback Energy (+5,1%), NOV (+4,2%) и Exxon Mobil (+3,6%). Давление на рынок оказал выход умеренно негативной статистики, а также снижение торговой активности в преддверии объявления итогов двухдневного заседания ФРС США (15-16 июня).

>> Внутренняя статистика

Розничные продажи, занимающие порядка 2/3 от американского ВВП, в мае снизились на 1,3%. Сокращение показателя было ожидаемым, однако рынок предполагал снижение розничных продаж меньшими темпами на 0,7%.

В условиях открытия экономики и значительных трат в предшествующие месяцы американцы сократили покупки авто, мебели, электроники, строительных материалов и на прочие потребительские товары и увеличили расходы на услуги, которые не входят в структуру розничных продаж. Майские расходы на бары и рестораны выросли на 1,8% и превысили расходы до пандемии COVID-19.

Между тем подъем индекса цен производителей (PPI) в мае оказался самым высоким с момента начала отслеживания статистики (с ноября 2010 года) и составил 6,6% (Г-к-Г). Без учета продуктов питания и энергоносителей индекс цен производителей в мае увеличился на 5,3%, что стало максимумом с начала отслеживания статистики в августе 2014 года.

>> Ощутимое падение меди

Значительный рост стоимости товаров продолжает беспокоить крупнейшего потребителя товаров Китай. Накануне Поднебесная уже предпринимала меры по сдерживанию цен на товары и во вторник Китай нанес новый удар.

Фондовые индексы	Регион	Посл. знач.	Изменение	
			За день	С начала года
Americas				
S&P500	США	4 246,6	-0,20%	13,06%
Dow Jones	США	34 299,3	-0,27%	12,07%
NASDAQ	США	14 072,9	-0,71%	9,19%
EMEA				
Euro Stoxx 50	Евросоюз	4 143,5	0,26%	16,63%
FTSE 100	Великобритания	7 172,5	0,36%	11,02%
CAC 40	Франция	6 639,5	0,35%	19,60%
DAX	Германия	15 729,5	0,36%	14,66%
IBEX 35	Испания	9 230,7	-0,54%	14,33%
FTSE MIB	Италия	25 736,8	-0,08%	15,76%
Asia/Pacific				
Nikkei 225	Япония	29 350,5	-0,31%	6,95%
Hang Seng	Гонконг	28 599,6	-0,14%	5,03%
CSI 300	Китай	5 121,7	-0,87%	-1,72%
Shanghai	Китай	3 543,5	-0,37%	2,03%
Sensex	Китай	52 773,1	0,42%	10,52%
Singapore	Сингапур	3 157,6	-0,54%	11,03%
Emerging markets				
Bovespa	Бразилия	130 091,1	-0,09%	9,30%
RTSI\$	Россия	1 665,3	-1,31%	20,03%
NIFTY 50	Индия	15 869,3	0,36%	13,50%
TOP 40	ЮАР	61 061,8	-0,96%	12,29%
Borsa Index	Турция	1 454,3	-0,45%	-1,52%
KASE	Казахстан	3 343,5	-0,07%	24,96%

Ежедневный обзор

16 июня 2021 г.

Вчера стало известно, что Пекин рассматривает возможность открытия своих государственных резервов металлов (медь, алюминий, цинк) с целью снижения цен на эти товары.

На этом фоне медь подешевела на 4,0% до \$9 570 за тонну. В ответ на снижение стоимости базового актива бумаги медных производителей показали ощутимую динамику падения. Так, Freeport-McMoRan ослаб на 4,8%, Southern Copper Corporation снизился на 4,0%.

>> Валютный рынок

- Индекс доллара США (DXY), показывающий отношение доллара относительно корзины из шести мировых валют, сохранился на уровне 90,5.
- Российский рубль к доллару США ослаб на 0,1% до 72,2.
- Курс тенге к доллару США сохранился на уровне 427,1.

>> Главные новости

- Инфляция в Казахстане может сформироваться выше целевого диапазона на 0,4-0,5 п.п. – Нацбанк
- Дефицит республиканского бюджета за 3 месяца увеличился в 3,5 раза – Нацбанк

LIBOR (USD)

	Знач.	Значение на дату			
		1D	1W	1M	YTD
LIBOR Overnight	0,06%	0,06%	0,06%	0,06%	0,08%
LIBOR1M	0,07%	0,07%	0,08%	0,10%	0,14%
LIBOR3M	0,12%	0,12%	0,12%	0,16%	0,24%
LIBOR6M	0,15%	0,15%	0,16%	0,19%	0,26%
LIBOR12M	0,24%	0,24%	0,24%	0,26%	0,34%

Валютный рынок

	Знач.	Изменение валютных пар			
		1D	1W	1M	YTD
DXY	90,5	0,0%	0,5%	0,4%	0,7%
USD/KZT	427,1	0,0%	0,0%	0,3%	-1,4%
USD/RUB	72,2	-0,1%	0,1%	2,1%	3,0%
EUR/USD	1,21	0,0%	-0,4%	-0,3%	-0,8%
GBP/USD	1,41	-0,2%	-0,5%	-0,4%	3,1%
USD/JPY	110,11	-0,1%	-0,6%	-0,9%	-6,6%

Долговой рынок

	Валюта	YTM	YTM на			
			1D	1W	1M	YTD
US Treasuries (10YR)	US\$	1,49%	1,49%	1,53%	1,65%	0,91%
US Treasuries (30YR)	US\$	2,19%	2,18%	2,22%	2,36%	1,64%
UK Gilts (30YR)	GBP	0,74%	0,71%	0,81%	0,86%	0,20%
Germany (10YR)	EUR	-0,25%	-0,27%	-0,20%	-0,13%	-0,57%
Russia (10YR)	RUB	7,10%	7,06%	7,22%	7,07%	5,89%
Kazakhstan (5YR)	US\$	0,95%	0,98%	0,98%	0,99%	0,88%

- **Инфляция в Казахстане может сформироваться выше целевого диапазона на 0,4-0,5 п.п. – Нацбанк**

Инфляция в Казахстане может сформироваться к концу 2021 года выше целевого диапазона Национального банка в 4-6% на 0,4-0,5 процентных пункта, говорится в июньском докладе о денежно-кредитной политике регулятора.

Как отмечается в документе, согласно прогнозам Нацбанка, инфляция в 2021 году продолжит постепенно замедляться.

"Тем не менее, с учетом произошедшего значительного скачка цен на ГСМ, роста цен на электроэнергию, более сильного фискального стимулирования и повышенных инфляционных ожиданий инфляция к концу 2021 года может сформироваться выше целевого диапазона на 0,4-0,5 п.п.", - говорится в докладе.

Нацбанк ожидает дальнейшее замедление продовольственной инфляции, что во многом будет связано с выходом из расчетов высоких значений 2020 года и возвращением месячных темпов роста цен на продовольствие к умеренным значениям.

Источник: Интерфакс-Казахстан, Bloomberg

- **Дефицит республиканского бюджета за 3 месяца увеличился в 3,5 раза – Нацбанк**

Дефицит республиканского бюджета в I квартале 2021 года увеличился в 3,5 раза и составил 957,2 млрд тенге, доходы сократились на 5,1% до 2,6 трлн тенге, а затраты бюджета увеличившись на 20,1% до 3,4 трлн тенге, в докладе Нацбанка о денежно-кредитной политике за июнь 2021 года.

"В первом квартале 2021 года дефицит республиканского бюджета составил 957,2 млрд тенге, увеличившись в 3,5 раза по сравнению с соответствующим периодом 2020 года. Расширение дефицита бюджета, в первую очередь, обусловлено существенным ростом затрат (на 20,1%) при сокращении доходов (на 5,1%) в годовом выражении", - говорится в докладе.

Поясняется, что в апреле 2021 года произошло уточнение республиканского бюджета и расширение его доходной части за счет увеличения целевого трансферта из Национального фонда до 1,85 трлн тенге. Так, по данным Нацбанка за январь-март 2021 года в доходную часть официальных трансфертов поступило 1,201 трлн тенге, из которых гарантированный трансферт составил 802 млрд тенге, целевой трансферт – 276 млрд тенге, трансферты из нижестоящих органов государственного управления - 124 млрд тенге.

Источник: Интерфакс-Казахстан, Bloomberg

Ежедневный обзор

16 июня 2021 г.

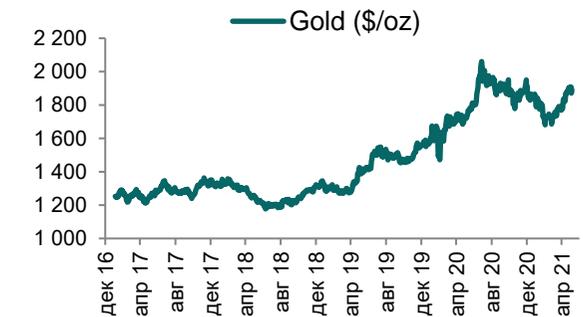
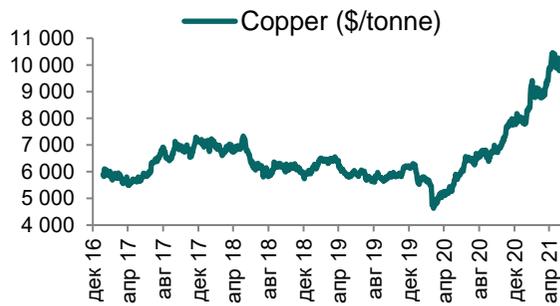
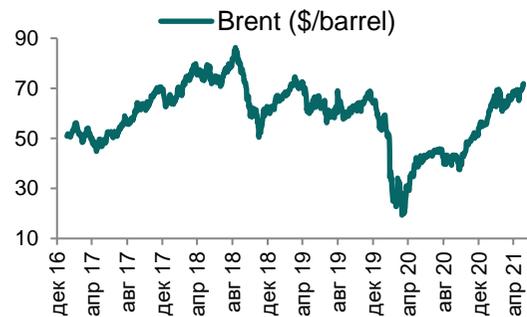
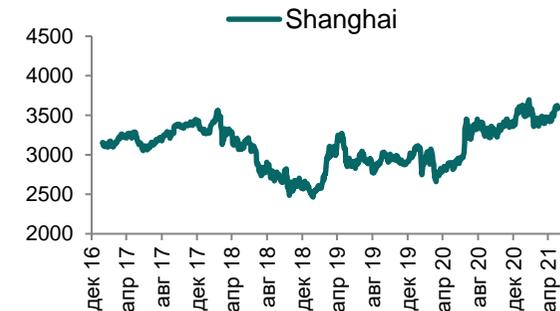
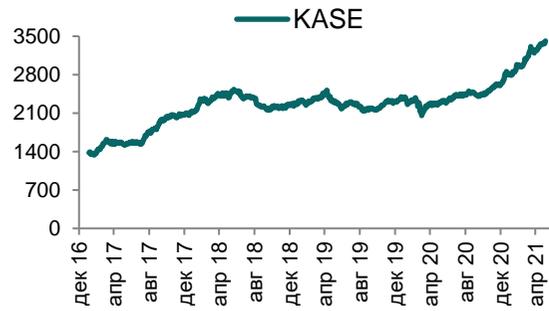
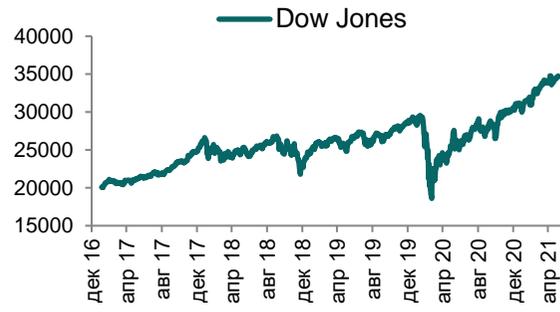
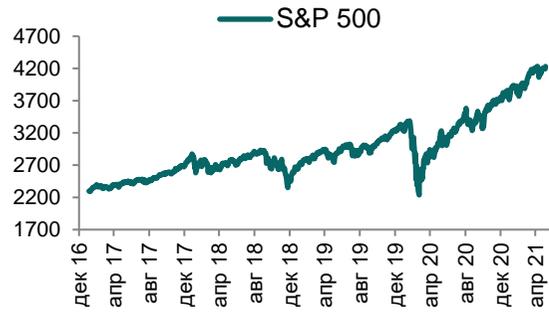
Таблица 1. Динамика изменения валют стран СНГ, развивающихся и развитых стран

Валютная пара (индекс)	Страна	Базовая ставка	Инфляция 2020	Доля в товарообороте*	Курс	1D	1W	1M	YTD
USD/RUB	Россия	5,50%	3,4%	19,3%	72,2	-0,1%	0,1%	2,1%	3,0%
USD/GEL	Грузия	8,25%	5,3%	-	3,2	1,3%	-0,1%	6,9%	4,0%
USD/BYN	Беларусь	8,50%	6,0%	0,7%	2,49	0,0%	0,5%	1,8%	5,6%
USD/KGS	Кыргызстан	5,50%	7,9%	0,9%	84,58	0,1%	-0,1%	1,8%	-0,6%
USD/TJS	Таджикистан	11,00%	8,8%	0,9%	11,31	0,0%	0,0%	0,0%	-0,1%
USD/UZS	Узбекистан	14,00%	11,1%	2,9%	10 603,17	0,0%	-0,4%	-0,4%	-1,3%
USD/UAH	Украина	7,50%	2,7%	1,0%	27,05	-1,8%	0,2%	1,8%	4,5%
Развивающиеся страны									
USD/CNY	Китай	4,35%	2,6%	15,5%	6,41	-0,1%	-0,1%	0,5%	1,9%
USD/BRL	Бразилия	3,50%	3,2%	0,0%	5,05	0,3%	0,3%	4,1%	2,9%
USD/INR	Индия	4,00%	6,9%	4,2%	73,31	-0,1%	-0,5%	-0,1%	-0,3%
USD/ZAR	ЮАР	3,50%	3,3%	-	13,80	-0,3%	-1,6%	2,1%	5,9%
USD/TRY	Турция	19,00%	12,3%	3,9%	8,56	-1,8%	0,7%	-2,9%	-15,1%
Развитые страны									
DXY	США	0,25%	1,2%	2,2%	90,54	0,0%	0,5%	0,4%	0,7%
USD/CAD	Канада	0,25%	0,7%	0,3%	1,22	-0,5%	-0,7%	-1,1%	4,4%
GBP/USD	Великобритания	0,10%	0,9%	0,7%	1,41	-0,2%	-0,5%	-0,4%	3,1%
USD/CHF	Швейцария	-0,75%	-0,7%	2,6%	0,90	0,1%	-0,2%	0,3%	-1,5%
USD/JPY	Япония	-0,10%	0,0%	2,0%	110,11	-0,1%	-0,6%	-0,9%	-6,6%
USD/KRW	Южная Корея	0,50%	0,7%	2,9%	1 117,00	0,0%	-0,3%	1,0%	-2,8%

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

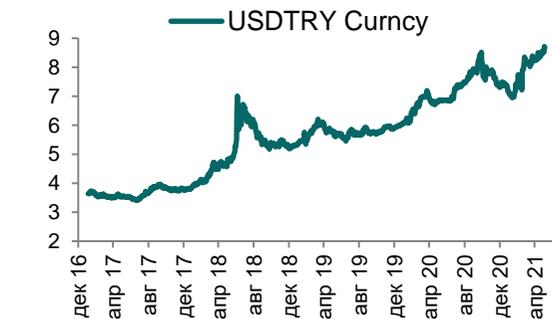
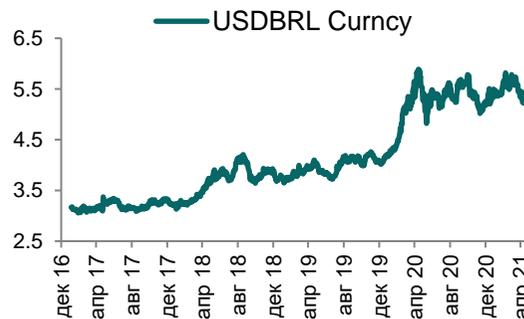
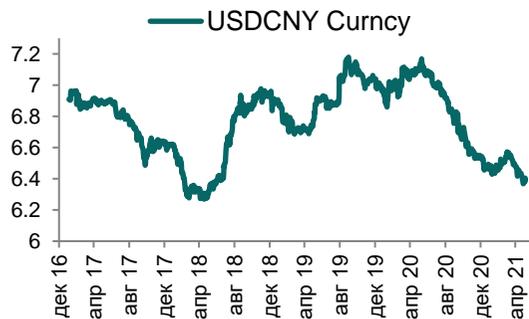
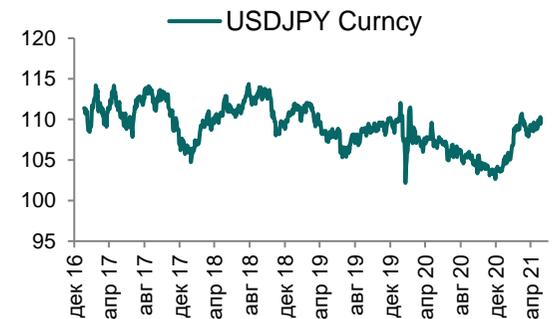
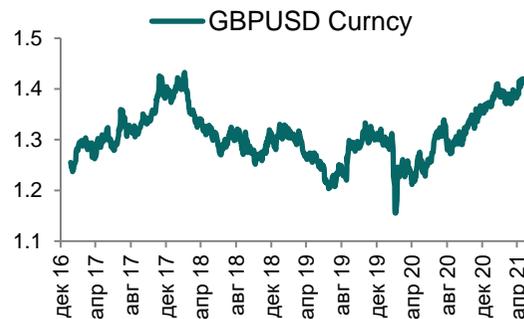
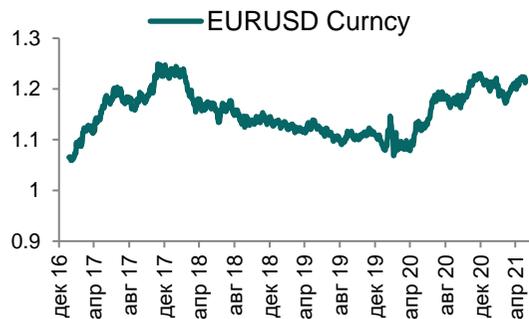
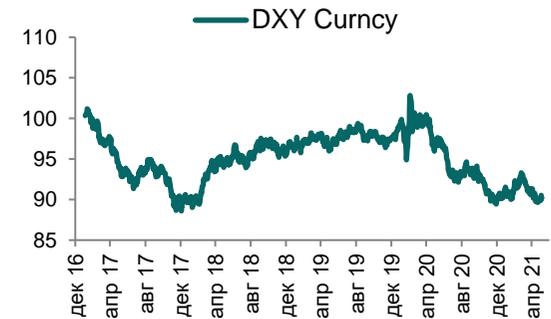
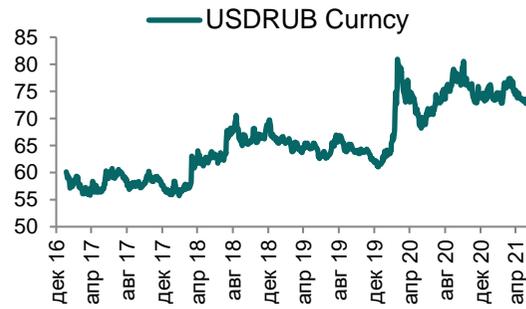
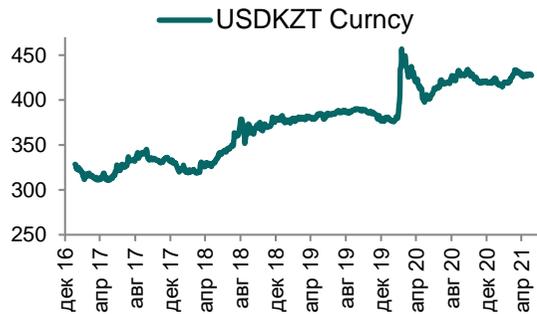
Ежедневный обзор

16 июня 2021 г.



Ежедневный обзор

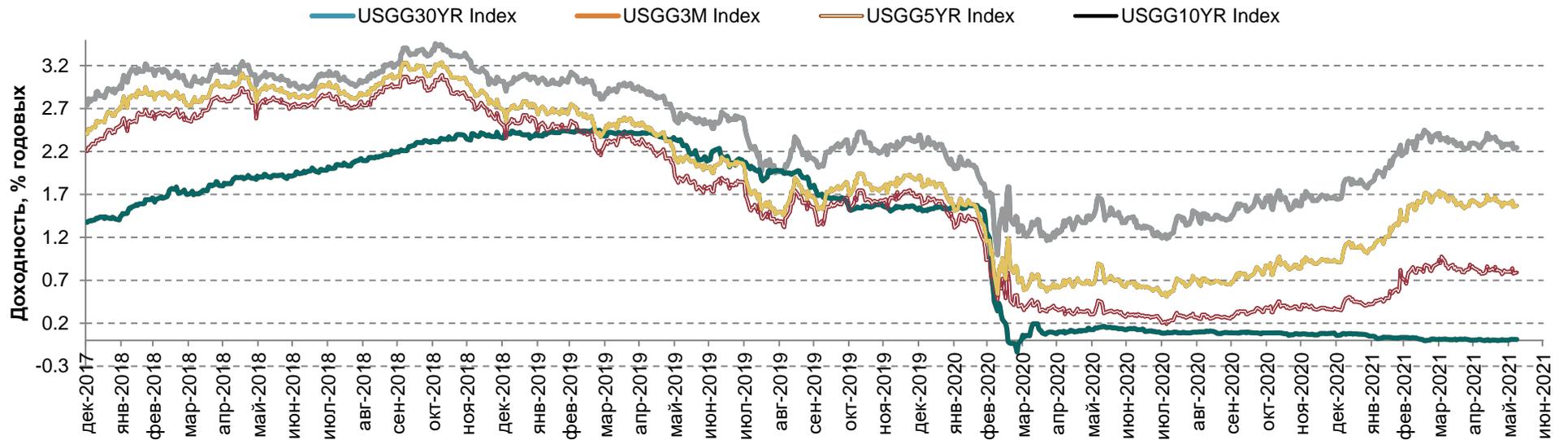
16 июня 2021 г.



Ежедневный обзор

16 июня 2021 г.

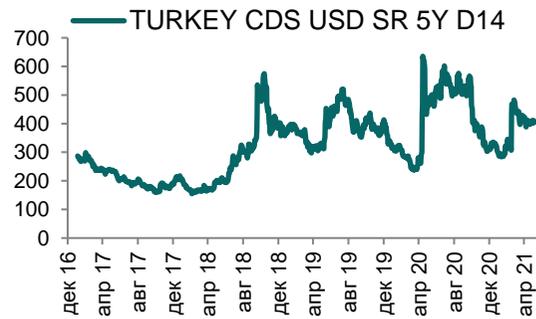
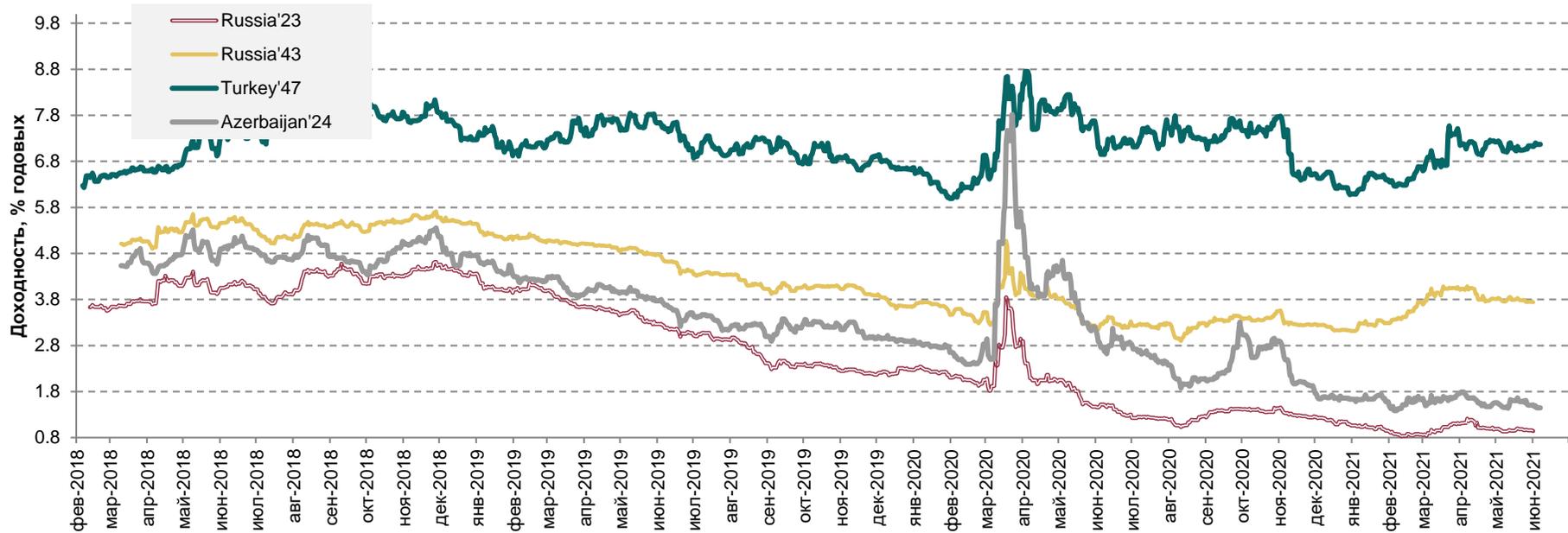
Доходность государственных ценных бумаг США



Динамика доходностей суверенных облигаций РК



Динамика доходностей суверенных еврооблигаций России, Турции и Азербайджана



Ежедневный обзор

16 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	6,1485%	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

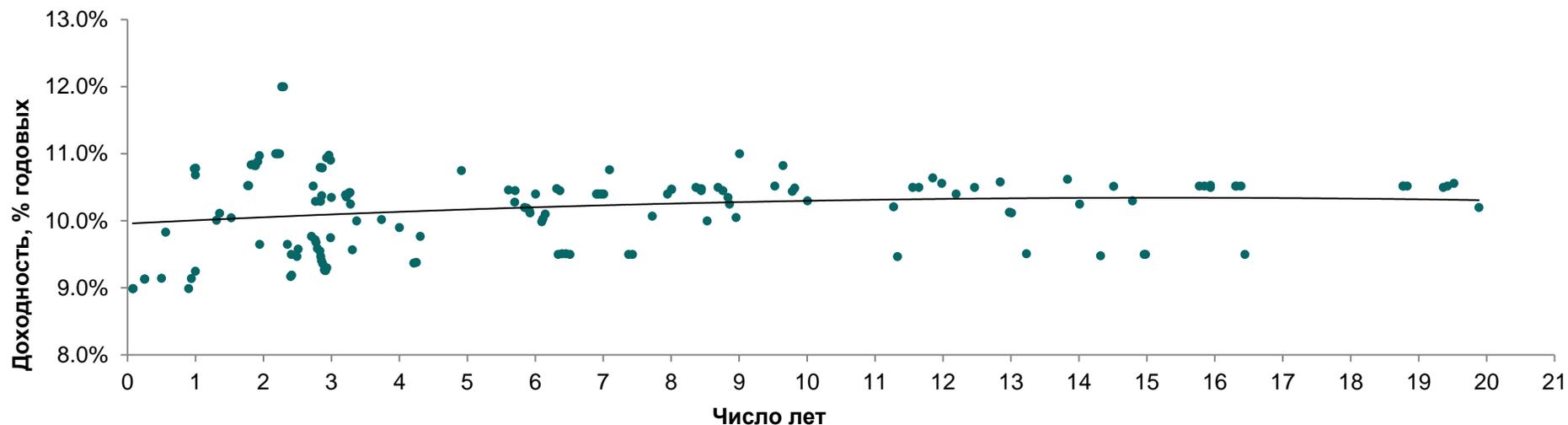


Таблица 4. Последние размещения нот и ГЦБ

Эмитент	Тикер	Доходность	Лет до погашения	Дата размещения
Краткосрочные ноты				
Национальный Банк РК	NTK028_2722	8,99%	0,08	31-май-2021
Национальный Банк РК	NTK029_2703	8,99%	0,08	22-февр.-2021
Национальный Банк РК	NTK091_2713	9,13%	0,25	14-апр.-2021
Национальный Банк РК	NTK092_2717	9,13%	0,25	4-май-2021
Национальный Банк РК	NTK182_2720	9,14%	0,50	19-май-2021
Национальный Банк РК	NTK364_2651	10,69%	1,00	17-июнь-2020
Ценные бумаги Министерства Финансов				
Министерство Финансов	MUM120_0016	10,02%	3,7	4-июнь-2021
Министерство Финансов	MUM180_0013	10,64%	11,8	2-июнь-2021
Министерство Финансов	MUM180_0012	10,50%	8,7	31-май-2021
Министерство Финансов	MUM120_0016	9,90%	4,0	28-май-2021
Министерство Финансов	MUM180_0001	9,75%	3,0	26-май-2021
Министерство Финансов	MUM120_0019	10,49%	9,8	25-май-2021
Министерство Финансов	MUM084_0018	10,40%	6,9	21-май-2021
Министерство Финансов	MUM072_0013	10,40%	6	19-май-2021
Министерство Финансов	MUM084_0017	9,77%	2,7	18-май-2021
Министерство Финансов	MUM144_0003	9,65%	1,94	17-май-2021

Ежедневный обзор

16 июня 2021 г.

Эмитент	Тикер	Доходность	Лет до погашения	Дата размещения
Министерство Финансов	MUM168_0005	10,62%	13,83	14-май-2021
Министерство Финансов	MUM084_0018	10,40%	6,92	12-май-2021
Министерство Финансов	MUM180_0012	10,45%	8,76	5-май-2021
Министерство Финансов	MUM120_0017	10,20%	5,84	4-май-2021
Министерство Финансов	MUM084_0017	9,72%	2,76	28-апр.-2021
Министерство Финансов	MUM084_0018	10,40%	6,97	26-апр.-2021
Министерство Финансов	MUM084_0017	9,68%	2,77	23-апр.-2021
Министерство Финансов	MUM120_0017	10,19%	5,88	21-апр.-2021
Министерство Финансов	MUM156_0007	10,58%	12,84	19-апр.-2021
Министерство Финансов	MUM084_0017	9,59%	2,79	16-апр.-2021
Министерство Финансов	MUM180_0013	10,56%	11,98	14-апр.-2021
Министерство Финансов	MUM084_0018	10,40%	7,01	12-апр.-2021
Министерство Финансов	MUM120_0017	10,16%	5,91	9-апр.-2021
Министерство Финансов	MUM180_0012	10,35%	8,84	7-апр.-2021
Министерство Финансов	MUM120_0017	10,12%	5,92	5-апр.-2021
Министерство Финансов	MUM084_0017	9,55%	2,83	2-апр.-2021
Министерство Финансов	MUM180_0012	10,25%	8,86	30-мар.2021
Министерство Финансов	MUM084_0017	9,47%	2,84	29-мар.2021
Министерство Финансов	MUM132_0003	9,25%	1	26-мар.2021
Министерство Финансов	MUM084_0017	9,41%	2,85	25-мар.2021
Министерство Финансов	MUM084_0017	9,36%	2,87	18-мар.2021
Министерство Финансов	MUM120_0019	10,30%	10,01	17-мар.2021
Министерство Финансов	MUM120_0016	9,37%	4,21	12-мар.2021
Министерство Финансов	MUM168_0005	10,25%	14,01	10-мар.2021
Министерство Финансов	MUM084_0017	9,27%	2,9	09-мар.2021
Министерство Финансов	MUM084_0017	9,26%	2,91	05-мар.2021
Министерство Финансов	MUM084_0017	9,26%	2,91	03-мар.2021
Министерство Финансов	MUM156_0007	10,13%	12,98	01-мар.2021
Министерство Финансов	MKM012_0149	8,99%	0,9	26-февр.2021
Министерство Финансов	MUM120_0016	9,38%	4,25	26-февр.2021
Министерство Финансов	MUM156_0002	9,17%	2,4	25-февр.2021
Министерство Финансов	MUM084_0017	9,30%	2,93	24-февр.2021
Министерство Финансов	MUM180_0012	10,05%	8,95	23-февр.2021
Министерство Финансов	MUM156_0002	9,19%	2,41	19-февр.2021
Министерство Финансов	MUM156_0007	10,12%	13,01	17-февр.2021
Министерство Финансов	MKM012_0149	9,14%	0,94	12-февр.2021
Министерство Финансов	MUM096_0011	10,07%	7,72	8-февр.2021
Министерство Финансов	MUM120_0016	9,77%	4,31	5-февр.2021
Министерство Финансов	MUM180_0011	10,00%	8,53	3-февр.2021
Министерство Финансов	MUM120_0017	9,99%	6,09	1-февр.2021
Министерство Финансов	MUM180_0001	9,57%	3,31	29-январ.2021

Ежедневный обзор

16 июня 2021 г.

Эмитент	Тикер	Доходность	Лет до погашения	Дата размещения
Министерство Финансов	MUM156_0002	9,47%	2,49	29-январь.2021
Министерство Финансов	MUM180_0013	10,40%	12,19	27-январь.2021
Министерство Финансов	MUM120_0017	10,03%	6,11	25-январь.2021
Министерство Финансов	MUM156_0002	9,58%	2,51	22-январь.2021
Министерство Финансов	MUM240_0001	10,21%	11,27	18-январь.2021
Министерство Финансов	MUM120_0017	10,10%	6,15	13-январь.2021
Министерство Финансов	MUM180_0001	10,00%	3,37	6-январь.2021
Министерство Финансов	MUM120_0011	10,01%	1,31	27-ноябрь.2020
Министерство Финансов	MUM108_0012	10,46%	5,61	25-ноябрь.2020
Министерство Финансов	MUM108_0011	10,29%	2,76	23-ноябрь.2020
Министерство Финансов	MUM108_0013	10,50%	8,36	20-ноябрь.2020
Министерство Финансов	MUM096_0011	10,40%	7,95	18-ноябрь.2020
Министерство Финансов	MUM084_0017	10,39%	3,21	16-ноябрь.2020
Министерство Финансов	MUM120_0017	10,48%	6,31	13-ноябрь.2020
Министерство Финансов	MUM084_0017	10,36%	3,22	11-ноябрь.2020
Министерство Финансов	MUM120_0011	10,11%	1,35	10-ноябрь.2020
Министерство Финансов	MUM084_0017	10,42%	3,26	28-октябрь.2020
Министерство Финансов	MUM108_0013	10,47%	8,43	28-октябрь.2020
Министерство Финансов	MUM096_0011	10,47%	8	28-октябрь.2020
Министерство Финансов	MUM216_0002	10,52%	16,3	27-октябрь.2020
Министерство Финансов	MUM108_0011	10,29%	2,84	27-октябрь.2020
Министерство Финансов	MUM096_0011	10,47%	8,01	27-октябрь.2020
Министерство Финансов	MUM216_0001	10,52%	15,77	26-октябрь.2020
Министерство Финансов	MUM120_0017	10,45%	6,36	26-октябрь.2020
Министерство Финансов	MUM144_0001	10,05%	1,52	26-октябрь.2020
Министерство Финансов	MKM012_0148	9,83%	0,56	23-октябрь.2020
Министерство Финансов	MUM216_0002	10,52%	16,32	23-октябрь.2020
Министерство Финансов	MUM108_0012	10,28%	5,7	23-октябрь.2020
Министерство Финансов	MUM300_0002	10,52%	18,77	22-октябрь.2020
Министерство Финансов	MUM108_0013	10,48%	8,44	22-октябрь.2020
Министерство Финансов	MUM084_0017	10,42%	3,27	22-октябрь.2020
Министерство Финансов	MUM300_0003	10,50%	19,36	21-октябрь.2020
Министерство Финансов	MUM108_0012	10,45%	5,7	21-октябрь.2020
Министерство Финансов	MUM108_0011	10,38%	2,85	21-октябрь.2020
Министерство Финансов	MUM300_0002	10,52%	18,77	20-октябрь.2020
Министерство Финансов	MUM180_0013	10,50%	12,46	20-октябрь.2020
Министерство Финансов	MUM084_0017	10,25%	3,28	20-октябрь.2020
Министерство Финансов	MUM300_0003	10,52%	19,42	29-сентябрь.2020
Министерство Финансов	MUM300_0002	10,52%	18,83	29-сентябрь.2020
Министерство Финансов	MUM168_0003	10,50%	11,55	29-сентябрь.2020
Министерство Финансов	MUM216_0002	10,52%	16,38	28-сентябрь.2020

Ежедневный обзор

16 июня 2021 г.

Эмитент	Тикер	Доходность	Лет до погашения	Дата размещения
Министерство Финансов	MUM216_0001	10,52%	15,85	28-сент.2020
Министерство Финансов	MUM216_0001	10,50%	15,93	27-авг.2020
Министерство Финансов	MUM168_0003	10,50%	11,64	27-авг.2020
Министерство Финансов	MUM216_0001	10,53%	15,93	27-авг.2020
Министерство Финансов	MUM300_0003	10,56%	19,52	25-авг.2020
Министерство Финансов	MUM108_0013	10,45%	8,44	25-авг.2020
Министерство Финансов	MUM240_0004	10,52%	14,51	30-июл.2020
Министерство Финансов	MUM180_0014	10,52%	2,73	30-июл.2020
Министерство Финансов	MUM180_0012	10,52%	9,52	30-июл.2020
Министерство Финансов	MUM144_0001	10,53%	1,77	29-июл.2020
Министерство Финансов	MUM144_0001	10,53%	1,78	24-июл.2020
Министерство Финансов	MUM132_0005	10,80%	2,83	15-июл.2020
Министерство Финансов	MUM144_0001	10,84%	1,82	10-июл.2020
Министерство Финансов	MUM132_0005	10,79%	2,87	03-июл.2020
Министерство Финансов	MUM144_0001	10,84%	1,84	01-июл.2020
Министерство Финансов	MUM120_0016	10,75%	4,91	29-июн.2020
Министерство Финансов	MUM144_0001	10,83%	1,86	26-июн.2020
Министерство Финансов	MUM144_0001	10,82%	1,88	17-июн.2020
Министерство Финансов	MUM180_0012	10,82%	9,64	16-июн.2020
Министерство Финансов	MUM132_0005	10,94%	2,93	10-июн.2020
Министерство Финансов	MUM144_0001	10,89%	1,92	05-июн.2020
Министерство Финансов	MUM120_0018	10,76%	7,09	01-июн.2020
Министерство Финансов	MUM132_0005	10,98%	2,96	29-май.2020
Министерство Финансов	MUM144_0001	10,97%	1,94	27-май.2020
Министерство Финансов	MKM012_0148	10,78%	0,98	22-май.2020
Министерство Финансов	MUM132_0005	10,91%	2,99	20-май.2020
Министерство Финансов	MKM012_0148	10,79%	1	15-май.2020
Министерство Финансов	MOM060_0051	11,00%	2,18	29-апр.2020
Министерство Финансов	MUM180_0012	10,44%	9,78	27-апр.2020
Министерство Финансов	MUM180_0014	10,35%	3	24-апр.2020
Министерство Финансов	MOM060_0051	11,00%	2,2	22-апр.2020
Министерство Финансов	MUM240_0004	10,30%	14,79	20-апр.2020
Министерство Финансов	MOM060_0051	11,00%	2,22	15-апр.2020
Министерство Финансов	MUM300_0003	10,20%	19,88	13-апр.2020
Министерство Финансов	MOM060_0051	11,00%	2,24	8-апр.2020

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

Дата	Доля владения нот НБК нерезидентами					
	Резиденты	Нерезиденты	Всего в обращении	Резиденты	Нерезиденты	Изменение (нерезиденты)
04.06.2021	2 899,15	574,69	3 473,84	83,5%	16,5%	63,04
28.05.2021	2 733,50	511,65	3 245,15	84,2%	15,8%	-27,09
21.05.2021	2 667,30	538,74	3 206,04	83,2%	16,8%	26,37
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 Чувев

Директор

Дмитрий Шейкин

Заместитель Директора

Асан Курманбеков

Макроэкономика

Владислав Бенберин

Долговые инструменты

Мадина Метеркулова

Долевые инструменты

Алмас Альмаганбетов

Долевые инструменты

E-mail

s.chuyev@halykfinance.kz

d.sheikin@halykfinance.kz

a.kurmanbekov@halykfinance.kz

v.benberin@halykfinance.kz

m.meterkulova@halykfinance.kz

a.almaganbetov@halykfinance.kz

Адрес:

Halyk Finance

пр. Абая, 109 «В», 5 этаж

А05А1В4, Алматы, Республика Казахстан

Тел. +7 727 331 59 77

www.halykfinance.kz

Bloomberg

HLFN

Thomson Reuters

Halyk Finance

Factset

Halyk Finance

Capital IQ

Halyk Finance

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.