



Ежедневный обзор

Преимущественно негативная динамика рынка

18 июня 2021 г.

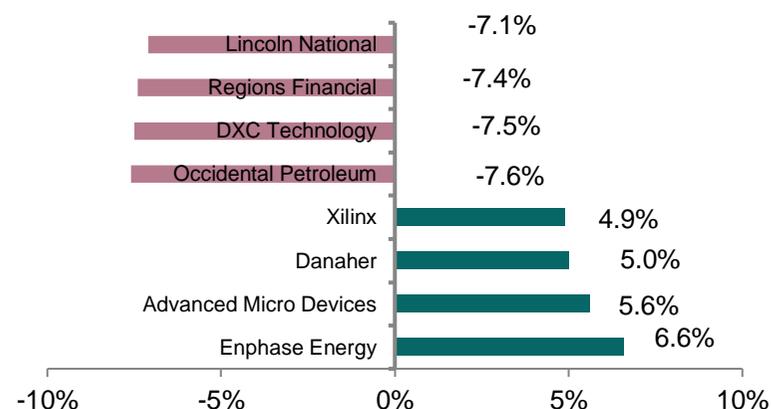
>> Преимущественно негативная динамика рынка

Рынок акций США продолжил переваривать резкую смену риторики в отношении монетарной политики американским регулятором. Планы более раннего поднятия ставки окрасили накануне рынки в красный цвет и привели к резкому росту доллара (DXY), который за неделю к корзине из шести мировых валют вырос на 2% до 91,9. Поддержку рынку сгладить потери помог сектор информационных технологий (+1,2%). Особенно стоит выделить подъем котировок IT-гигантов: Apple (+1,3%), Microsoft (+1,4%), Alphabet (+0,8%) и Facebook (+1,6%). На фоне резкого снижения доходностей по казначейским облигациям США финансовый сектор (-2,9%) вошел в число аутсайдеров рынка.

>> Резкое снижение нефтяных котировок

После семи дней подъема цены на нефть снизились на 1,8% до \$73,1 за баррель. Резкое укрепление доллара США оказали основное давление на нефть. В среду американский регулятор отметил готовностью дважды поднять ставку в 2023 году. Медианный прогноз участников FOMC по ставке в 2023 году составил 0,6% против 0,1% в марте.

Лидеры и аутсайдеры индекса S&P 500



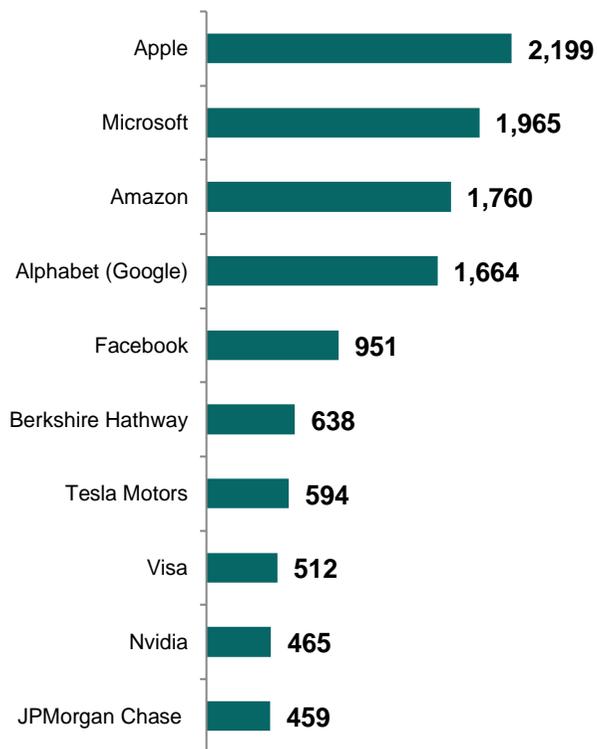
Товарный рынок

	Знач.	Изменение			
		1D	1W	1M	YTD
Brent	73,1	-1,8%	0,8%	9,6%	41,1%
LME Copper	9 316	-3,6%	-5,8%	-10,5%	20,0%
Zinc	2 912	-3,7%	-2,8%	-4,8%	5,8%
Gold	1 770,77	-4,8%	-6,5%	-5,9%	-6,5%
Silver	25,8	-6,7%	-7,5%	-7,7%	-2,0%
Natural Gas	3,3	0,1%	3,3%	9,8%	28,1%
Aluminum	2 400	-2,8%	-3,1%	-3,1%	21,2%

Ежедневный обзор

18 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	0,0%	-1,8	505	100%
Information Technology	1,2%	13,2	74	26,2%
Health Care	0,8%	4,3	63	13,0%
Consumer Discretionary	0,6%	3,1	63	12,1%
Financials	-2,9%	-14,4	65	11,9%
Communication Services	0,6%	2,7	26	11,1%
Industrials	-1,6%	-5,5	74	8,9%
Consumer Staples	0,4%	0,9	32	6,0%
Materials	-2,2%	-2,5	28	2,8%
Energy	-3,5%	-4,4	23	2,8%
Utilities	0,5%	5,3	28	2,6%
Real Estate	0,3%	0,4	29	2,6%

Ежедневный обзор

18 июня 2021 г.

➤ Преимущественно негативная динамика рынка

Рынок акций США продолжил переваривать резкую смену риторики в отношении монетарной политики американским регулятором. Планы более раннего поднятия ставки окрасили накануне рынки в красный цвет и привели к резкому росту доллара (DXY), который за неделю к корзине из шести мировых валют вырос на 2% до 91,9. Поддержку рынку сгладить потери помог сектор информационных технологий (+1,2%). Особенно стоит выделить подъем котировок IT-гигантов: Apple (+1,3%), Microsoft (+1,4%), Alphabet (+0,8%) и Facebook (+1,6%). На фоне резкого снижения доходностей по казначейским облигациям США финансовый сектор (-2,9%) вошел в число аутсайдеров рынка. Бумаги крупнейших американских банков в четверг продемонстрировали ощутимое снижение: Wells Fargo (-6,1%), Bank of America (-4,4%), Citigroup (-3,6%) и Morgan Stanley (-3,5%). Доходность по 10-летним бумагам опустилась сразу на 8 б.п. до 1,50%.

➤ Разгром на рынке металлов

Стремительный рост цен на металлы не мог долгое время оставаться незамеченным крупнейшим потребителем металлов Китаем. Пекин в недавнем прошлом неоднократно выражал озабоченность в отношении завышенных цен на товары и в среду китайское правительство объявило, что в скором времени начнет продавать металлы из государственных резервов.

Последний раз такой радикальный шаг по охлаждению цен был отмечен в 2010 году и нынешнее ралли по металлам заставило Поднебесную пойти на решительные меры. В результате этого медь ускорила снижение и подешевела в четверг на 3,6% до \$9 316 за тонну. Цинк снизился на 3,7% до \$2 912 за тонну, а алюминий потерял 2,8% до \$2 400 за тонну.

➤ Драгоценные металлы оказались под давлением

На фоне резкого укрепления доллара США и подтверждения опасений в отношении более раннего ужесточения денежно-кредитной политики в США цены на драгоценные металлы резко ушли вниз. Золото подешевело на 4,8% до \$1 770,8 за тройскую унцию. Серебро упало на 6,7% до \$25,8 за тройскую унцию.

Фондовые индексы	Регион	Посл. знач.	Изменение	
			За день	С начала года
Americas				
S&P500	США	4 221,9	-0,04%	12,40%
Dow Jones	США	33 823,5	-0,62%	10,51%
NASDAQ	США	14 161,4	0,87%	9,88%
EMEA				
Euro Stoxx 50	Еврозона	4 158,1	0,15%	17,04%
FTSE 100	Великобритания	7 153,4	-0,44%	10,73%
CAC 40	Франция	6 666,3	0,20%	20,08%
DAX	Германия	15 727,7	0,11%	14,64%
IBEX 35	Испания	9 195,9	-0,07%	13,90%
FTSE MIB	Италия	25 713,6	-0,21%	15,66%
Asia/Pacific				
Nikkei 225	Япония	29 108,0	0,31%	6,06%
Hang Seng	Гонконг	28 738,0	0,63%	5,53%
CSI 300	Китай	5 093,0	-0,17%	-2,27%
Shanghai	Китай	3 521,0	-0,13%	1,38%
Sensex	Китай	52 323,3	-0,34%	9,57%
Singapore	Сингапур	3 126,5	-0,38%	9,94%
Emerging markets				
Bovespa	Бразилия	128 057,2	-0,93%	7,60%
RTSI\$	Россия	1 664,4	-0,87%	19,96%
NIFTY 50	Индия	15 691,4	-0,48%	12,23%
TOP 40	ЮАР	60 399,9	-1,08%	11,07%
Borsa Index	Турция	1 431,3	-0,78%	-3,08%
KASE	Казахстан	3 357,9	0,14%	25,50%

Ежедневный обзор

18 июня 2021 г.

>> Валютный рынок

- Индекс доллара США (DXY), показывающий отношение доллара относительно корзины из шести мировых валют, вырос на 0,8% до 91,9.
- Российский рубль к доллару США вырос на 0,4% до 72,3.
- Курс тенге к доллару США снизился на 0,3% до 427,8.

>> Главные новости

- Президент Казахстана поручил рассмотреть возможность IPO КазТрансГаза в 2022г
- Газ должен занять не менее четверти энергобаланса Казахстана к 2030 году – Токаев

LIBOR (USD)

	Знач.	Значение на дату			
		1D	1W	1M	YTD
LIBOR Overnight	0,06%	0,06%	0,05%	0,06%	0,08%
LIBOR1M	0,08%	0,08%	0,07%	0,10%	0,14%
LIBOR3M	0,12%	0,12%	0,12%	0,15%	0,24%
LIBOR6M	0,15%	0,15%	0,16%	0,19%	0,26%
LIBOR12M	0,23%	0,23%	0,24%	0,26%	0,34%

Валютный рынок

	Знач.	Изменение валютных пар			
		1D	1W	1M	YTD
DXY	91,9	0,8%	2,0%	1,9%	2,2%
USD/KZT	427,8	-0,3%	-0,3%	-0,3%	-1,6%
USD/RUB	72,3	0,4%	-0,4%	1,8%	2,8%
EUR/USD	1,19	-1,8%	-2,3%	-2,6%	-2,7%
GBP/USD	1,39	-1,5%	-1,9%	-1,9%	1,8%
USD/JPY	110,31	-0,4%	-0,8%	-1,4%	-6,8%

Долговой рынок

	Валюта	YTM	YTM на			
			1D	1W	1M	YTD
US Treasuries (10YR)	US\$	1,50%	1,58%	1,43%	1,67%	0,91%
US Treasuries (30YR)	US\$	2,09%	2,21%	2,13%	2,37%	1,64%
UK Gilts (30YR)	GBP	0,74%	0,76%	0,73%	0,87%	0,20%
Germany (10YR)	EUR	-0,25%	-0,23%	-0,24%	-0,10%	-0,57%
Russia (10YR)	RUB	7,06%	7,10%	7,07%	7,01%	5,89%
Kazakhstan (5YR)	US\$	1,08%	0,98%	0,95%	1,01%	0,88%

- **Президент Казахстана поручил рассмотреть возможность IPO КазТрансГаза в 2022г**

Президент Казахстана Касым-Жомарт Токаев поручил правительству республики рассмотреть возможность проведения IPO "КазТрансГаза" в 2022 году.

"В случае успешной реализации концепции вертикально интегрированной газовой компании правительству совместно с "Самрук-Казына" предстоит изучить возможность проведения IPO "КазТрансГаз" уже в 2022 году, в том числе и через народное IPO", - сказал Токаев на совещании по вопросу развития газовой отрасли.

Высказывания президента приведены в сообщении, опубликованном на его сайте.

"Это существенно оживит финансовый рынок и даст возможность гражданам обладать частью газового достояния страны", - отметил президент. По словам Токаева, "КазТрансГаз" станет национальной газовой компанией и будет осуществлять деятельность по всей цепочке – от геологоразведки до реализации конечной продукции. Президент отметил, что считает предложение госфонда "Самрук-Казына" по передаче "КазТрансГазу" приоритетного права недропользования на новые месторождения правильным.

Источник: Интерфакс-Казахстан, Bloomberg

- **Газ должен занять не менее четверти энергобаланса Казахстана к 2030 году – Токаев**

Президент Казахстана Касым-Жомарт Токаев поручил к 2030 году увеличить объем газовой генерации в полтора раза - с 21 до 33 миллиардов киловатт-часов, сообщила в четверг пресс-служба главы государства по итогам совещания по вопросам развития газовой отрасли.

"Достижение нулевого баланса выбросов потребует структурных промышленных и экономических изменений. Поручаю к 2030 году увеличить объем газовой генерации в полтора раза - с 21 до 33 миллиардов киловатт-часов. Газ должен занять не менее четверти энергобаланса страны. Согласно моему поручению, к этому времени доля возобновляемых источников энергии должна составить 15 %. Таким образом, к концу текущего десятилетия почти половина электроэнергии в стране будет вырабатываться за счет более экологических источников", - сказал Токаев.

Источник: Интерфакс-Казахстан, Bloomberg

Ежедневный обзор

18 июня 2021 г.

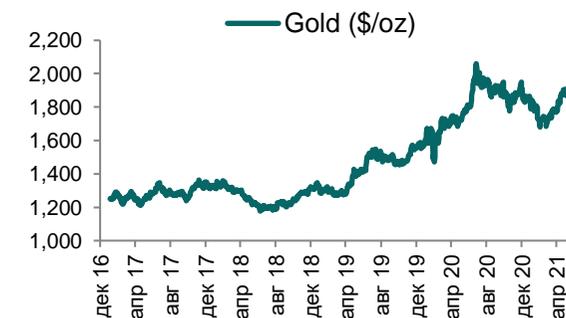
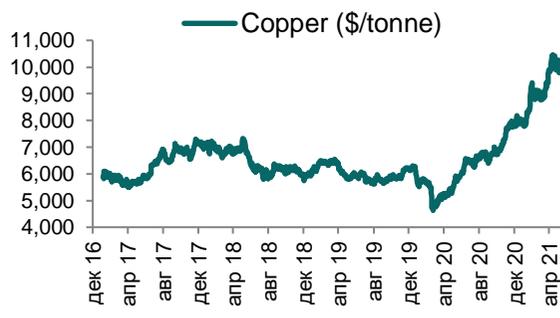
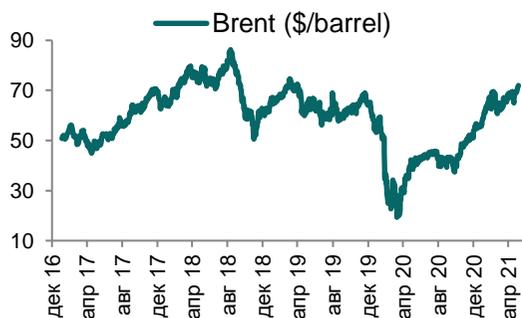
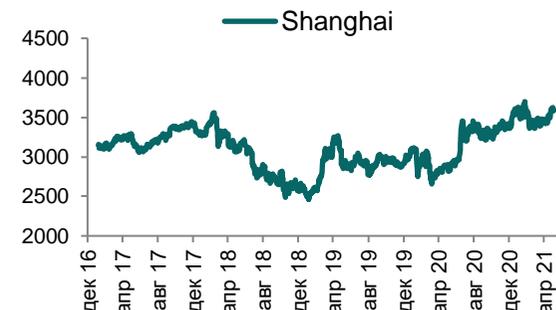
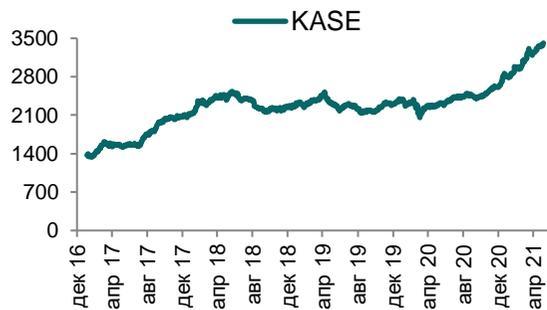
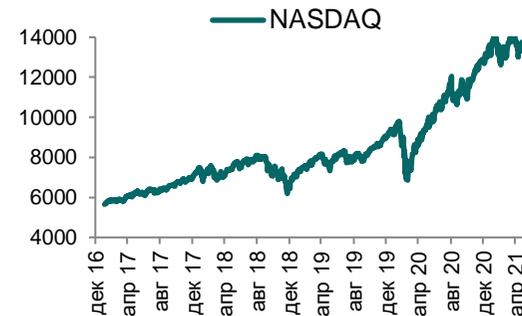
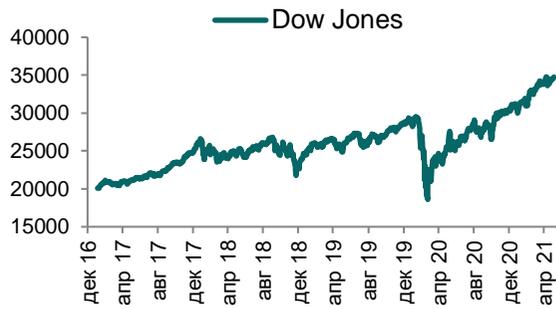
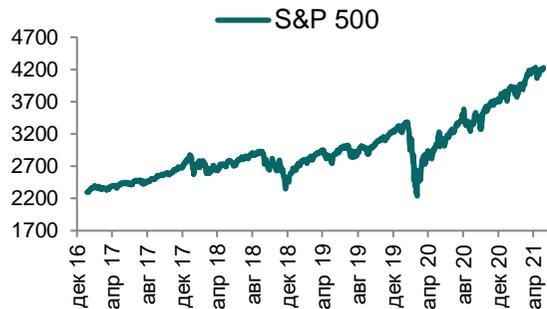
Таблица 1. Динамика изменения валют стран СНГ, развивающихся и развитых стран

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%	72,3	0,4%	-0,4%	1,8%	2,8%
USD/GEL	Грузия	8,25%	5,3%	-	3,2	-0,2%	1,2%	6,0%	3,8%
USD/BYN	Беларусь	8,50%	6,0%	0,7%	2,52	-1,0%	-1,6%	-0,3%	4,4%
USD/KGS	Кыргызстан	5,50%	7,9%	0,9%	84,55	0,0%	0,0%	-0,3%	-0,7%
USD/TJS	Таджикистан	11,00%	8,8%	0,9%	11,31	0,0%	0,0%	-0,1%	-0,1%
USD/UZS	Узбекистан	14,00%	11,1%	2,9%	10 603,14	0,0%	-0,1%	-0,3%	-1,3%
USD/UAH	Украина	7,50%	2,7%	1,0%	27,10	-0,2%	-0,5%	1,2%	4,3%
Развивающиеся страны									
USD/CNY	Китай	4,35%	2,6%	15,5%	6,45	-0,8%	-1,0%	-0,4%	1,2%
USD/BRL	Бразилия	3,50%	3,2%	0,0%	5,01	0,9%	2,1%	5,2%	3,7%
USD/INR	Индия	4,00%	6,9%	4,2%	74,08	-1,0%	-1,4%	-1,2%	-1,4%
USD/ZAR	ЮАР	3,50%	3,3%	-	14,14	-3,0%	-4,0%	-0,8%	3,6%
USD/TRY	Турция	19,00%	12,3%	3,9%	8,71	-2,4%	-3,4%	-3,9%	-17,2%
Развитые страны									
DXY	США	0,25%	1,2%	2,2%	91,89	0,8%	2,0%	1,9%	2,2%
USD/CAD	Канада	0,25%	0,7%	0,3%	1,24	-1,6%	-2,3%	-2,2%	3,2%
GBP/USD	Великобритания	0,10%	0,9%	0,7%	1,39	-1,5%	-1,9%	-1,9%	1,8%
USD/CHF	Швейцария	-0,75%	-0,7%	2,6%	0,92	-2,2%	-2,7%	-2,0%	-3,8%
USD/JPY	Япония	-0,10%	0,0%	2,0%	110,31	-0,4%	-0,8%	-1,4%	-6,8%
USD/KRW	Южная Корея	0,50%	0,7%	2,9%	1 130,35	-1,2%	-1,3%	0,0%	-4,1%

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

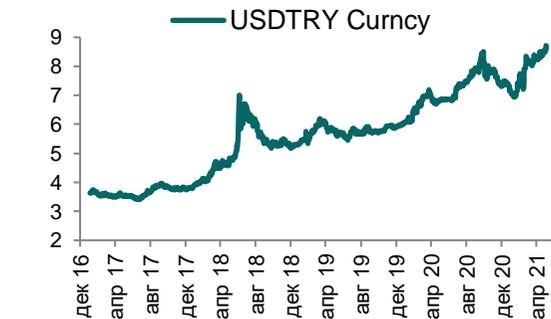
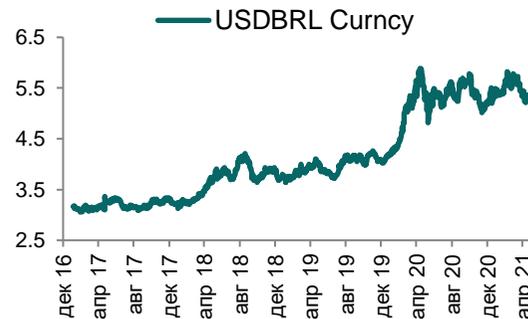
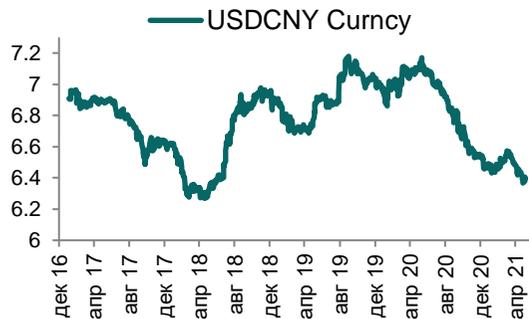
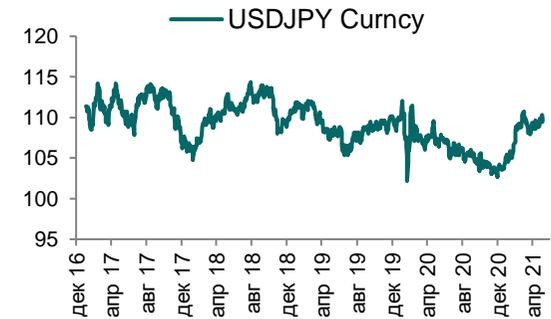
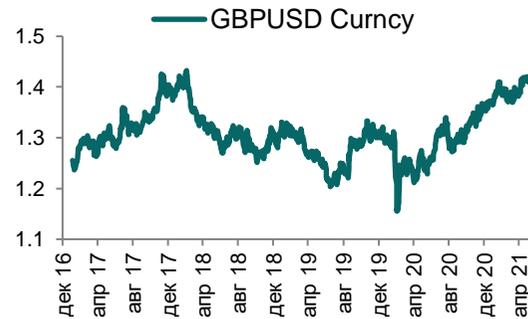
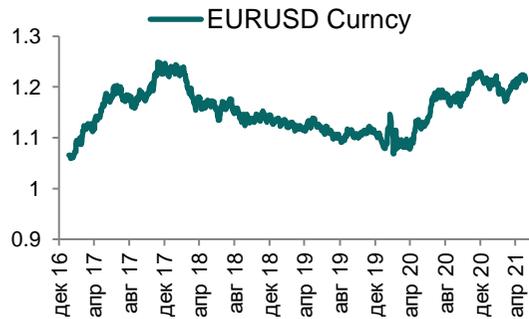
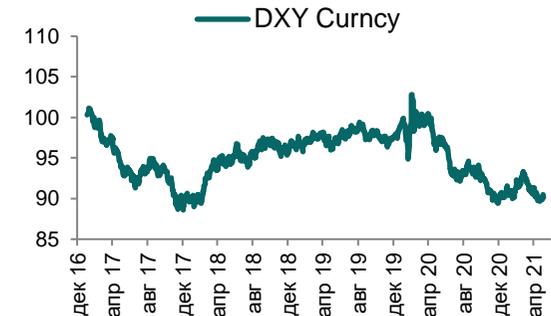
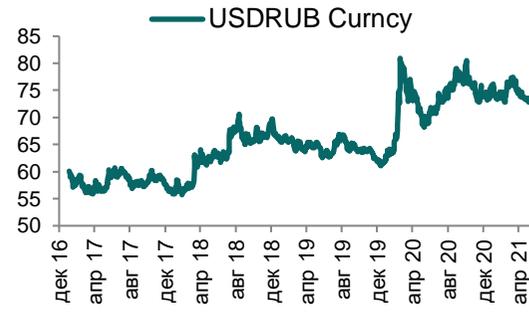
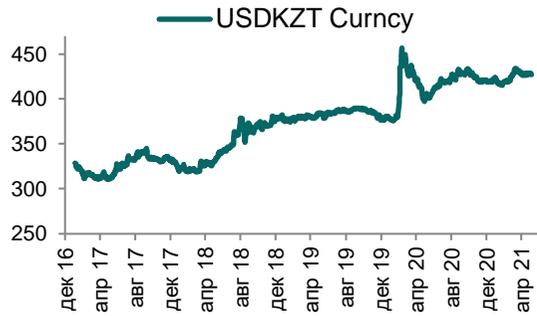
Ежедневный обзор

18 июня 2021 г.



Ежедневный обзор

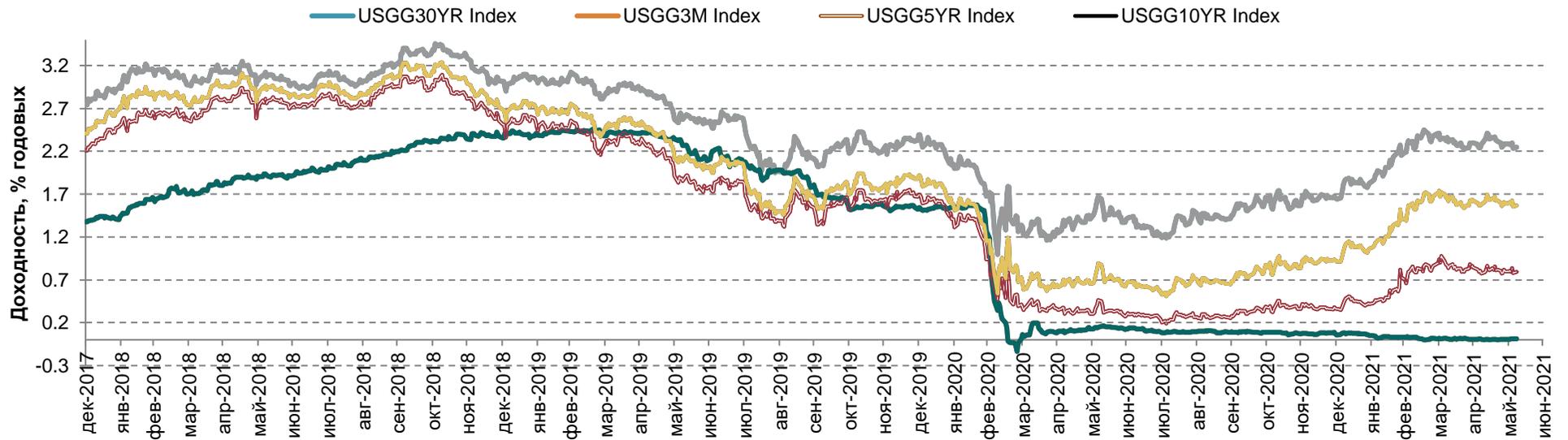
18 июня 2021 г.



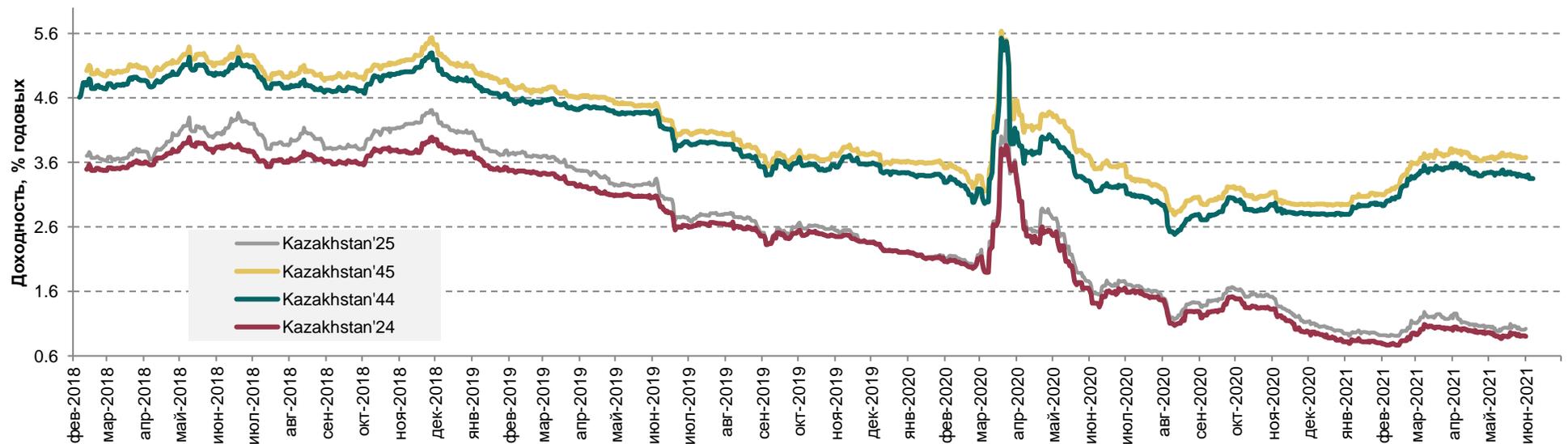
Ежедневный обзор

18 июня 2021 г.

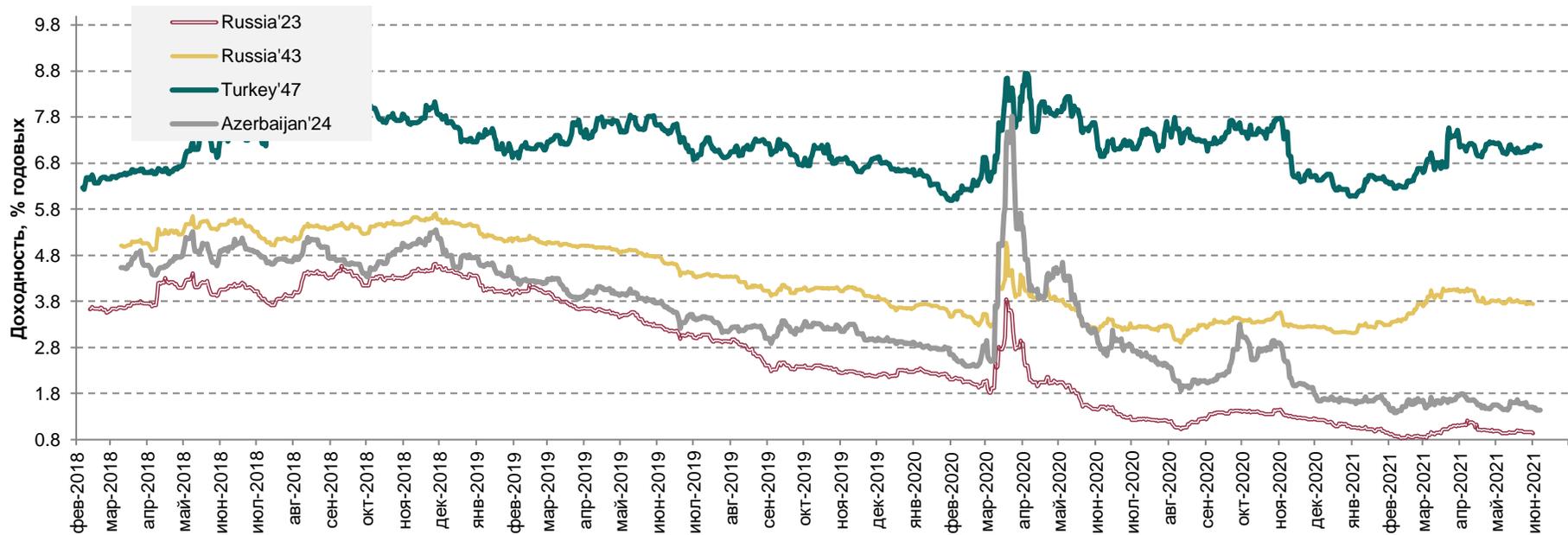
Доходность государственных ценных бумаг США



Динамика доходностей суверенных облигаций РК



Динамика доходностей суверенных еврооблигаций России, Турции и Азербайджана



Ежедневный обзор

18 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

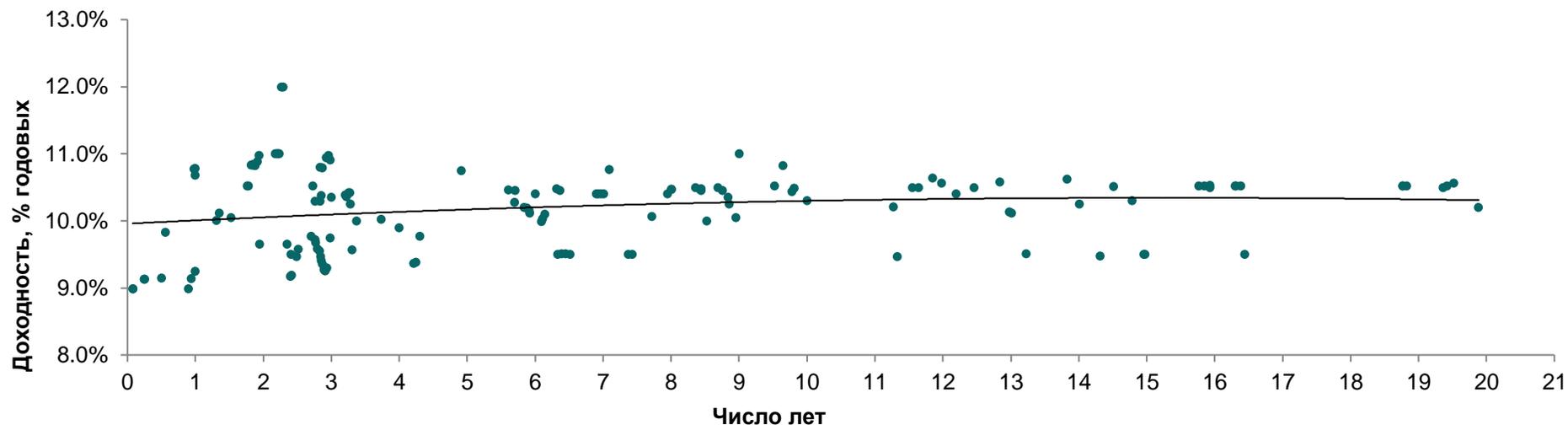


Таблица 4. Последние размещения нот и ГЦБ

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

18 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

18 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	MUM012_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

18 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

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.

Подготовлено АО «Halyk Global Markets»

АО «Halyk Finance»

Департамент исследований

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

E-mail

s.chuhev@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