



Ежедневный обзор

S&P 500 и NASDAQ обновили максимумы

25 июня 2021 г.

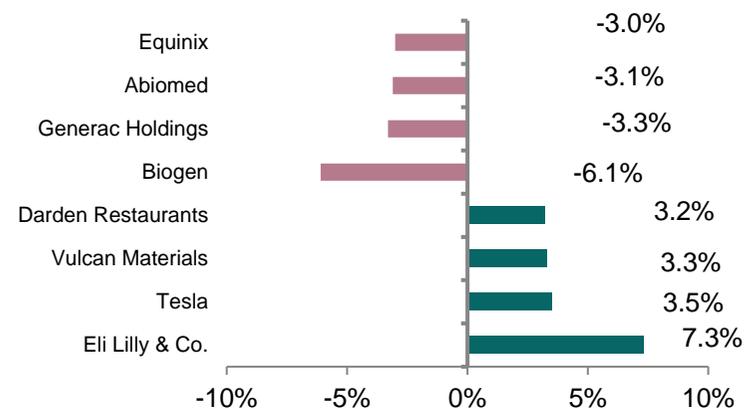
>> S&P 500 и NASDAQ обновили максимумы

Достижение межпартийного соглашения по инфраструктурному плану Байдена усилило покупательские настроения на рынке. Индексы S&P 500 (+0,58%) и NASDAQ (+0,69%) обновили абсолютные исторические максимумы, проигнорировав неоднозначную еженедельную статистику по рынку труда США. После ощутимой динамики снижения накануне финансовый сектор (+1,2%) продолжил восстановление, показав наибольший прирост среди всех отраслевых групп индекса S&P 500. В ответ на позитивные новости в отношении принятия соглашения по инфраструктурному плану бумаги промышленных предприятий ушли вверх.

>> Нефть продолжила подъем

Цены на нефть продолжили штурмовать максимумы. Нефть марки Brent выросла на 0,5% до \$75,6 за баррель на признаках более сильного, чем предполагалась прежде восстановления спроса на энергоносители.

Лидеры и аутсайдеры индекса S&P 500



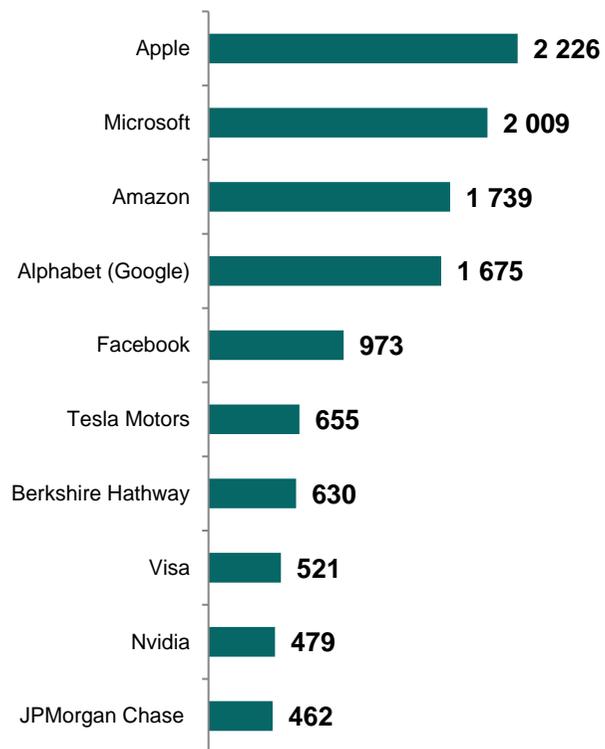
Товарный рынок

| | Знач. | Изменение | | | |
|-------------|----------|-----------|------|-------|-------|
| | | 1D | 1W | 1M | YTD |
| Brent | 75,6 | 0,5% | 3,4% | 9,7% | 45,9% |
| LME Copper | 9 419 | -0,7% | 1,1% | -5,0% | 21,3% |
| Zinc | 2 916 | 0,8% | 0,2% | -2,2% | 6,0% |
| Gold | 1 776,83 | -0,4% | 0,3% | -6,6% | -6,2% |
| Silver | 26,0 | -0,2% | 0,7% | -6,5% | -1,3% |
| Natural Gas | 3,4 | 2,6% | 5,1% | 14,5% | 34,6% |
| Aluminum | 2 440 | 0,0% | 1,7% | 2,9% | 23,3% |

Ежедневный обзор

25 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 | 0,6% | 24,6 | 505 | 100% |
| Information Technology | 0,6% | 7,4 | 74 | 26,2% |
| Health Care | 0,5% | 2,8 | 63 | 13,0% |
| Consumer Discretionary | 0,1% | 0,5 | 63 | 12,1% |
| Financials | 1,2% | 5,7 | 65 | 11,9% |
| Communication Services | 0,8% | 3,8 | 26 | 11,1% |
| Industrials | 0,7% | 2,5 | 74 | 8,9% |
| Consumer Staples | 0,3% | 0,8 | 32 | 6,0% |
| Materials | 0,3% | 0,3 | 28 | 2,8% |
| Energy | 0,9% | 1,1 | 23 | 2,8% |
| Utilities | -0,1% | -0,1 | 28 | 2,6% |
| Real Estate | -0,5% | -0,5 | 29 | 2,6% |

Ежедневный обзор

25 июня 2021 г.

>> S&P 500 и NASDAQ обновили максимумы

Достижение межпартийного соглашения по инфраструктурному плану Байдена усилило покупательские настроения на рынке. Индексы S&P 500 (+0,58%) и NASDAQ (+0,69%) обновили абсолютные исторические максимумы, проигнорировав неоднозначную еженедельную статистику по рынку труда США. После ощутимой динамики снижения накануне финансовый сектор (+1,2%) продолжил восстановление, показав наибольший прирост среди всех отраслевых групп индекса S&P 500. В ответ на позитивные новости в отношении принятия соглашения по инфраструктурному плану бумаги промышленных предприятий ушли вверх. Так, ведущий производитель сельскохозяйственной техники Caterpillar вырос на 2,6%, а производитель строительных агрегатов Vulcan Materials поднялся на 3,3%.

>> Детали плана

В общей сложности инфраструктурный план Байдена будет включать в себя поддержку на сумму \$973 млрд. за пять лет и \$1,2 трлн. за восемь лет.

К настоящему моменту известно, что \$312 млрд. будут направлены на транспорт, \$109 млрд. возьмут на себя расходы на модернизацию и создание дорог, мостов и других крупных инфраструктурных объектов, \$49 млрд. будет направлено на общественный транспорт.

Объем стимулов на нетранспортную инфраструктуру составит \$266 млрд., включая \$73 млрд. на электроэнергию, \$65 млрд. на широкополосную связь и \$55 млрд. на водоснабжение.

>> Неоднозначная статистика

До открытия рынка стало известно, что число первичных обращений за пособиями по безработице на прошлой неделе составило 411 тыс., что оказалось выше прогноза в 380 тыс., но немногим ниже прошлого результата в 412 тыс.

| Фондовые индексы | Регион | Посл. знач. | Изменение | |
|-------------------------|----------------|-------------|-----------|---------------|
| | | | За день | С начала года |
| Americas | | | | |
| S&P500 | США | 4 266,5 | 0,58% | 13,59% |
| Dow Jones | США | 34 196,8 | 0,95% | 11,73% |
| NASDAQ | США | 14 369,7 | 0,69% | 11,49% |
| EMEA | | | | |
| Euro Stoxx 50 | Еврозона | 4 122,4 | 1,14% | 16,04% |
| FTSE 100 | Великобритания | 7 110,0 | 0,51% | 10,05% |
| CAC 40 | Франция | 6 631,2 | 1,22% | 19,45% |
| DAX | Германия | 15 589,2 | 0,86% | 13,63% |
| IBEX 35 | Испания | 9 074,1 | 1,34% | 12,39% |
| FTSE MIB | Италия | 25 422,2 | 1,38% | 14,35% |
| Asia/Pacific | | | | |
| Nikkei 225 | Япония | 29 093,0 | 0,75% | 6,01% |
| Hang Seng | Гонконг | 29 106,2 | 0,77% | 6,89% |
| CSI 300 | Китай | 5 202,2 | 0,90% | -0,17% |
| Shanghai | Китай | 3 582,8 | 0,45% | 3,16% |
| Sensex | Китай | 52 699,0 | 0,75% | 10,36% |
| Singapore | Сингапур | 3 129,3 | 0,31% | 10,04% |
| Emerging markets | | | | |
| Bovespa | Бразилия | 129 513,6 | 0,85% | 8,82% |
| RTSI\$ | Россия | 1 664,9 | -0,08% | 20,00% |
| NIFTY 50 | Индия | 15 790,5 | 0,66% | 12,94% |
| TOP 40 | ЮАР | 60 188,4 | 0,71% | 10,68% |
| Borsa Index | Турция | 1 402,4 | -0,53% | -5,04% |
| KASE | Казахстан | 3 348,8 | 0,26% | 25,16% |

Ежедневный обзор

25 июня 2021 г.

>> Валютный рынок

- Индекс доллара США (DXY), показывающий отношение доллара относительно корзины из шести мировых валют, сохранился на уровне 91,8.
- Российский рубль к доллару США вырос на 0,4% до 72,3.
- Курс тенге к доллару США ослаб на 0,1% до 427,7.

>> Главные новости

- В столице Казахстана с 27 июня ужесточают карантин по COVID-19
- Capital Bank Kazakhstan лишен лицензии на проведение банковских операций и деятельности на рынке ценных бумаг

LIBOR (USD)

| | Знач. | Значение на дату | | | |
|------------------------|-------|------------------|-------|-------|-------|
| | | 1D | 1W | 1M | YTD |
| LIBOR Overnight | 0,09% | 0,09% | 0,06% | 0,06% | 0,08% |
| LIBOR1M | 0,09% | 0,09% | 0,08% | 0,09% | 0,14% |
| LIBOR3M | 0,15% | 0,13% | 0,12% | 0,14% | 0,24% |
| LIBOR6M | 0,16% | 0,16% | 0,15% | 0,18% | 0,26% |
| LIBOR12M | 0,24% | 0,25% | 0,23% | 0,26% | 0,34% |

Валютный рынок

| | Знач. | Изменение валютных пар | | | |
|----------------|--------|------------------------|-------|-------|-------|
| | | 1D | 1W | 1M | YTD |
| DXY | 91,8 | 0,0% | -0,1% | 2,0% | 2,1% |
| USD/KZT | 427,7 | -0,1% | 0,0% | -0,1% | -1,5% |
| USD/RUB | 72,3 | 0,4% | 0,7% | 1,2% | 2,8% |
| EUR/USD | 1,19 | -0,1% | 0,3% | -2,2% | -2,4% |
| GBP/USD | 1,39 | -0,3% | 0,1% | -1,5% | 1,9% |
| USD/JPY | 110,89 | 0,1% | -0,5% | -1,7% | -7,3% |

Долговой рынок

| | Валюта | YTM | YTM на | | | |
|-----------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| | | | 1D | 1W | 1M | YTD |
| US Treasuries (10YR) | US\$ | 1,49% | 1,49% | 1,50% | 1,58% | 0,91% |
| US Treasuries (30YR) | US\$ | 2,10% | 2,11% | 2,09% | 2,26% | 1,64% |
| UK Gilts (30YR) | GBP | 0,78% | 0,78% | 0,74% | 0,79% | 0,20% |
| Germany (10YR) | EUR | -0,18% | -0,16% | -0,25% | -0,17% | -0,57% |
| Russia (10YR) | RUB | 7,05% | 7,04% | 7,02% | 7,05% | 5,89% |
| Kazakhstan (5YR) | US\$ | 0,98% | 0,94% | 1,08% | 0,99% | 0,88% |

- **В столице Казахстана с 27 июня ужесточают карантин по COVID-19**

Главный государственный санитарный врач Нур-Султана подписал новое постановление об ужесточении ограничительных и карантинных мер в городе.

Согласно опубликованному документу, с 27 июня в столице вводится запрет на проведение массовых мероприятий, за исключением проведения поминок на объектах, участвующих в проекте "Ashyq".

Предусматривается переход на дистанционную форму работы не менее 80% административного персонала государственных органов, компаний; допускается работа в очном режиме всех сотрудников, получивших полный курс вакцинации и переболевших COVID-19 в течение последних 3-6 месяцев.

Торгово-развлекательные центры и торговые дома будут работать в будние дни с 10:00 до 17:00, с запретом работы в субботние и воскресные дни.

Объекты общепита будут работать в будние дни с 07:00 до 20:00, с запретом работы в субботние и воскресные дни, и на открытом воздухе (летние залы) с числом посадочных мест не более 30, с установлением графика работы в будние и выходные дни с 07:00 до 22:00.

Источник: Интерфакс-Казахстан, Bloomberg

- **Capital Bank Kazakhstan лишен лицензии на проведение банковских операций и деятельности на рынке ценных бумаг**

Правление Агентства по регулированию и развитию финансового рынка приняло решение о лишении лицензии Capital Bank Kazakhstan на проведение банковских и иных операций и деятельности на рынке ценных бумаг, сообщила пресс-служба Агентства.

"Основанием лишения лицензии явились: систематическое (три и более раза в течение двенадцати последовательных календарных месяцев) нарушение пруденциальных нормативов и (или) других обязательных к соблюдению норм и лимитов; систематическое (три и более раза в течение двенадцати последовательных календарных месяцев) невыполнение мер надзорного реагирования; невыполнение крупным участником банка требований уполномоченного органа по дополнительной капитализации; отнесение банка к категории неплатежеспособного банка", - говорится в сообщении ведомства, распространенном в пятницу.

По данным Агентства, размер активов банка на дату лишения лицензии составил 38,5 млрд тенге, ссудный портфель - 33,9 млрд тенге, в том числе 30,4 млрд тенге или 89,8% ссудного портфеля банка представлено неработающими кредитами с просрочкой свыше 90 дней. Размер ликвидных активов банка составляет 149 млн тенге, при этом объем неисполненных клиентских платежей превышает 15,0 млрд тенге.

Источник: Интерфакс-Казахстан, Bloomberg

Ежедневный обзор

25 июня 2021 г.

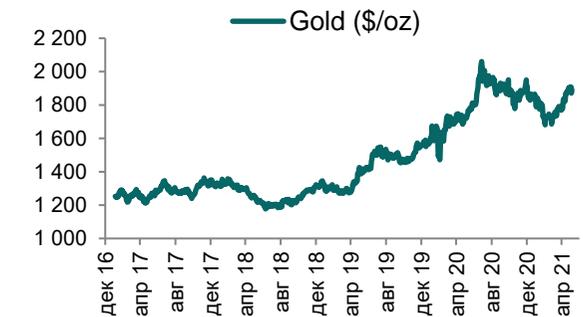
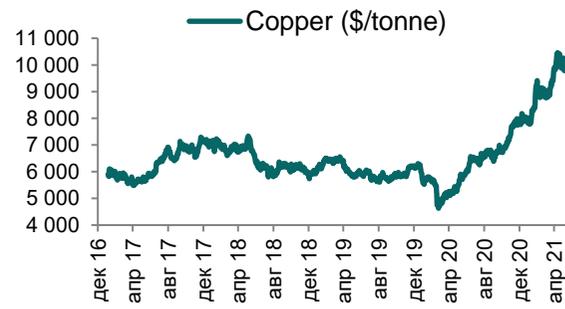
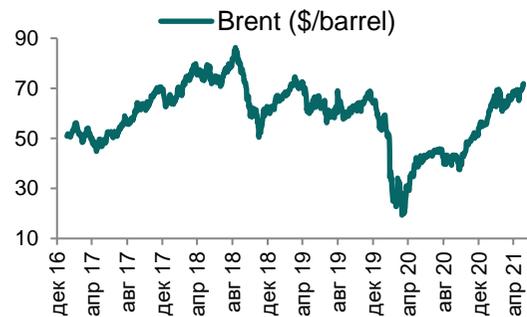
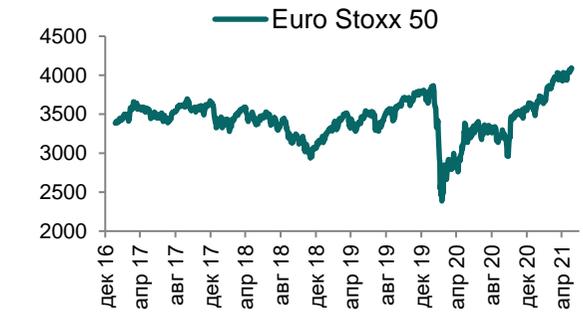
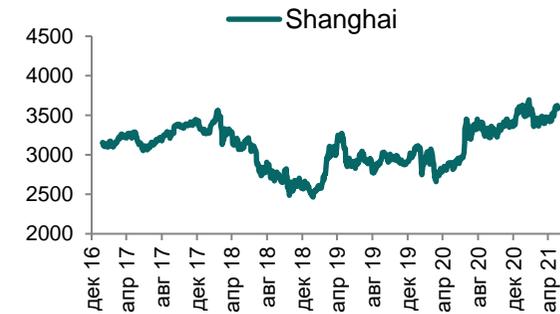
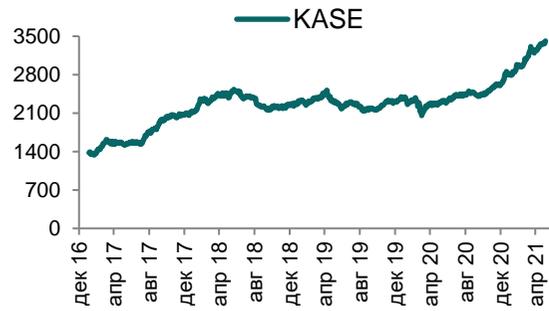
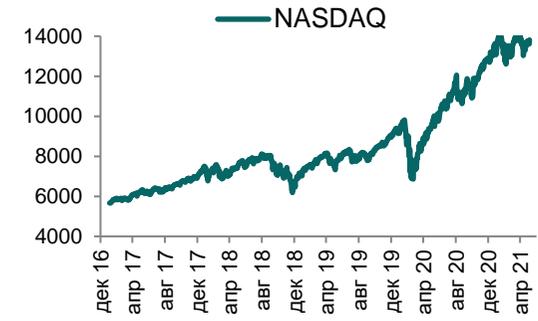
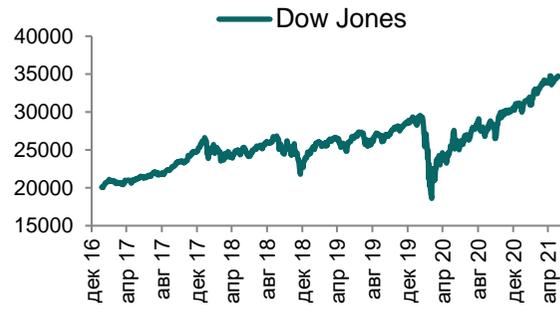
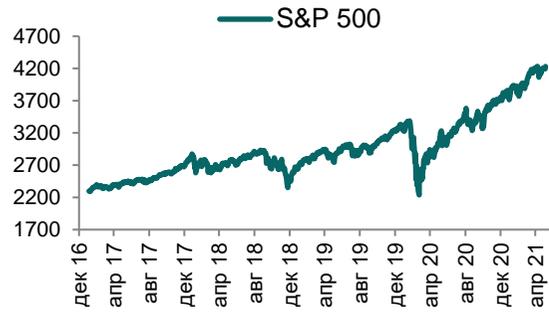
Таблица 1. Динамика изменения валют стран СНГ, развивающихся и развитых стран

| 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% | 0,7% | 1,2% | 2,8% |
| USD/GEL | Грузия | 8,25% | 5,3% | - | 3,1 | 0,0% | 0,3% | 3,7% | 4,4% |
| USD/BYN | Беларусь | 8,50% | 6,0% | 0,7% | 2,53 | 0,1% | -0,7% | -0,7% | 4,0% |
| USD/KGS | Кыргызстан | 5,50% | 7,9% | 0,9% | 84,62 | 0,0% | 0,0% | -0,7% | -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% | 10 560,43 | 0,1% | 0,0% | 0,3% | -0,9% |
| USD/UAH | Украина | 7,50% | 2,7% | 1,0% | 27,38 | 0,0% | -0,4% | 0,3% | 3,3% |
| Развивающиеся страны | | | | | | | | | |
| USD/CNY | Китай | 4,35% | 2,6% | 15,5% | 6,47 | 0,0% | -0,4% | -1,0% | 0,8% |
| USD/BRL | Бразилия | 3,50% | 3,2% | 0,0% | 4,91 | 1,1% | 3,5% | 6,2% | 5,5% |
| USD/INR | Индия | 4,00% | 6,9% | 4,2% | 74,17 | 0,2% | -0,4% | -2,2% | -1,5% |
| USD/ZAR | ЮАР | 3,50% | 3,3% | - | 14,21 | 0,1% | -0,5% | -3,3% | 3,1% |
| USD/TRY | Турция | 19,00% | 12,3% | 3,9% | 8,71 | -0,7% | 0,1% | -3,0% | -17,2% |
| Развитые страны | | | | | | | | | |
| DXY | США | 0,25% | 1,2% | 2,2% | 91,81 | 0,0% | -0,1% | 2,0% | 2,1% |
| USD/CAD | Канада | 0,25% | 0,7% | 0,3% | 1,23 | -0,2% | 0,3% | -1,7% | 3,5% |
| GBP/USD | Великобритания | 0,10% | 0,9% | 0,7% | 1,39 | -0,3% | 0,1% | -1,5% | 1,9% |
| USD/CHF | Швейцария | -0,75% | -0,7% | 2,6% | 0,92 | 0,0% | 0,0% | -2,4% | -3,8% |
| USD/JPY | Япония | -0,10% | 0,0% | 2,0% | 110,89 | 0,1% | -0,5% | -1,7% | -7,3% |
| USD/KRW | Южная Корея | 0,50% | 0,7% | 2,9% | 1 134,75 | 0,3% | -0,4% | -1,6% | -4,5% |

Источник: Bloomberg; *доля в товарообороте в торговле с Казахстаном (1K2020 г.)

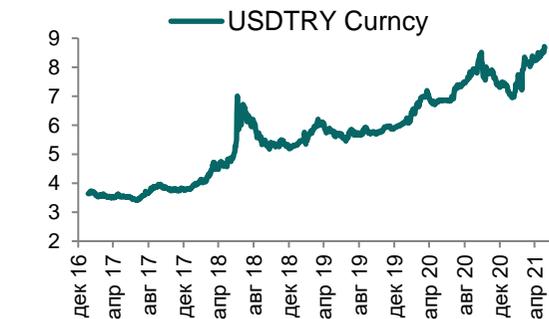
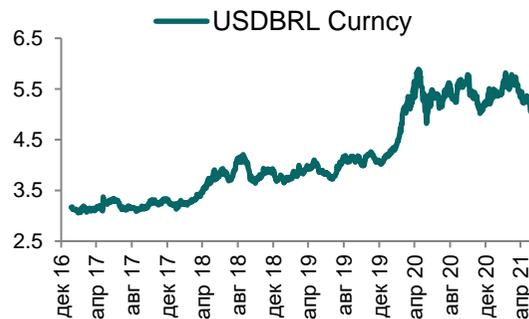
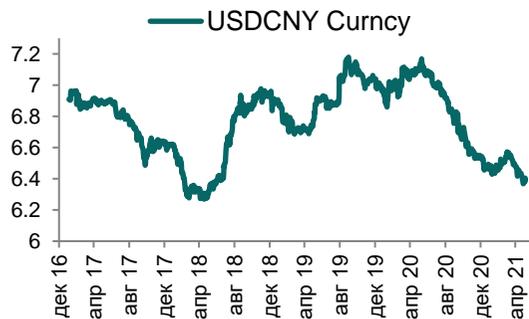
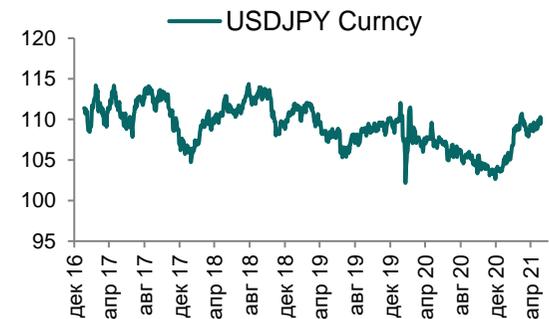
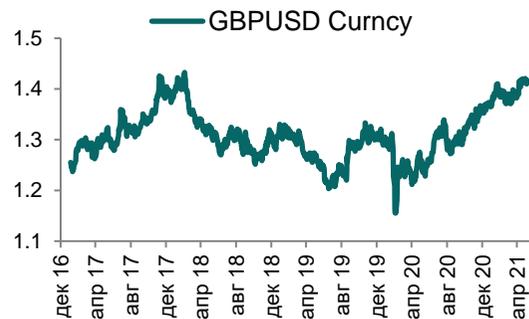
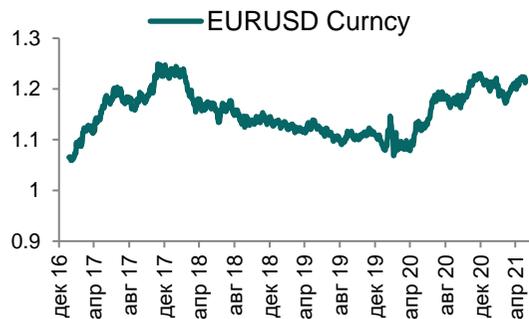
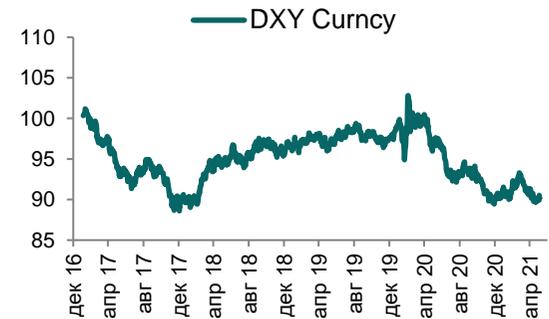
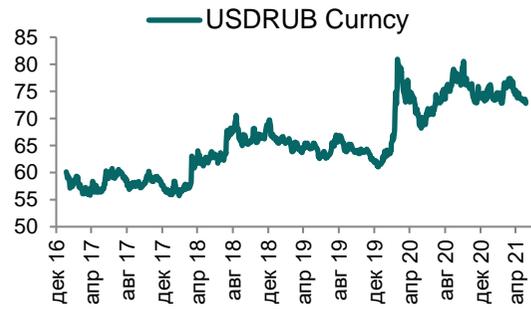
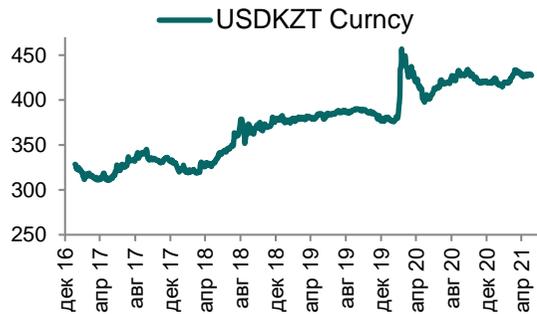
Ежедневный обзор

25 июня 2021 г.



Ежедневный обзор

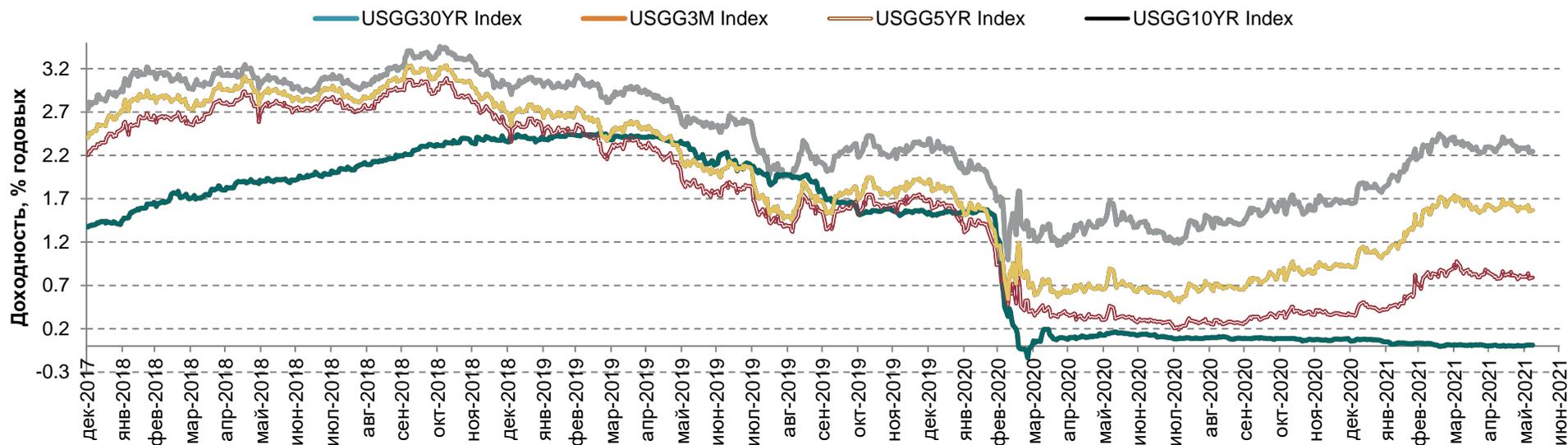
25 июня 2021 г.



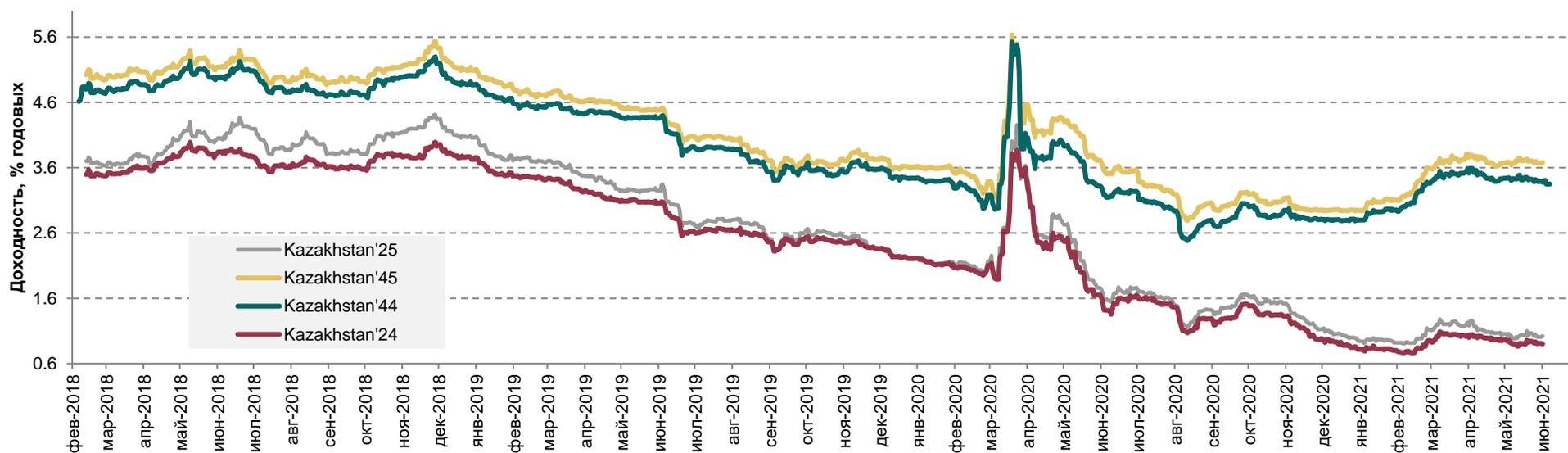
Ежедневный обзор

25 июня 2021 г.

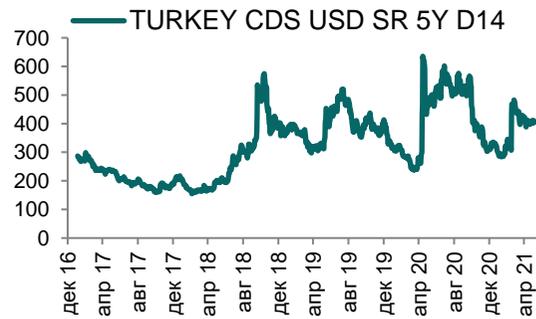
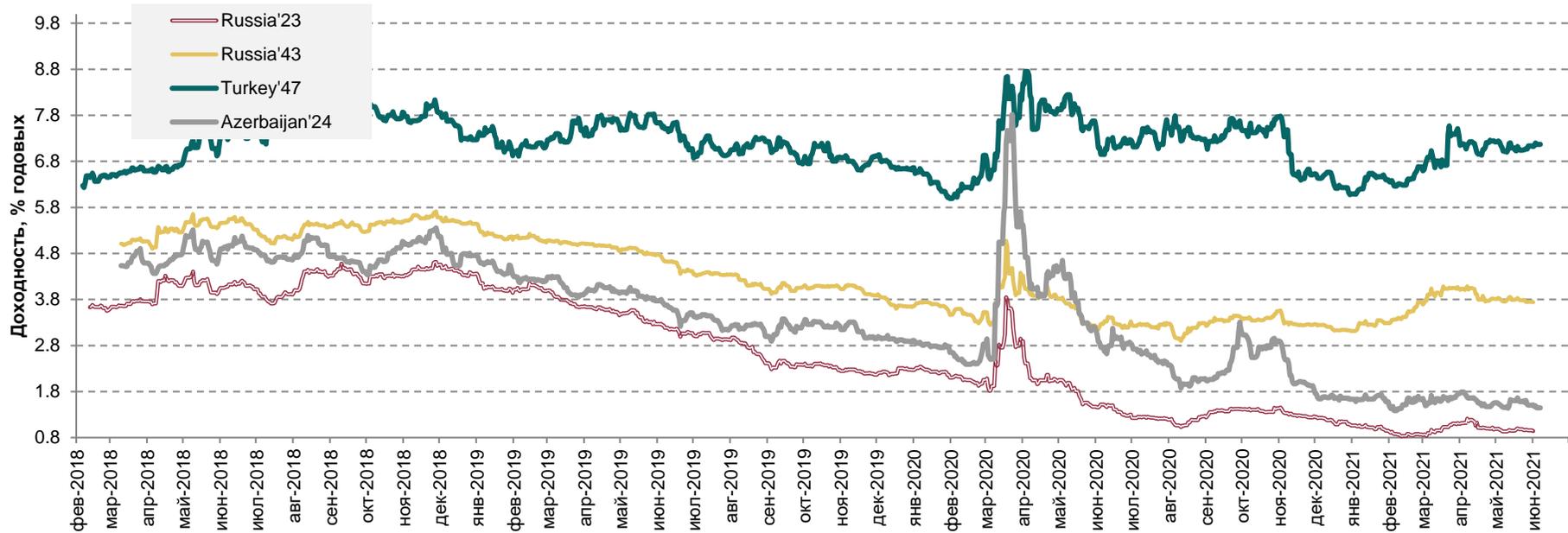
Доходность государственных ценных бумаг США



Динамика доходностей суверенных облигаций РК



Динамика доходностей суверенных еврооблигаций России, Турции и Азербайджана



Ежедневный обзор

25 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

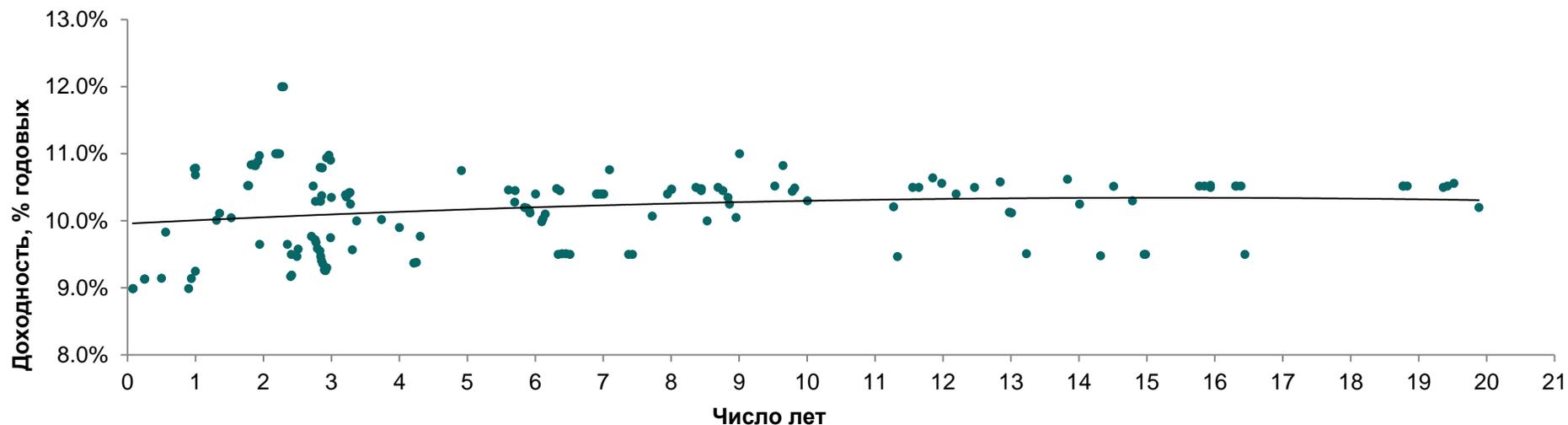


Таблица 4. Последние размещения нот и ГЦБ

| 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

25 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

25 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

25 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 Чуев | 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

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.