



Ежедневный обзор

Рынок акций США ушел в крутое пике

Ежедневный обзор

13 марта 2023 г.

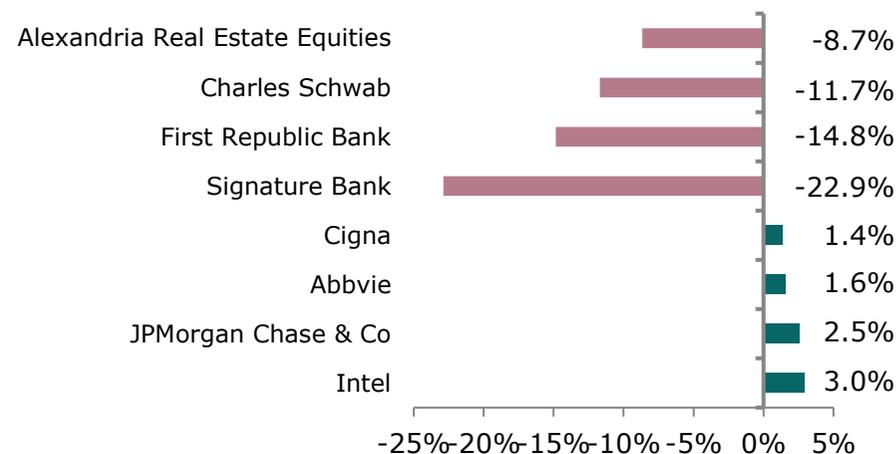
»» Рынок акций США ушел в крутое пике

Рынок акций США ушел в крутое пике, завершив торги снижением в пределах 1.1-1.8%. Банкротство банка Silicon Valley Bank (SVB) (16-й по объему активов банка США) спровоцировало панические распродажи на рынке, которые затронули не только американские финансовые организации, но и перекинулись и на европейские банки. Первое со времен Мирового финансового кризиса банкротство кредитной организации невольно освежило в памяти 2008 год, однако Министр финансов США Джанет Йеллен (Janet Yellen) отметила, что американская банковская система куда более устойчива и безопасна, чем во времена ипотечного кризиса.

»» Рост после ощутимого падения накануне

После трех дней снижения нефтяные котировки выросли на 1.5% до \$82.8 за баррель. Кардинальная смена парадигмы в отношении дальнейшего курса ДКП в США, а также ослабление курса доллара США оказали поддержку ценам на нефть. Проблемы в банковской системе США полностью исключили вероятность повышения ставки сразу на 50 б.п. на предстоящем заседании США (21-22 марта). Рынок в настоящий момент не сомневается в повышении ставки на 25 б.п. до 4.75-5.00% годовых.

Лидеры и аутсайдеры индекса S&P 500



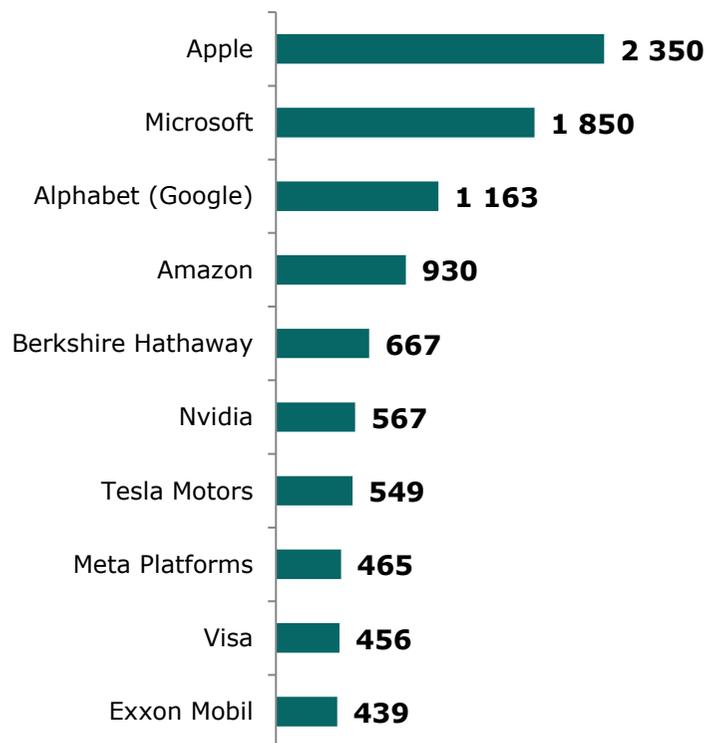
Товарный рынок

	Знач.	Изменение			
		1D	1W	1M	YTD
Brent	82.8	1.5%	-3.6%	-4.2%	-3.6%
Медь	8 867	0.2%	-1.3%	-0.8%	5.9%
Цинк	2 937	-1.2%	-4.6%	-5.2%	-1.2%
Золото	1 868.3	2.0%	0.6%	0.3%	2.4%
Серебро	20.5	2.3%	-3.4%	-6.5%	-14.3%
Природный газ	2.4	-4.4%	-19.2%	0.0%	-45.7%
Алюминий	2 313	-0.6%	-3.8%	-4.1%	-2.7%

Ежедневный обзор

13 марта 2023 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	-1.4%	-56.7	503	100%
Information Technology	-1.7%	-19.1	76	27.4%
Health Care	-0.7%	-4.1	64	14.3%
Financials	-1.8%	-7.7	67	11.6%
Consumer Discretionary	-1.0%	-4.0	56	10.6%
Industrials	-1.8%	-6.2	70	8.3%
Communication Services	-1.4%	-4.3	25	8.2%
Consumer Staples	-0.5%	-1.2	33	6.5%
Energy	-1.4%	-2.7	23	4.9%
Utilities	-1.6%	-1.8	30	2.9%
Real Estate	-3.3%	-3.4	30	2.7%
Materials	-2.2%	-2.3	29	2.7%

Ежедневный обзор

13 марта 2023 г.

>> Рынок акций США ушел в крутое пике

Рынок акций США ушел в крутое пике, завершив торги снижением в пределах 1.1-1.8%. Банкротство банка Silicon Valley Bank (SVB) (16-й по объему активов банка США) спровоцировало панические распродажи на рынке, которые затронули не только американские финансовые организации, но и перекинулись и на европейские банки. Первое со времен Мирового финансового кризиса банкротство кредитной организации невольно освежило в памяти 2008 год, однако Министр финансов США Джанет Йеллен (Janet Yellen) отметила, что американская банковская система куда более устойчива и безопасна, чем во времена ипотечного кризиса. Бывший председатель Федрезерва заявила, что власти не намерены спасать обанкротившийся банк и Федеральная корпорация по страхованию вкладов (FDIC) покроет потери держателям депозитов в случае, если величина вклада не превышает \$250 тыс. Однако с учетом размера страхового лимита в \$250 тыс, лишь небольшая сумма вкладов попадает под защиту государства (4%).

>> Резкая смена парадигмы дальнейшего курса ДКП в США

Проблемы в банковской системе спровоцировали резкий пересмотр курса ДКП в США. Так, если вероятность повышения ставки на 50 б.п. на мартовской встрече ФРС США до проблем с SVB оценивалась в 78.6%, то после банкротства банка вероятность повышения на символические 25 б.п. выросла с 21.4% до 96%, при этом рынок в настоящий момент исключает вероятность повышения ставки на 50 б.п в марте.

В результате резкой смены ожиданий относительно дальнейших темпов повышения ставки в США, доходность по 10-летним казначейским облигациям США снизилась сразу на 20 б.п. до 3.70%. Доллар отреагировал снижением на 0.7% до 104.6 пунктов, а котировки золота выросли на 2.0% до месячных максимумов и составили \$1 868.3 за тройскую унцию.

На утро сегодняшнего дня стало известно, что власти США закрыли Signature Bank из-за системных рисков, при этом несмотря на проблемы в отрасли, которые могут затронуть весь финансовый сектор, фьючерсные контракты на американские фондовые индексы сейчас растут на 1.2-1.8%.

Фондовые индексы	Регион	Посл. Знач.	Изменение	
			За день	С начала года
Americas				
S&P500	США	3 861.6	-1.45%	0.58%
Dow Jones	США	31 909.6	-1.07%	-3.73%
NASDAQ	США	11 138.9	-1.76%	6.42%
EMEA				
Euro Stoxx 50	Евросона	4 229.5	-1.32%	11.49%
FTSE 100	Великобритания	7 748.4	-1.67%	3.98%
CAC 40	Франция	7 220.7	-1.30%	11.54%
DAX	Германия	15 428.0	-1.31%	10.80%
IBEX 35	Испания	9 285.0	-1.47%	12.83%
FTSE MIB	Италия	27 282.0	-1.55%	15.08%
Asia/Pacific				
Nikkei 225	Япония	27 706.1	-1.56%	6.18%
Hang Seng	Гонконг	19 319.9	-3.04%	-2.33%
CSI 300	Китай	3 967.1	-1.31%	2.47%
Shanghai	Китай	3 230.1	-1.40%	4.56%
Sensex	Индия	59 135.1	-1.12%	-2.80%
Singapore	Сингапур	3 150.9	-0.84%	-3.09%
Emerging markets				
Bovespa	Бразилия	103 618.2	-1.38%	-5.57%
RTSI\$	Россия	942.8	-0.86%	-2.87%
NIFTY 50	Индия	17 412.9	-1.00%	-3.82%
TOP 40	ЮАР	70 692.6	-1.60%	5.58%
Borsa Index	Турция	5 446.2	0.14%	-1.14%
KASE	Казахстан	3 298.5	0.22%	1.44%

Ежедневный обзор

13 марта 2023 г.

>> Валютный рынок

- Значение индекса доллара США (DXY), показывающего отношение курса доллара к корзине из шести мировых валют снизилось на 0.7% до 104.6.
- Курс USDKZT скорректировался на 2.2% до 451.1.

>> Главные новости

- КазТрансОйл намерен в марте протестировать отправку на экспорт кашаганской нефти из порта Актау;
- S&P подтвердило рейтинги БРК на уровне "BBB-/A-3", изменив прогноз на "стабильный".

LIBOR (USD)

	Знач.	Значение на дату			
		1D	1W	1M	YTD
LIBOR Overnight	4.56%	4.56%	4.56%	4.55%	4.32%
LIBOR1M	4.80%	4.81%	4.71%	4.58%	4.39%
LIBOR3M	5.14%	5.15%	4.98%	4.86%	4.77%
LIBOR6M	5.43%	5.50%	5.32%	5.15%	5.14%
LIBOR12M	5.74%	5.86%	5.69%	5.47%	5.48%

Валютный рынок

	Знач.	Изменение валютных пар			
		1D	1W	1M	YTD
DXY	104.6	-0.7%	0.1%	1.1%	1.0%
USD/KZT	451.1	2.2%	4.6%	0.0%	-2.5%
USD/RUB	75.9	-0.2%	0.6%	5.9%	2.3%
EUR/USD	1.06	0.6%	0.1%	-0.8%	-0.6%
GBP/USD	1.20	0.9%	0.0%	-0.1%	-0.4%
USD/JPY	135.03	-0.8%	-0.6%	3.0%	3.0%

Долговой рынок

	Валюта	YTM	YTM на			
			1D	1W	1M	YTD
US Treasuries (10YR)	US\$	3.70%	3.90%	3.95%	3.67%	3.87%
US Treasuries (30YR)	US\$	3.71%	3.85%	3.88%	3.71%	3.96%
UK Gilts (30YR)	GBP	3.80%	3.77%	3.88%	3.24%	3.67%
Germany (10YR)	EUR	2.64%	2.65%	2.75%	2.30%	2.57%
Russia (10YR)	RUB	9.27%	9.30%	9.35%	9.22%	9.14%
Kazakhstan (3YR)	US\$	3.39%	3.40%	3.40%	3.23%	3.37%

Ежедневный обзор

13 марта 2023 г.

- **КазТрансОйл намерен в марте протестировать отправку на экспорт кашаганской нефти из порта Актау**

АО "КазТрансОйл" в марте планирует произвести тестовую отгрузку 7 тыс. тонн нефти с месторождения Кашаган, сообщил департамент по связям с общественностью и внутренним коммуникациям "КазТрансОйла". Отгрузку планируется произвести в порту Актау на экспорт для дальнейшей поставки в направлении порта Баку. Грузоотправителем кашаганской нефти является компания Inpex North Caspian Sea, Ltd. Консорциум North Caspian Operating Company (NCOC), разрабатывающий Кашаган, ранее отмечал, что располагает только трубопроводной инфраструктурой для поставки нефти на экспорт. Однако консорциум работает в направлении диверсификации экспортных маршрутов. Одним из вариантов называлась отправка нефти по железной дороге.

"У NCOC нет железнодорожных погрузочных возможностей, у нас только трубопроводы. Поэтому мы рассматриваем, стоит ли нам развивать у себя возможности железнодорожной отгрузки, чтобы мы могли минимальный объем экспортировать в случае, если будет иметь место непостоянство в работе КТК ("Каспийского трубопроводного консорциума" - ИФ)", - отмечал ранее управляющий директор NCOC Оливье Лазар.

Кашаган - первое морское нефтегазовое месторождение в казахстанском секторе Каспийского моря, а также крупнейший международный инвестиционный проект в стране. Коммерческая добыча на месторождении началась 1 ноября 2016 года. Акционерами NCOC являются KMG Kashagan B.V. (16.877%), Shell Kazakhstan Development B.V. (16.807%), Total EP Kazakhstan (16.807%), AgipCaspian Sea B.V. (16.807%), ExxonMobil Kazakhstan Inc. (16.807%), CNPC Kazakhstan B.V. (8.333%) и Inpex NorthCaspian Sea Ltd. (7.563%). АО "КазТрансОйл" - казахстанский оператор магистральных нефтепроводов. Входит в группу "КазМунайГаз".

Источник: Интерфакс-Казахстан, Bloomberg

- **S&P подтвердило рейтинги БРК на уровне "BBB-/A-3", изменив прогноз на "стабильный"**

Международное рейтинговое агентство S&P Global Ratings подтвердило долгосрочные кредитные рейтинги Банка развития Казахстана в иностранной и национальной валюте на уровне "BBB-", говорится в сообщении агентства.

Прогноз по этим рейтингам изменен с "негативного" на "стабильный" после аналогичного действия по суверенному рейтингу Казахстана. Краткосрочные кредитные рейтинги в иностранной и национальной валюте подтверждены на уровне "A-3", рейтинг по национальной шкале - на уровне "kzAAA".

"На наш взгляд, хотя риски для экспорта нефти из Казахстана по трубопроводу Каспийского трубопроводного консорциума (КТК) сохраняются, бюджетные и внешнеэкономические показатели страны должны компенсировать временные сбои в работе КТК, если они возникнут, но при этом не будут слишком долгими", - говорится в сообщении.

БРК является крупнейшей дочерней структурой Национального управляющего холдинга "Байтерек".

Источник: Интерфакс-Казахстан, Bloomberg

Ежедневный обзор

13 марта 2023 г.

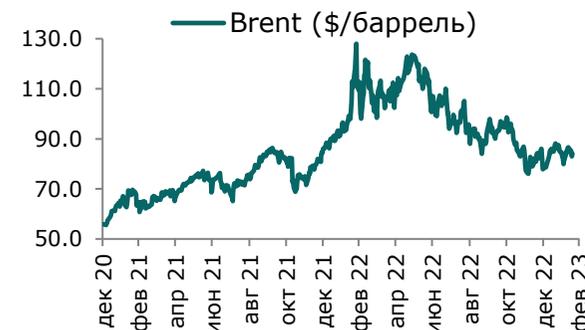
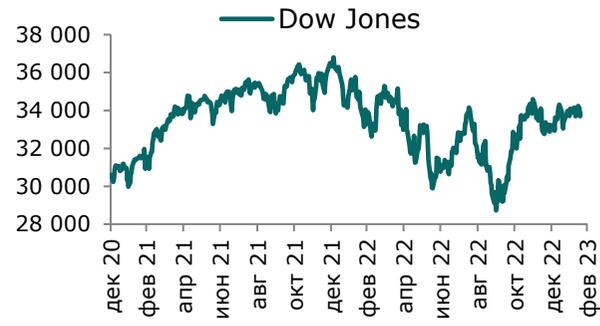
Таблица 1. Динамика изменения валют стран СНГ, развивающихся и развитых стран

Валютная пара (индекс)	Страна	Базовая ставка	Инфляция 2021	Инфляция 2022	Курс	1D	1W	1M	YTD
USD/KZT	Казахстан	16.75%	8.0%	14.9%	451.1	2.2%	4.6%	0.0%	-2.5%
USD/RUB	Россия	7.50%	6.7%	13.8%	75.9	-0.2%	0.6%	5.9%	2.3%
USD/GEL	Грузия	11.00%	9.3%	11.6%	2.59	-0.2%	-0.2%	-3.1%	-4.2%
USD/KGS	Кыргызстан	13.00%	11.2%	14.7%	87.37	0.0%	0.0%	4.8%	2.0%
USD/TJS	Таджикистан	13.00%	8.0%	4.5%	10.79	0.0%	0.6%	5.1%	5.5%
USD/UZS	Узбекистан	15.00%	10.0%	12.3%	11 388.01	0.1%	0.2%	0.5%	1.4%
USD/UAH	Украина	25.00%	9.3%	20.1%	36.93	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
Развивающиеся страны									
USD/CNY	Китай	4.35%	0.9%	2.0%	6.92	-0.7%	0.2%	1.9%	0.3%
USD/BRL	Бразилия	13.75%	8.3%	9.3%	5.21	1.0%	1.1%	-1.2%	-1.2%
USD/INR	Индия	6.50%	4.1%	6.7%	82.05	0.1%	0.1%	-0.6%	-0.8%
USD/ZAR	ЮАР	7.25%	4.6%	6.9%	18.32	-1.4%	1.0%	3.1%	7.5%
USD/TRY	Турция	8.50%	19.4%	72.0%	18.81	-0.7%	-0.3%	-0.1%	0.5%
Развитые страны									
DXY	США	4.75%	4.7%	8.0%	104.6	-0.7%	0.1%	1.3%	1.0%
USD/CAD	Канада	4.50%	3.4%	6.8%	1.38	0.0%	1.7%	2.8%	2.1%
GBP/USD	Великобритания	4.00%	2.6%	9.1%	1.20	0.9%	0.0%	-0.3%	-0.4%
USD/CHF	Швейцария	1.00%	0.6%	2.8%	0.92	-1.3%	-1.7%	-0.2%	-0.4%
USD/JPY	Япония	-0.10%	-0.3%	2.5%	135.03	-0.8%	-0.6%	2.6%	3.0%
USD/KRW	Южная Корея	3.50%	2.3%	5.1%	1 324.50	0.2%	1.8%	5.1%	4.7%

Источник: Bloomberg

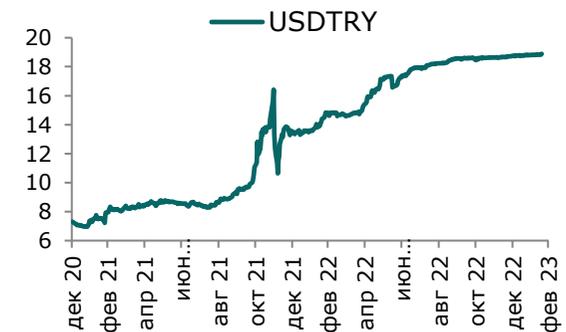
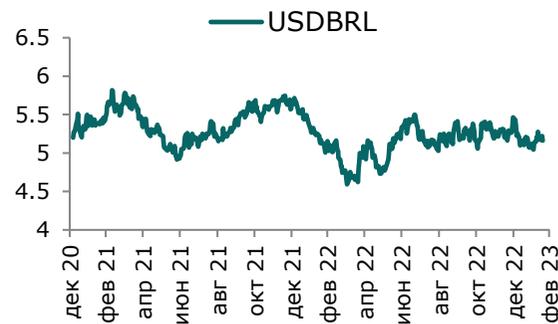
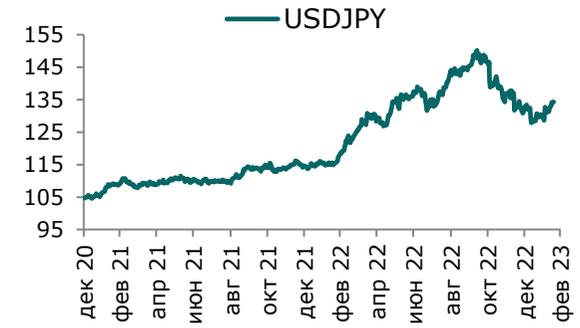
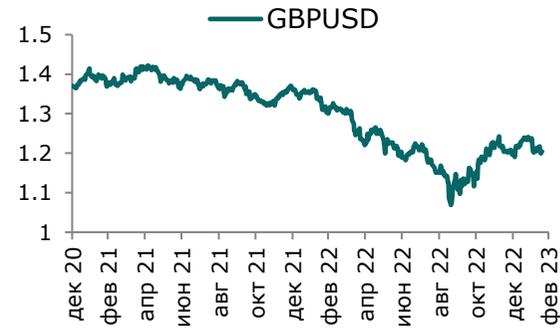
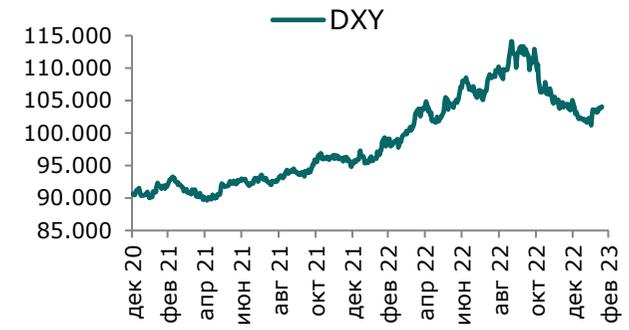
Ежедневный обзор

13 марта 2023 г.



Ежедневный обзор

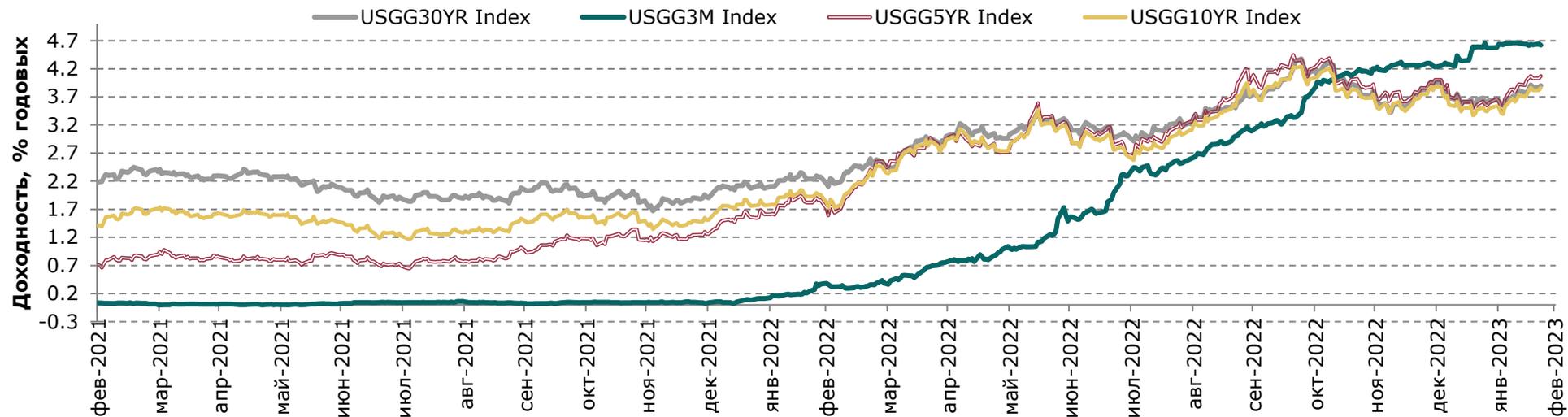
13 марта 2023 г.



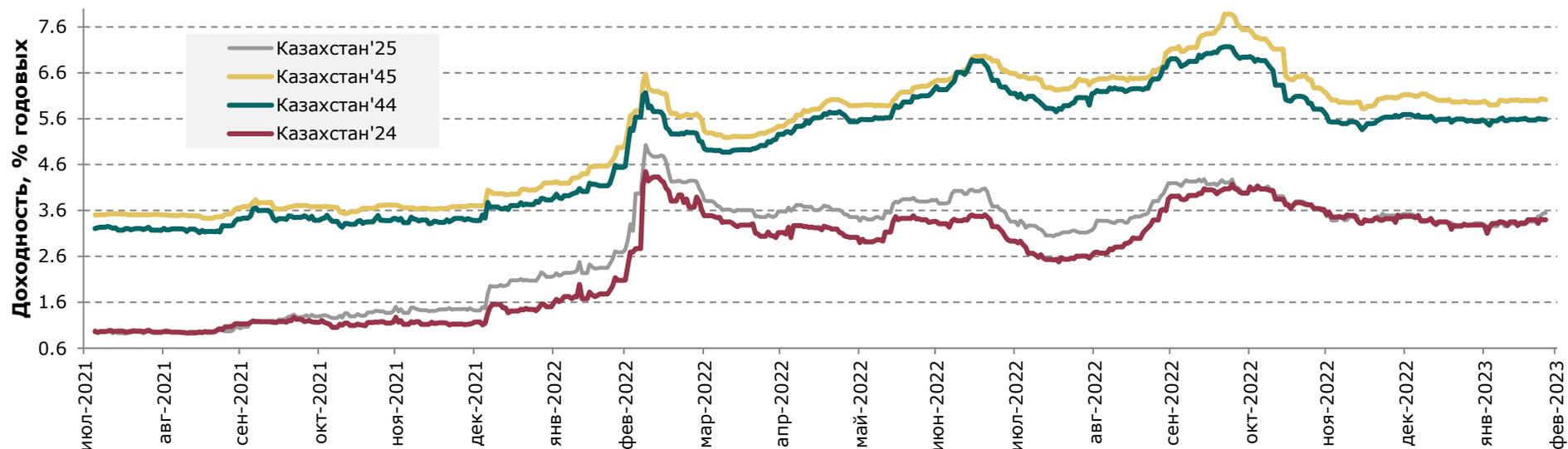
Ежедневный обзор

13 марта 2023 г.

Доходность государственных ценных бумаг США



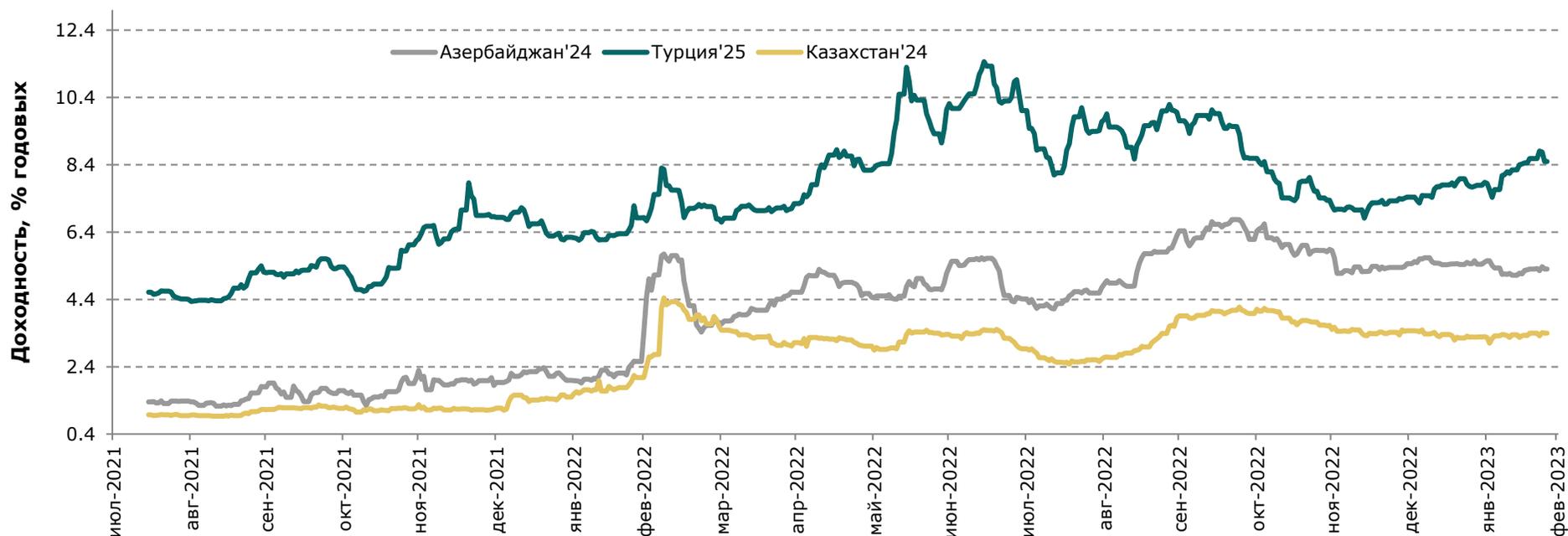
Динамика доходности суверенных облигаций РК



Ежедневный обзор

13 марта 2023 г.

Динамика доходности суверенных еврооблигаций Турции и Азербайджана



Ежедневный обзор

13 марта 2023 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			
Республика Казахстан											
KAZAKS 0.6 09/30/26	EUR	0.60	91.65	96.17	3.10	1.71	-158.74	-92.04	30.09.2026	500	3.47
KAZAKS 2 3/8 11/09/28	EUR	2.38	108.08	108.08	0.91	0.91	-223.50	-157.18	09.11.2028	525	5.33
KAZAKS 1 1/2 09/30/34	EUR	1.50	72.48	73.44	4.62	4.49	142.16	199.02	30.09.2034	650	9.99
KAZAKS 1.55 11/09/23	EUR	1.55	98.65	99.29	3.52	2.57	-81.50	-46.82	09.11.2023	525	0.68
KAZAKS 3 7/8 10/14/24	USD	3.88	103.69	103.69	1.57	1.57	-343.03	-322.53	14.10.2024	1500	1.56
KAZAKS 6 1/2 07/21/45	USD	6.50	105.47	106.42	6.05	5.98	251.17	197.73	21.07.2045	1500	11.95
KAZAKS 5 1/8 07/21/25	USD	5.13	104.20	104.20	3.29	3.29	-128.28	-129.15	21.07.2025	2500	2.24
KAZAKS 4 7/8 10/14/44	USD	4.88	-	105.00	-	4.51	106.37	49.95	14.10.2044	1000	-
НК КазМунайГаз											
KZOKZ 6 3/8 10/24/48	USD	6.38	82.41	83.50	8.00	7.88	444.22	393.73	24.10.2048	1500	11.04
KZOKZ 5 3/4 04/19/47	USD	5.75	78.62	79.51	7.71	7.62	416.74	364.75	19.04.2047	1250	11.27
KZOKZ 5 3/8 04/24/30	USD	5.38	90.23	91.12	7.14	6.97	322.03	295.41	24.04.2030	1250	5.65
KZOKZ 3 1/2 04/14/33	USD	3.50	74.34	75.22	7.09	6.95	333.12	307.39	14.04.2033	750	7.90
KZOKZ 4 3/4 04/19/27	USD	4.75	91.77	92.60	7.07	6.83	276.06	259.70	19.04.2027	1000	3.60
KZOKZ 4 3/4 04/24/25	USD	4.75	97.24	98.06	6.13	5.72	102.57	106.73	24.04.2025	500	1.98
Самрук Казына											
SAMRUK 2 10/28/26	USD	2.00	87.64	88.50	5.79	5.51	136.16	120.25	28.10.2026	500	3.42
КазТрансГаз											
KZTGKZ 4 3/8 09/26/27	USD	4.38	90.08	91.11	6.94	6.66	266.66	249.21	26.09.2027	706	3.96
Казахстан ТемирЖолы											
KTZKZ 3 1/4 12/05/23	CHF	3.25	94.42	97.84	11.24	6.21	460.26	495.10	05.12.2023	250	0.70
Банк Развития Казахстана											
DBKAZ 5 3/4 05/12/25	USD	5.75	100.26	100.97	5.62	5.28	60.86	63.96	12.05.2025	500	2.02
DBKAZ 2.95 05/06/31	USD	2.95	78.29	79.31	6.40	6.21	254.61	224.83	06.05.2031	255	6.90
ТенгизШевройл											
TENGIZ 4 08/15/26	USD	4.00	88.14	89.05	8.28	7.93	364.46	355.49	15.08.2026	1000	2.91
TENGIZ 3 1/4 08/15/30	USD	3.25	75.36	76.43	7.64	7.42	371.12	341.98	15.08.2030	750	6.30
TENGIZ 2 5/8 08/15/25	USD	2.63	88.87	90.21	7.67	7.02	248.57	246.02	15.08.2025	500	2.31

Ежедневный обзор

13 марта 2023 г.

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%	97.55	98.29	7.39	6.58	127.99	159.96	20.02.2024	500	0.93
UZBEK 5,375 2029	USD	5.38%	92.04	92.93	7.03	6.83	299.40	277.23	20.02.2029	500	4.97
UZBEK 3,7 2030	USD	3.70%	80.71	81.70	6.96	6.78	305.74	277.19	25.11.2030	555	6.38
НБ Республики Узбекистан											
NBUZB 4,85 2025	USD	4.85%	93.92	95.09	7.42	6.91	232.70	229.40	21.10.2025	300	2.38
Узпромстройбанк											
SQBNZU 5,75 2024	USD	5.75%	92.87	96.66	10.26	7.80	288.62	304.50	02.12.2024	300	1.60
Ипотека Банк											
IPTBZU 5,5 2025	USD	5.50%	94.49	95.51	7.78	7.34	280.74	277.54	19.11.2025	300	2.43

Таблица 4. Информация по прочим еврооблигациям

Выпуск	Валюта	Купон	Цена		Доходность		Спред		Дата погашения	Объем бумаг в обращении, млн.	Дюрация
			Покупка	Продажа	Покупка	Продажа	Z-Sprd	OAS-Sprd			
SEASPAN CORP	USD	5.50%	75.39	77.24	10.93	10.45	663.61	638.61	01.08.2029	750	5.04
GRUPO AXO SA DE CV	USD	5.75%	87.38	88.36	10.38	10.00	572.05	564.10	08.06.2026	325	2.83
CYDSA SAB DE CV	USD	6.25%	93.74	94.90	7.90	7.58	357.33	315.17	04.10.2027	332	3.80
BUKIT MAKMUR MANDIRI UTA	USD	7.75%	86.79	88.01	13.30	12.75	835.65	831.79	10.02.2026	400	2.50
EMPRESA ELECTRICA COCHRA	USD	5.50%	93.61	94.59	8.75	8.22	378.17	376.52	14.05.2027	285	1.95
GRUPO UNICOMER CO LTD	USD	7.88%	98.08	99.41	9.75	8.44	320.96	343.13	01.04.2024	350	0.99
IOCHPE-MAX/MAX WHEELS MX	USD	5.00%	81.14	82.22	9.71	9.40	548.19	530.00	07.05.2028	400	4.28
ADECOAGRO SA	USD	6.00%	92.57	93.57	7.97	7.70	368.41	335.20	21.09.2027	500	3.78

Ежедневный обзор

13 марта 2023 г.

Кривая доходности ГЦБ

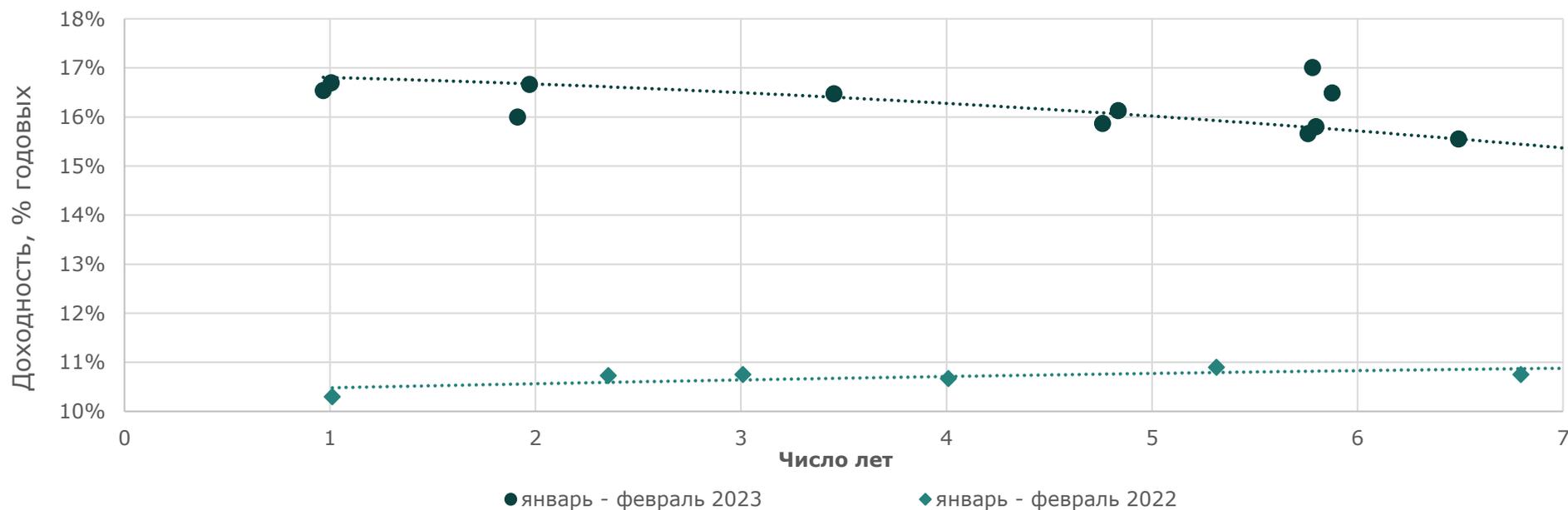


Таблица 5. Последние размещения ГЦБ

Эмитент	Тикер	Доходность	Лет до погашения*	Дата размещения
Ценные бумаги Министерства Финансов				
Министерство Финансов	MOM060_0054	15.87%	4.76	15.фев.23
Министерство Финансов	MOM024_0087	16.00%	1.91	15.фев.23
Министерство Финансов	MTM096_0001	17.28%	7.92	15.фев.23
Министерство Финансов	MUM132_0007	14.05%	9.47	08.фев.23
Министерство Финансов	MTM072_0001	17.01%	5.78	08.фев.23
Министерство Финансов	MUM144_0009	13.00%	10.55	08.фев.23
Министерство Финансов	MUM096_0012	15.55%	6.49	01.фев.23
Министерство Финансов	MUM180_0016	11.60%	14.00	01.фев.23
Министерство Финансов	MKM012_0153	16.54%	0.97	01.фев.23
Министерство Финансов	MUM240_0002	12.25%	11.30	25.январь.23
Министерство Финансов	MUM096_0011	15.66%	5.76	25.январь.23
Министерство Финансов	MUM144_0009	13.00%	10.58	25.январь.23
Министерство Финансов	MOM024_0087	16.66%	1.97	25.январь.23
Министерство Финансов	MOM060_0054	16.13%	4.84	18.январь.23
Министерство Финансов	MKM012_0153	16.70%	1.01	18.январь.23
Министерство Финансов	MUM132_0007	14.05%	9.53	18.январь.23
Министерство Финансов	MUM144_0009	13.00%	10.62	11.январь.23

Ежедневный обзор

13 марта 2023 г.

Министерство Финансов	MOM048_0053	16.47%	3.45	11.янв.23
Министерство Финансов	MUM096_0011	15.80%	5.80	11.янв.23
Министерство Финансов	MUM300_0001	11.50%	15.97	04.янв.23
Министерство Финансов	MTM072_0001	16.49%	5.88	04.янв.23
Министерство Финансов	MUM096_0013	15.48%	7.09	04.янв.23
Министерство Финансов	MUM084_0018	16.02%	5.29	28.дек.22
Министерство Финансов	MOM060_0054	15.99%	4.89	28.дек.22
Министерство Финансов	MTM036_0001	15.80%	2.61	28.дек.22
Министерство Финансов	MOM048_0054	15.99%	3.72	28.дек.22
Министерство Финансов	MTM048_0001	16.32%	3.70	28.дек.22
Министерство Финансов	MTM072_0001	16.20%	5.92	21.дек.22
Министерство Финансов	MTM048_0001	16.20%	3.72	21.дек.22
Министерство Финансов	MUM084_0018	16.00%	5.31	21.дек.22
Министерство Финансов	MTM036_0001	16.19%	2.62	21.дек.22
Министерство Финансов	MTM060_0001	16.20%	4.82	21.дек.22
Министерство Финансов	MOM060_0054	15.83%	4.93	14.дек.22
Министерство Финансов	MTM072_0001	16.09%	5.93	14.дек.22
Министерство Финансов	MOM048_0054	15.97%	3.76	14.дек.22
Министерство Финансов	MOM036_0091	16.58%	2.16	14.дек.22
Министерство Финансов	MTM072_0001	15.99%	5.95	07.дек.22
Министерство Финансов	MTM048_0001	15.99%	3.76	07.дек.22
Министерство Финансов	MTM036_0001	15.99%	2.66	07.дек.22
Министерство Финансов	MTM060_0001	15.99%	4.85	07.дек.22
Министерство Финансов	MTM036_0001	15.92%	2.68	30.ноя.22
Министерство Финансов	MTM072_0001	15.92%	5.97	30.ноя.22
Министерство Финансов	MTM036_0001	15.88%	2.70	23.ноя.22
Министерство Финансов	MTM060_0001	15.95%	4.91	23.ноя.22
Министерство Финансов	MOM048_0054	15.48%	3.84	16.ноя.22
Министерство Финансов	MTM060_0001	15.57%	4.91	16.ноя.22
Министерство Финансов	MTM048_0001	15.67%	3.84	09.ноя.22
Министерство Финансов	MTM036_0001	15.67%	2.74	09.ноя.22
Министерство Финансов	MTM060_0001	15.49%	4.95	02.ноя.22
Министерство Финансов	MTM048_0001	15.49%	3.85	02.ноя.22
Министерство Финансов	MOM036_0091	14.45%	2.30	26.окт.22
Министерство Финансов	MTM048_0001	15.45%	3.87	26.окт.22
Министерство Финансов	MOM048_0054	13.90%	3.89	26.окт.22
Министерство Финансов	MTM060_0001	15.45%	4.97	26.окт.22
Министерство Финансов	MTM048_0001	15.42%	3.89	19.окт.22
Министерство Финансов	MOM036_0091	14.42%	2.32	19.окт.22
Министерство Финансов	MTM060_0001	15.43%	4.99	19.окт.22
Министерство Финансов	MOM048_0054	13.90%	3.93	12.окт.22
Министерство Финансов	MTM036_0001	14.95%	2.84	05.окт.22
Министерство Финансов	MTM048_0001	15.20%	3.93	05.окт.22
Министерство Финансов	MOM048_0054	13.90%	3.95	05.окт.22
Министерство Финансов	MTM048_0001	15.16%	0.95	28.сен.22
Министерство Финансов	MOM036_0091	14.00%	2.38	28.сен.22
Министерство Финансов	MOM048_0054	13.90%	3.97	28.сен.22
Министерство Финансов	MTM048_0001	15.15%	3.97	21.сен.22

Ежедневный обзор

13 марта 2023 г.

Министерство Финансов	MOM048_0054	13.90%	3.99	21.сен.22
Министерство Финансов	MTM036_0001	14.88%	2.89	14.сен.22
Министерство Финансов	MOM036_0092	14.00%	2.80	07.сен.22
Министерство Финансов	MUM120_0014	14.45%	1.90	31.авг.22
Министерство Финансов	MUM120_0017	13.85%	4.50	31.авг.22
Министерство Финансов	MUM120_0017	13.85%	4.50	24.авг.22
Министерство Финансов	MKM012_0151	14.79%	1.00	24.авг.22
Министерство Финансов	MUM120_0014	14.45%	2.00	24.авг.22
Министерство Финансов	MKM012_0151	14.50%	1.00	17.авг.22
Министерство Финансов	MUM120_0014	14.22%	2.00	17.авг.22
Министерство Финансов	MUM120_0017	13.85%	4.60	17.авг.22
Министерство Финансов	MKM012_0151	14.50%	1.00	10.авг.22
Министерство Финансов	MUM120_0014	14.20%	2.00	10.авг.22
Министерство Финансов	MUM156_0005	13.85%	4.90	10.авг.22
Министерство Финансов	MUM180_0002	14.13%	1.90	03.авг.22
Министерство Финансов	MUM156_0005	13.85%	4.90	03.авг.22
Министерство Финансов	MUM180_0002	14.10%	1.90	27.июл.22
Министерство Финансов	MUM156_0005	13.85%	4.90	27.июл.22
Министерство Финансов	MUM144_0003	14.50%	0.80	20.июл.22
Министерство Финансов	MUM072_0013	13.73%	4.80	20.июл.22
Министерство Финансов	MUM180_0002	14.00%	1.90	20.июл.22
Министерство Финансов	MUM180_0002	14.00%	2.00	13.июл.22
Министерство Финансов	MUM144_0003	14.50%	0.80	13.июл.22
Министерство Финансов	MUM072_0013	13.70%	4.90	13.июл.22
Министерство Финансов	MUM180_0002	14.00%	2.00	07.июл.22
Министерство Финансов	MUM156_0005	13.71%	5.00	07.июл.22
Министерство Финансов	MUM144_0003	14.50%	0.80	07.июл.22
Министерство Финансов	MUM144_0003	14.50%	0.80	29.июн.22
Министерство Финансов	MUM072_0013	13.62%	4.90	29.июн.22
Министерство Финансов	MOM048_0053	13.75%	4.00	22.июн.22
Министерство Финансов	MOM036_0092	13.85%	3.00	22.июн.22
Министерство Финансов	MUM156_0005	13.62%	5.00	22.июн.22
Министерство Финансов	MUM144_0003	14.50%	0.90	15.июн.22
Министерство Финансов	MUM180_0001	14.00%	1.90	15.июн.22
Министерство Финансов	MOM036_0091	13.85%	2.70	08.июн.22
Министерство Финансов	MOM048_0052	13.75%	3.60	08.июн.22
Министерство Финансов	MUM072_0013	13.62%	0.90	08.июн.22
Министерство Финансов	MUM180_0001	14.00%	2.00	08.июн.22
Министерство Финансов	MUM072_0013	14.50%	5.00	01.июн.22
Министерство Финансов	MUM180_0001	14.00%	2.00	01.июн.22
Министерство Финансов	MUM144_0003	14.50%	0.90	25.май.22
Министерство Финансов	MUM120_0017	13.62%	4.80	25.май.22
Министерство Финансов	MUM180_0001	14.00%	2.00	25.май.22
Министерство Финансов	MUM144_0003	14.50%	0.90	18.май.22
Министерство Финансов	MUM120_0017	13.62%	4.80	18.май.22
Министерство Финансов	MOM048_0052	13.75%	3.70	18.май.22
Министерство Финансов	MOM036_0091	13.85%	2.70	18.май.22
Министерство Финансов	MUM180_0001	14.00%	2.00	11.май.22

Ежедневный обзор

13 марта 2023 г.

Министерство Финансов	MUM144_0003	14.50%	1.00	11.май.22
Министерство Финансов	MOM036_0091	13.83%	2.80	11.май.22
Министерство Финансов	MOM048_0052	13.75%	3.70	05.май.22
Министерство Финансов	MUM120_0017	13.62%	4.80	05.май.22
Министерство Финансов	MUM132_0006	13.76%	3.20	28.апр.22
Министерство Финансов	MOM048_0052	13.79%	3.70	27.апр.22
Министерство Финансов	MUM180_0002	13.97%	2.20	27.апр.22
Министерство Финансов	MOM036_0091	13.81%	2.80	27.апр.22
Министерство Финансов	MOM048_0052	13.62%	3.80	20.апр.22
Министерство Финансов	MUM072_0013	13.55%	5.10	20.апр.22
Министерство Финансов	MUM072_0013	13.17%	5.10	13.апр.22
Министерство Финансов	MUM180_0002	13.69%	2.20	13.апр.22
Министерство Финансов	MOM036_0091	13.56%	2.80	13.апр.22
Министерство Финансов	MOM036_0091	12.84%	2.90	06.апр.22
Министерство Финансов	MOM048_0052	12.64%	3.80	06.апр.22
Министерство Финансов	MUM072_0013	12.50%	5.10	29.мар.22
Министерство Финансов	MOM036_0091	12.71%	2.90	29.мар.22
Министерство Финансов	MUM072_0013	12.50%	5.10	29.мар.22
Министерство Финансов	MOM048_0052	12.59%	3.80	24.мар.22
Министерство Финансов	MUM072_0013	12.63%	5.20	24.мар.22
Министерство Финансов	MUM012_0150	13.70%	0.90	16.мар.22
Министерство Финансов	MOM036_0091	12.72%	2.90	16.мар.22
Министерство Финансов	MOM048_0052	12.67%	3.90	16.мар.22
Министерство Финансов	MUM096_0011	13.21%	6.70	02.мар.22
Министерство Финансов	MUM180_0016	12.91%	14.90	02.мар.22
Министерство Финансов	MUM180_0015	11.10%	14.50	23.фев.22
Министерство Финансов	MUM096_0012	10.97%	7.40	23.фев.22
Министерство Финансов	MUM180_0002	10.73%	2.40	16.фев.22
Министерство Финансов	MUM120_0019	11.04%	9.10	16.фев.22
Министерство Финансов	MOM036_0091	10.75%	3.00	09.фев.22
Министерство Финансов	MUM132_0007	10.99%	10.50	09.фев.22
Министерство Финансов	MUM096_0013	11.00%	8.00	02.фев.22
Министерство Финансов	MUM156_0007	11.00%	12.00	02.фев.22
Министерство Финансов	MUM180_0016	11.05%	15.00	26.январ.22
Министерство Финансов	MUM072_0013	10.90%	5.30	26.январ.22
Министерство Финансов	MUM012_0150	10.30%	1.00	20.январ.22
Министерство Финансов	MOM048_0052	10.67%	4.00	19.январ.22
Министерство Финансов	MUM144_0009	10.87%	11.60	19.январ.22
Министерство Финансов	MUM096_0011	10.75%	6.80	19.январ.22
Министерство Финансов	MUM096_0012	10.75%	7.60	05.январ.22

Источник: KASE, *лет до погашения с момента размещения

Ежедневный обзор

13 марта 2023 г.

Таблица 6. Доля владения нот НБК нерезидентами, млрд тенге

Доля владения нот НБК нерезидентами						
Дата	Резиденты	Нерезиденты	Всего в обращении	Резиденты	Нерезиденты	Изменение (нерезиденты)
18.02.2023	2 495.23	90	2 585.23	96.5%	3.5%	0
10.02.2023	2 495.23	90	2 585.23	96.5%	3.5%	0
03.02.2023	2 307.85	90	2 397.85	96.2%	3.8%	0
27.01.2023	2 307.85	90	2 397.85	96.2%	3.8%	-10
20.01.2023	2 312.44	100	2 412.44	95.9%	4.1%	0
13.01.2023	2 312.44	100	2 412.44	95.9%	4.1%	0
06.01.2023	2 164.93	100	2 264.93	95.6%	4.4%	0
26.12.2022	1 629.02	100	1 729.02	94.2%	5.8%	0
15.12.2022	1 629.02	100	1 729.02	94.2%	5.8%	0
09.12.2022	1 512.83	100	1 612.83	93.8%	6.2%	0
02.12.2022	1 512.83	100	1 612.83	93.8%	6.2%	10
25.11.2022	1 473.73	90	1 563.73	94.2%	5.8%	0
18.11.2022	1 473.73	90	1 563.73	94.2%	5.8%	20
11.11.2022	1 257.63	70	1 327.63	94.7%	5.3%	0
04.11.2022	1 257.63	70	1 327.63	94.7%	5.3%	10
28.10.2022	1 102.35	60	1 162.35	94.8%	5.2%	-50.1
22.10.2022	1 511.10	110.1	1 621.20	93.2%	6.8%	20.1
14.10.2022	1 247.55	90	1 337.55	93.3%	6.7%	-29.85
07.10.2022	1 836.43	119.85	1 956.28	93.9%	6.1%	39.83
30.09.2022	1 661.29	80.02	1 741.31	95.4%	4.6%	-0.28
23.09.2022	1 585.08	80.3	1 665.38	95.2%	4.8%	0.3
16.09.2022	1 685.64	80	1 765.64	95.5%	4.5%	0
09.09.2022	1 413.61	80	1 493.61	94.6%	5.4%	-10.01
02.09.2022	1 827.90	90.01	1 917.92	95.3%	4.7%	18.26
27.08.2022	1 826.43	71.75	1 898.17	96.2%	3.8%	1.75
19.08.2022	1 751.17	70	1 821.17	96.2%	3.8%	-15.01
12.08.2022	1 825.29	85.01	1 910.30	95.5%	4.5%	0
05.08.2022	1 615.40	85.01	1 700.41	95.0%	5.0%	-5
29.07.2022	1 728.29	90.01	1 818.30	95.0%	5.0%	0
22.07.2022	1 618.52	90.01	1 708.53	94.7%	5.3%	-38.42
15.07.2022	1 656.94	100.01	1 756.96	94.3%	5.7%	60.63
08.07.2022	1 596.31	120.76	1 717.08	93.0%	7.0%	-112.64
01.07.2022	1 708.95	120.76	1 829.71	93.4%	6.6%	83.48
24.06.2022	1 625.47	130.76	1 756.23	92.6%	7.4%	18.43
17.06.2022	1 607.04	140.76	1 747.81	91.9%	8.1%	-42.97

Ежедневный обзор

13 марта 2023 г.

10.06.2022	1 650.01	140.76	1 790.78	92.1%	7.9%	19.7
03.06.2022	1 630.31	150.76	1 781.07	91.5%	8.5%	45.09
27.05.2022	1 585.22	150.76	1 735.99	91.3%	8.7%	-10
20.05.2022	1 578.15	160.76	1 738.91	90.8%	9.2%	0
13.05.2022	1 602.67	160.76	1 763.44	90.9%	9.1%	-20
06.05.2022	1 598.97	180.76	1 779.73	89.8%	10.2%	18.75
29.04.2022	1 610.90	162.01	1 772.92	90.9%	9.1%	0
22.04.2022	1 552.75	162.01	1 714.76	90.6%	9.4%	17.91
15.04.2022	1 435.62	144.1	1 579.72	90.9%	9.1%	14.09
08.04.2022	1 390.41	130.01	1 520.42	91.4%	8.6%	15
01.04.2022	1 354.55	115.01	1 469.56	92.2%	7.8%	40
25.03.2022	1 250.90	75.01	1 325.91	94.3%	5.7%	-71.34
18.03.2022	1 430.42	146.35	1 576.77	90.7%	9.3%	24.04
11.03.2022	1 341.62	122.31	1 463.93	91.6%	8.4%	-55.06
05.03.2022	1 683.99	177.37	1 861.36	90.5%	9.5%	-20.04
25.02.2022	1 679.87	197.41	1 877.28	89.5%	10.5%	45.59
18.02.2022	1 710.03	151.82	1 861.85	91.8%	8.2%	10.56
11.02.2022	1 770.99	141.26	1 912.25	92.6%	7.4%	12.25
04.02.2022	1 645.90	129.01	1 774.90	92.7%	7.3%	-13.03
28.01.2022	1 639.32	142.04	1 781.36	92.0%	8.0%	2
21.01.2022	1 693.79	140.04	1 833.83	92.4%	7.6%	10.09
14.01.2022	1 618.00	129.95	1 747.96	92.6%	7.4%	-62.43
06.01.2022	1 640.99	192.38	1 833.36	89.5%	10.5%	-18.92
31.12.2021	1 938.48	211.3	2 149.78	90.2%	9.8%	-0.38
24.12.2021	1 842.45	211.68	2 054.14	89.7%	10.3%	-4.2
15.12.2021	1 899.57	215.88	2 115.45	89.8%	10.2%	-111.93
10.12.2021	2 095.32	327.81	2 423.13	86.5%	13.5%	-45.31
03.12.2021	2 275.47	373.12	2 648.59	85.9%	14.1%	0.45
26.11.2021	2 152.41	372.67	2 525.08	85.2%	14.8%	-30.4
19.11.2021	2 086.03	403.07	2 489.11	83.8%	16.2%	22.58
12.11.2021	2 018.44	380.49	2 398.93	84.1%	15.9%	43
05.11.2021	2 036.33	337.49	2 373.82	85.8%	14.2%	-108.72
29.10.2021	2 546.32	446.21	2 992.54	85.1%	14.9%	25.45
22.10.2021	2 416.90	420.76	2 837.66	85.2%	14.8%	51.15
15.10.2021	2 425.02	369.61	2 794.62	86.8%	13.2%	-52.29
08.10.2021	2 433.47	421.9	2 855.37	85.2%	14.8%	2.78
01.10.2021	2 379.45	419.12	2 798.58	85.0%	15.0%	-52.09
24.09.2021	2 535.46	471.21	3 006.67	84.3%	15.7%	85.48
17.09.2021	2 432.57	385.73	2 818.29	86.3%	13.7%	33.05

Ежедневный обзор

13 марта 2023 г.

10.09.2021	2 424.57	352.68	2 777.26	87.3%	12.7%	-67.52
03.09.2021	2 690.72	420.2	3 110.91	86.5%	13.5%	-9.88
27.08.2021	2 793.58	430.08	3 223.66	86.7%	13.3%	-35
20.08.2021	2 782.93	465.08	3 248.01	85.7%	14.3%	-11.87
13.08.2021	2 730.47	476.95	3 207.42	85.1%	14.9%	49.15
06.08.2021	2 779.62	427.8	3 207.42	86.7%	13.3%	-53.43
30.07.2021	2 899.72	481.23	3 380.95	85.8%	14.2%	-26.2
23.07.2021	3 007.80	507.43	3 515.23	85.6%	14.4%	-49.44
16.07.2021	3 028.90	556.87	3 585.77	84.5%	15.5%	19
09.07.2021	3 029.13	537.87	3 567.00	84.9%	15.1%	12.08
03.07.2021	3 017.83	525.79	3 543.62	85.2%	14.8%	11.11
25.06.2021	2 941.48	514.68	3 456.16	85.1%	14.9%	-57.66
18.06.2021	2 900.83	572.34	3 473.17	83.5%	16.5%	26.06
11.06.2021	2 945.94	546.28	3 492.22	84.4%	15.6%	-28.41
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

Источник: Национальный Банк РК

АО «Halyk Finance»

Департамент исследований

E-mail
research@halykfinance.kz

Департамент продаж

E-mail
sales@halykfinance.kz

Адрес:

Halyk Finance
пр. Абая, 109 «В», 5 этаж
A05A1B4, Алматы, Республика Казахстан
Тел. +7 727 339 43 77
www.halykfinance.kz

Bloomberg
HLFN
Refinitiv
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».