



Ежедневный обзор

Фондовые индексы закрылись смешанно

Ежедневный обзор

23 октября 2024 г.

Коротко на текущий момент:

- Фондовые индексы закрылись смешанно;
- Акции General Motors выросли после отчета за третий квартал;
- Акции Verizon Communications упали на 5%;
- Результаты отчета Danaher оказались выше ожиданий;
- Freeport-McMoRan показывает отличные результаты;
- Акции GE Aerospace снизились;
- Отчет Phillip Morris спровоцировал бурный рост котировок;
- Texas Instruments растет после публикации отчета;
- МВФ сохранил прогноз роста ВВП Казахстана на 2024 г.;
- Народный банк Казахстана выпустит облигации на T20 млрд.

Валютный рынок:

- Индекс доллара США (DXY), показывающий отношение курса доллара к корзине из шести мировых валют, вырос на 0.1% до уровня в 104.1 п.;
- Курс USD/KZT ослаб на 0.5% до уровня в 485.3.

Стоимость Brent поднялась до уровня \$76.0

Во вторник цена на нефть поднялась на 2.4% до \$76 за барр. на фоне продолжающегося геополитического конфликта на Ближнем Востоке, несмотря на увеличение запасов нефти в США. Вчера Правительство Израиля подтвердило ликвидацию Хашема Сафиеддина, наследника покойного лидера «Хезболлы» Хасана Насраллы, который был убит в прошлом месяце в результате израильской атаки, направленной против поддерживаемой Ираном ливанской военизированной группировки. Во вторник также вышли данные о недельных запасах сырой нефти в США, которые составили 1.6 млн барр., против консенсус-прогноза в 0.7 млн барр. Однако новости о запасах сырой нефти существенно не повлияли на цены на нефть.

Фондовые индексы

Индексы	Регион	Посл. знач.	Изменение	
			За день	С начала года
Americas				
S&P 500	США	5 851.2	-0.05%	22.32%
Dow Jones	США	42 924.9	-0.02%	13.83%
NASDAQ	США	18 573.1	0.18%	23.04%
EMEA				
Euro Stoxx 50	Еврозона	4 939.3	-0.04%	9.41%
FTSE 100	Великобритания	8 306.5	-0.14%	7.56%
CAC 40	Франция	7 535.1	-0.01%	0.00%
DAX	Германия	19 421.9	-0.20%	16.29%
IBEX 35	Испания	11 832.7	-0.07%	17.32%
FTSE MIB	Италия	34 733.5	-0.64%	14.51%
Asia/Pacific				
Nikkei 225	Япония	38 412.0	-1.39%	14.53%
Hang Seng	Гонконг	20 499.0	0.10%	20.27%
Shanghai	Китай	3 285.9	0.54%	11.21%
Sensex	Индия	81 151.3	-0.09%	12.07%
Singapore	Сингапур	3 587.4	-0.75%	11.60%
Emerging markets				
Bovespa	Бразилия	129 951.4	-0.31%	-3.16%
RTSI\$	Россия	1 151.9	-0.20%	5.59%
NIFTY 50	Индия	24 472.1	-1.25%	12.37%
Borsa Index	Турция	8 838.6	2.13%	19.50%
KASE	Казахстан	5 231.9	1.22%	25.74%

Товарный рынок

	Знач.	Изменение			
		1D	1W	1M	YTD
Brent	76.0	2.4%	2.4%	2.9%	-1.3%
Медь	9 583.0	0.3%	0.6%	0.4%	11.7%
Цинк	3 137.5	2.0%	2.8%	8.8%	18.0%
Золото	2 749.0	1.1%	3.2%	4.6%	33.3%
Серебро	34.9	3.2%	10.7%	13.6%	46.5%
Природный газ	2.3	0.0%	-7.5%	-11.6%	-8.1%
Алюминий	2 633.5	1.5%	2.5%	5.6%	10.5%

Ежедневный обзор

23 октября 2024 г.

»» Фондовые индексы закрылись смешанно

Фондовые индексы США показали смешанную динамику. S&P 500 снизился на 0.05% за счет снижения акций промышленного сектора (-1.2%), сырьевого сектора (-0.9%) и сектора здравоохранения (-0.2%). Доходность по 10-летним казначейским облигациям продолжает рост в связи с ростом ставок Уолл-стрит на то, что бывший президент Дональд Трамп вновь займет Белый дом. По мнению участников рынка, президентство Трампа может означать рост дефицита бюджета и инфляции, что может отрицательно сказываться на фондовом рынке. Многие зависят от того, сможет ли он реализовать свою программу. Контроль над Конгрессом, особенно над Палатой представителей, остается нестабильным.

Финансовые результаты General Motors превзошли ожидания рынка, за счет чего акции производителя автомобилей выросли на 9.8%. Кроме того, несколько компаний, включая крупнейшего производителя табачных изделий Phillip Morris и производителя медицинского оборудования Danaher, представили улучшенные прогнозы на 2024 г.

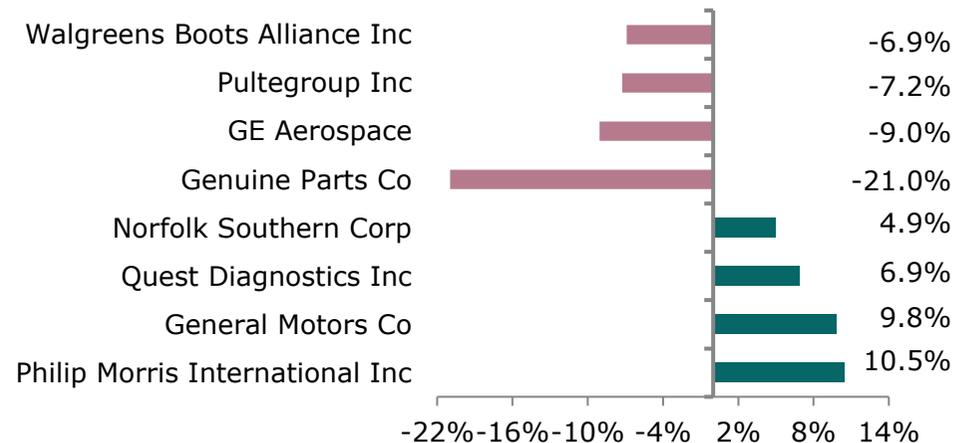
На этой неделе мы уделяем особое внимание выходу отчета о продажах на вторичном рынке жилья за сентябрь 2024 г. В то же время, участники торгов обратят внимание на квартальную отчетность телекоммуникационной компании AT&T и производителя автомобилей Tesla, чьи финансовые результаты будут опубликованы завтра.

»» Акции General Motors выросли после отчета за третий квартал

Акции производителя автомобилей General Motors выросли на 9.8% после выпуска отчета за третий квартал. Выручка компании составила \$48.76 млрд, превысив ожидания в \$44.74 млрд. Прибыль на акцию составила \$2.96, против консенсуса в \$2.4.

Наряду с сильными квартальными данными, GM повысила финансовые прогнозы на весь год. Теперь руководство компании ожидает, что операционная прибыль в 2024 г. составит от \$14 млрд до \$15 млрд, по сравнению с предыдущим прогнозом в \$13-15 млрд. К сентябрю операционная прибыль GM составила

Лидеры и аутсайдеры индекса S&P 500



Долговой рынок

	Валюта	YTM	YTM на			
			1D	1W	1M	YTD
US Treasuries (10YR)	US\$	4.23%	4.21%	4.01%	3.74%	4.03%
US Treasuries (30YR)	US\$	4.51%	4.50%	4.30%	4.08%	3.93%
UK Gilts (30YR)	GBP	4.17%	4.14%	4.16%	3.89%	4.49%
Germany (10YR)	EUR	2.32%	2.28%	2.22%	2.20%	2.48%
Kazakhstan (3YR)	US\$	4.65%	4.77%	4.78%	4.80%	3.49%

Валютный рынок

	Знач.	Изменение			
		1D	1W	1M	YTD
DXY	104.1	0.1%	0.8%	3.4%	0.7%
USD/KZT	485.3	0.5%	-0.1%	1.1%	8.9%
USD/RUB	95.8	-0.7%	-1.2%	3.0%	5.2%
EUR/USD	1.08	-0.1%	-0.9%	-2.8%	-0.5%
GBP/USD	1.30	0.0%	-0.7%	-2.7%	2.2%
USD/JPY	151.1	0.2%	1.3%	5.2%	4.4%

Ежедневный обзор

23 октября 2024 г.

\$12.4 млрд. Аналитики Уолл-стрит в настоящее время прогнозируют операционную прибыль в четвертом квартале в размере \$2.4 млрд.

GM также повысила свой прогноз по свободному денежному потоку. Средняя точка диапазона прогнозов теперь составляет \$13 млрд, по сравнению с предыдущим прогнозом в \$10.5 млрд. Увеличение прогноза обусловлено сильным свободным денежным потоком в третьем квартале в размере \$5.8 млрд. Аналитики Уолл-стрит прогнозировали свободный денежный поток в размере \$3 млрд за квартал.

»» **Акции Verizon Communications упали на 5%**

Акции телекоммуникационной компании Verizon Communications упали после того, как компания опубликовала данные о прибыли за третий квартал. Согласно отчету компании, прибыль на акцию составила \$1.19, против прогноза в \$1.18. Однако выручка компании оказалась ниже ожиданий, \$33.3 млрд, против консенсус-прогноза в \$33.44 млрд. Выручка от продажи оборудования беспроводной связи в этом квартале составила \$5.3 млрд, снизившись на 8.1% по сравнению с предыдущим годом, в основном из-за снижения объемов модернизации.

Verizon сообщила о том, что число новых клиентов составило 239 000, выше ожидаемого уровня 221 000. Общее количество широкополосных подключений выросло до 11.9 млн на конец квартала, что на 16% больше, чем в предыдущем году. Прогнозный диапазон компании по прибыли на акцию за 2024 год составил \$4.50-\$4.70, в то время как аналитики Уолл-стрит ожидают \$4.59.

»» **Результаты отчета Danaher оказались выше ожиданий аналитиков**

Компания Danaher, занимающаяся производством и поставкой медицинского оборудования и технологий для лабораторий, опубликовала отчет за третий квартал, превзойдя ожидания Уолл-стрит по прибыли и продажам, что связано с растущим спросом на медицинский продукт Serheid, предназначенным для тестирования на различные виды заболеваний. Акции компании

Ежедневный обзор

23 октября 2024 г.

упали на 4% за основную торговую сессию. Президент и генеральный директор Райнер Блэр отметил позитивную динамику в бизнесе биопроцессинга и увеличение доли рынка Serheid в молекулярном тестировании.

Выручка за третий квартал увеличилась на 3% до \$5.8 млрд, что выше среднего прогноза аналитиков в \$5.6 млрд. Прибыль составила \$818 млн или \$1.12 на акцию за третий квартал по сравнению с \$1.13 млрд или \$1.26 на акцию годом ранее. Скорректированная прибыль составила \$1.71 на акцию, превысив прогноз в \$1.57 на акцию. Компания подтвердила свой прогноз на 2024 год по несущественному снижению выручки.

»» **Freeport-McMoRan показывает отличные результаты на фоне роста спроса на золото и медь**

Freeport-McMoRan сообщила о финансовых результатах за третий квартал 2024. Данные оказались выше ожиданий аналитиков, благодаря высоким объёмам продаж меди и золота. Акции компании выросли на 1.2% за основную торговую сессию. Выручка выросла до \$6.8 млрд с \$5.8 млрд, превысив ожидания в \$6.5 млрд. Чистая прибыль составила \$526 миллионов (36 центов на акцию) за третий квартал по сравнению с \$454 млн (\$0.31 на акцию) годом ранее. Консенсус-прогноз составлял \$0.35 на акцию. Скорректированная прибыль на акцию составила \$0.38, что выше прогноза в \$0.37.

Freeport-McMoRan сообщила, что объёмы продаж меди и золота превысили июльские оценки. Менеджмент компании сообщает, что Freeport-McMoRan сосредоточена на успешной реализации своих планов по всему миру и решении проблем, возникших из-за недавнего пожара, повлиявшего на часть новых плавильных мощностей в Индонезии.

»» **Акции GE Aerospace снизились, несмотря на то что компания превысила прогнозы аналитиков**

GE Aerospace сообщила о квартальной прибыли \$1.15 на акцию при продажах \$9.6 миллиарда, превысив ожидания Уолл-Стрит, которые составляли \$1.13 и \$9 миллиардов соответственно.

Ежедневный обзор

23 октября 2024 г.

Объем заказов достиг \$12.6 миллиарда, а прогноз операционной прибыли на год повысился до \$6.7–\$6.9 миллиарда. Тем не менее, акции компании упали на 9.1% до \$176.7 после публикации результатов, несмотря на то что с начала года они выросли на 91%.

Аналитики оценили квартал как «хороший» с маржой операционной прибыли 25.7%, что выше показателя прошлого года. Прогноз по прибыли на акцию увеличился до \$4.20–\$4.35. Ожидания перед отчетом были высоки, что могло способствовать падению акций после публикации.

В то время как поставки двигателей LEAP снизились на 6% из-за забастовки в Boeing, CEO Ларри Калп отметил, что это не оказало значительного влияния на бизнес. Аналитики продолжают рекомендовать акции GE Aerospace как «Покупка» с целевыми ценами от \$196 до \$220, указывая на сильные перспективы для 2025 года, несмотря на недавнее падение.

»» Отчет Phillip Morris спровоцировал бурный рост котировок

Во вторник отчитался один из крупнейших производителей табачной продукции – Phillip Morris (+10.5%). Квартальные результаты компании приятно удивили инвесторов как ростом выручки, так и увеличением прибыльности. Phillip Morris сообщила о выручке в \$9.91 млрд за квартал, что на 8.4% выше, чем годом ранее. Прибыль на акцию составила \$1.91 по сравнению с \$1.67 годом ранее. Заявленная выручка соответствует консенсус-оценке рынка в 9.57 млрд долларов, побив его на 3.55%. Прибыль на акцию превзошла ожидания на 4.37%, превысив консенсус-оценку в \$1.83.

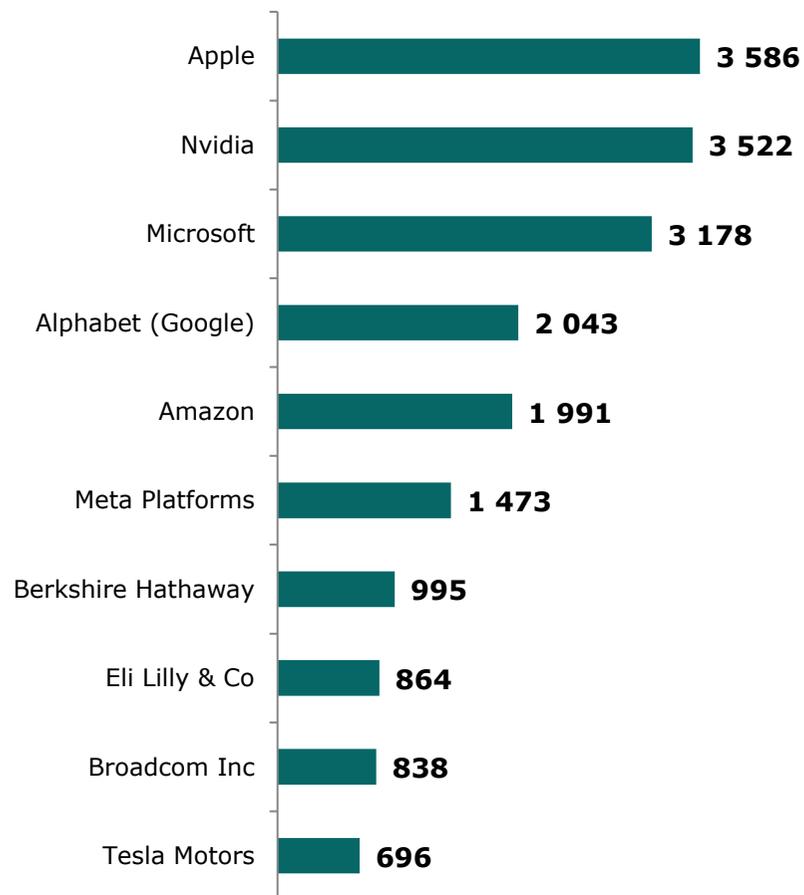
»» Texas Instrument растет после публикации отчета

Компания Texas Instruments снизила прогноз выручки на декабрьский квартал. После закрытия торгов акции сначала упали, а затем выросли на 3%. В сентябре прибыль на акцию составила \$1.47, что выше консенсус-оценки Уолл-стрит в \$1.38. Выручка достигла \$4.15 млрд, немного превысив ожидания аналитиков в \$4.12 млрд.

Ежедневный обзор

23 октября 2024 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%	-2.8	503	100%
Information Technology	0.2%	2.9	69	32.4%
Financials	-0.1%	-0.9	72	13.2%
Health Care	-0.2%	-1.0	62	11.2%
Consumer Discretionary	-0.3%	-1.6	50	9.8%
Communications Services	0.4%	1.8	22	8.8%
Industrials	-1.2%	-6.0	78	8.5%
Consumer Staples	0.9%	3.1	38	5.8%
Energy	0.2%	0.4	22	3.4%
Utilities	-0.4%	-0.6	31	2.5%
Real Estate	0.2%	0.2	31	2.3%
Materials	-0.9%	-1.1	28	2.2%

Ставки Libor

Libor (USD)	Знач.	Значение на дату			
		1D	1W	1M	YTD
LIBOR1M	4.96%	4.96%	4.97%	5.29%	5.26%
LIBOR3M	4.85%	4.85%	4.93%	5.28%	5.54%
LIBOR6M	4.68%	4.69%	4.76%	5.13%	5.81%
LIBOR12M	6.04%	5.96%	5.93%	5.72%	5.96%

Ежедневный обзор

23 октября 2024 г.

- **МВФ сохранил прогноз роста ВВП Казахстана на 2024 г. на уровне 3.5%**

Международный валютный фонд (МВФ) ожидает рост ВВП Казахстана в 2024 г. на уровне 3.5%, сообщается в опубликованном во вторник обзоре мировой экономики (World Economic Outlook).

В предыдущем, июньском обзоре МВФ прогнозировал увеличение ВВП Казахстана в 2024 году на 3.5%.

Согласно текущему обзору, в 2025 г. ВВП Казахстана вырастет, как прогнозируется, на 4.6%. Прогноз на 2029 г. – рост на 3%.

МВФ ожидает, что среднегодовая инфляция в Казахстане в 2024 г. замедлится до 8.6% с 14.6% в 2023 году, и продолжит замедление до 7.2% в 2025 г. Прогноз на 2029 г. – 5%.

Дефицит счета текущих операций платежного баланса Казахстана в 2024 году прогнозируется на уровне 1.5% ВВП, в 2025 г. – 2.7% ВВП. Оценка на 2029 г. – профицит на уровне 3.4% ВВП.

Как сообщалось, рост экономики Казахстана в 2023 г. составил 5.1%, инфляция составила 9.8%.

Источник: Интерфакс

- **Народный банк Казахстана выпустит облигации на T20 млрд**

Народный банк Казахстана планирует восьмой выпуск купонных облигаций без обеспечения в пределах третьей облигационной программы на общую сумму T20 млрд, сообщается на Казахстанской фондовой бирже (KASE).

Номинальная стоимость одной облигации составляет T1 тыс., количество размещаемых эмиссионных ценных бумаг – 20 млн штук.

Отмечается, что ставка купонного вознаграждения по облигациям является плавающей с привязкой к TONIA Compounded на весь срок обращения бумаг, фиксируется каждые 6 месяцев.

Согласно размещенному на KASE документу, решение было принято советом директоров банка 8 октября.

Народный банк контролируют Динара и Тимур Кулибаевы через АО «Холдинговая группа «Алмэкс» (56.39%), номинальным держателем является The Bank of New York с долей 23.04%. Акции банка торгуются на Казахстанской фондовой бирже, GDR – на Лондонской фондовой бирже и AIX.

По данным Нацбанка, Народный банк на 1 сентября 2024 г. занял 1-е место по объему активов (T17.2 трлн) среди банков в Казахстане.

Источник: Интерфакс

Ежедневный обзор

23 октября 2024 г.

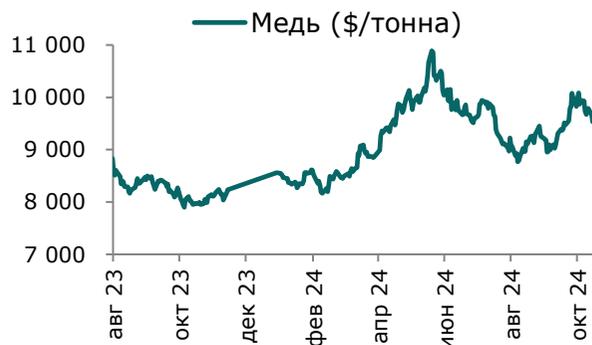
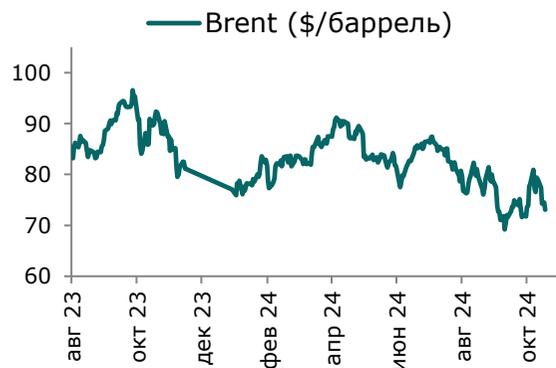
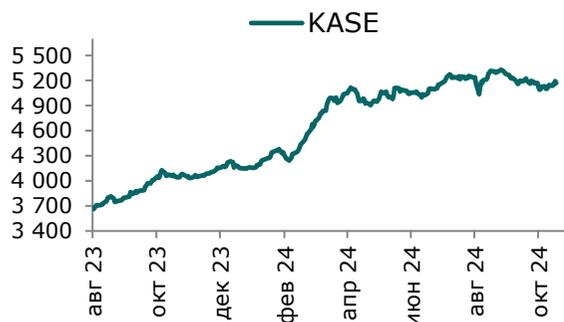
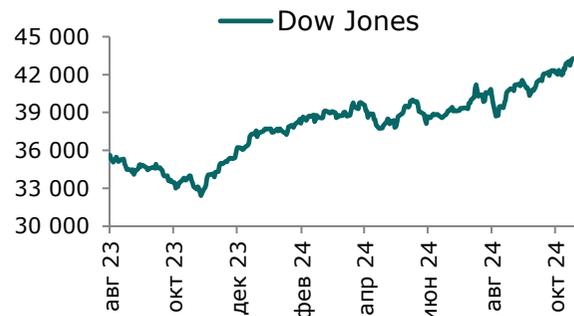
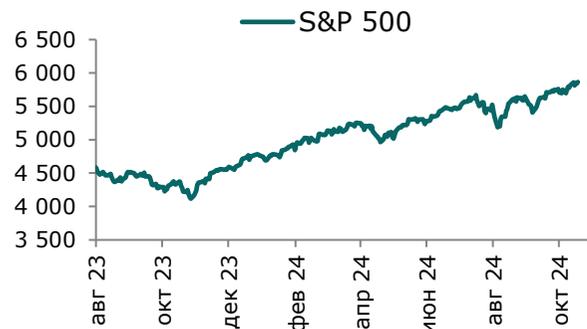
Таблица 1. Динамика изменения валют стран СНГ развивающихся и развитых стран

Валютная пара (индекс)	Страна	Базовая ставка	Инфляция* 2022	Инфляция* 2023	Курс	1D	1W	1M	YTD
USD/KZT	Казахстан	14.25%	14.9%	14.8%	485.3	0.5%	-0.1%	1.1%	8.9%
USD/RUB	Россия	19.00%	13.8%	6.0%	95.8	-0.7%	-1.2%	3.0%	5.2%
USD/GEL	Грузия	8.00%	9.4%	2.4%	2.7	0.4%	0.7%	0.3%	5.3%
USD/KGS	Кыргызстан	9.00%	14.7%	8.0%	85.4	0.0%	0.0%	1.5%	-2.2%
USD/TJS	Таджикистан	9.00%	4.5%	3.8%	10.7	0.0%	0.2%	0.3%	-2.1%
USD/UZS	Узбекистан	13.50%	12.3%	8.8%	12 816	0.0%	0.1%	0.7%	11.2%
USD/UAH	Украина	13.00%	20.1%	13.4%	41.3	-0.2%	0.0%	-0.4%	11.9%
Развивающиеся страны									
USD/CNY	Китай	4.35%	2.0%	0.2%	7.1	0.0%	0.1%	0.1%	-1.7%
USD/BRL	Бразилия	10.75%	9.3%	4.6%	5.7	-0.1%	0.5%	4.0%	17.3%
USD/INR	Индия	6.50%	6.7%	5.7%	84.1	0.0%	0.0%	0.5%	2.3%
USD/ZAR	ЮАР	8.00%	6.9%	5.9%	17.5	-0.4%	-0.5%	1.1%	-6.5%
USD/TRY	Турция	50.00%	72.0%	53.4%	34.3	0.1%	0.1%	0.4%	31.3%
Развитые страны									
DXU	США	5.00%	8.0%	4.1%	104.1	0.1%	0.8%	3.4%	0.7%
USD/CAD	Канада	4.25%	6.8%	3.9%	1.4	-0.1%	0.3%	2.0%	4.0%
GBP/USD	Великобритания	5.00%	9.1%	7.4%	1.3	0.0%	-0.7%	-2.7%	2.2%
USD/CHF	Швейцария	1.00%	2.8%	2.2%	0.9	-0.1%	0.4%	2.1%	-3.7%
USD/JPY	Япония	0.25%	2.5%	3.3%	151.1	0.2%	1.3%	5.2%	4.4%
USD/KRW	Южная Корея	3.25%	5.1%	3.6%	1 377.3	-0.1%	0.9%	3.3%	6.1%

Источник: Bloomberg. *показатель темпов инфляции в среднем за год

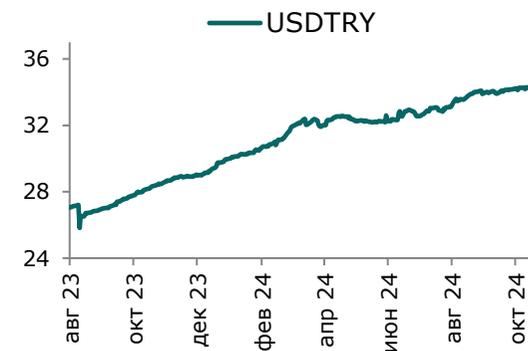
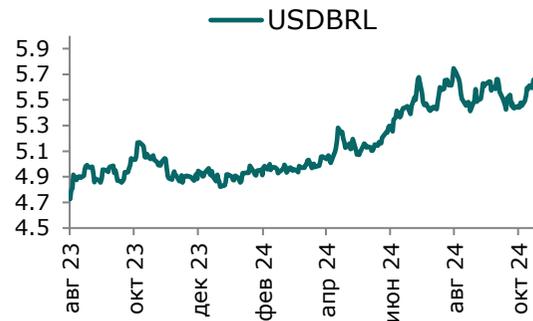
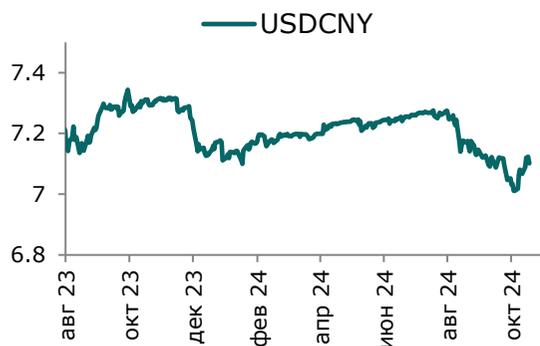
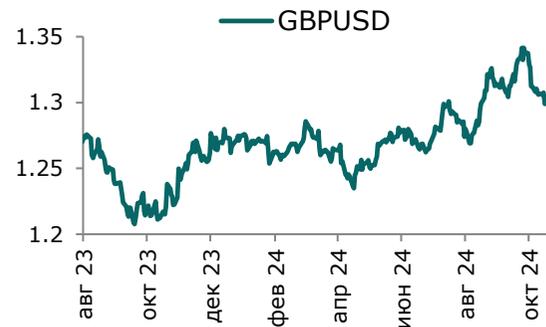
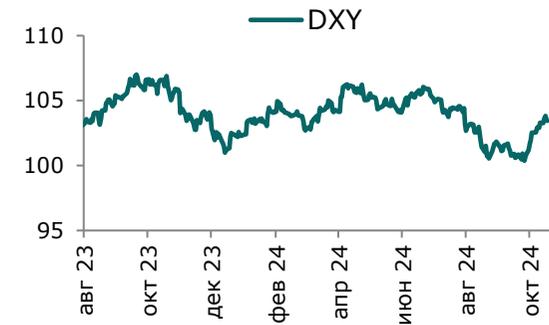
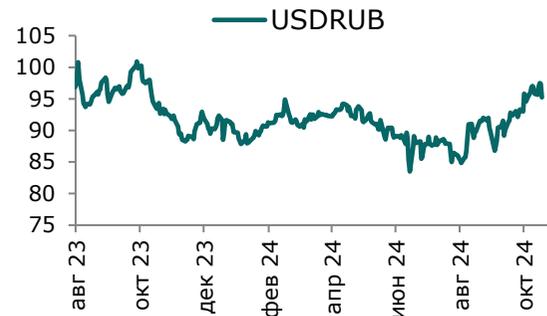
Ежедневный обзор

23 октября 2024 г.



Ежедневный обзор

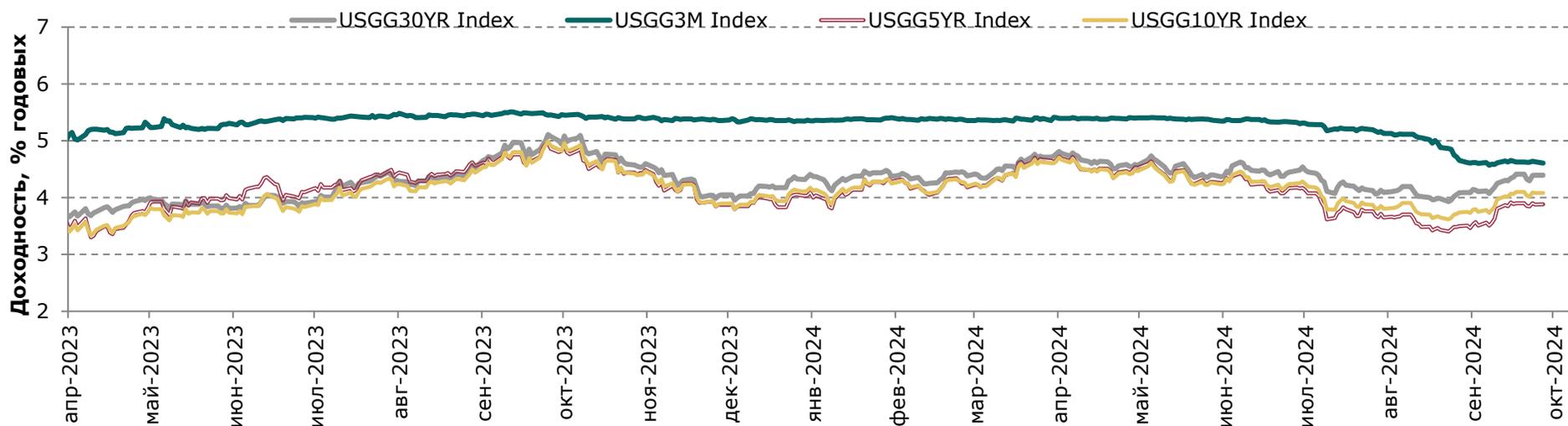
23 октября 2024 г.



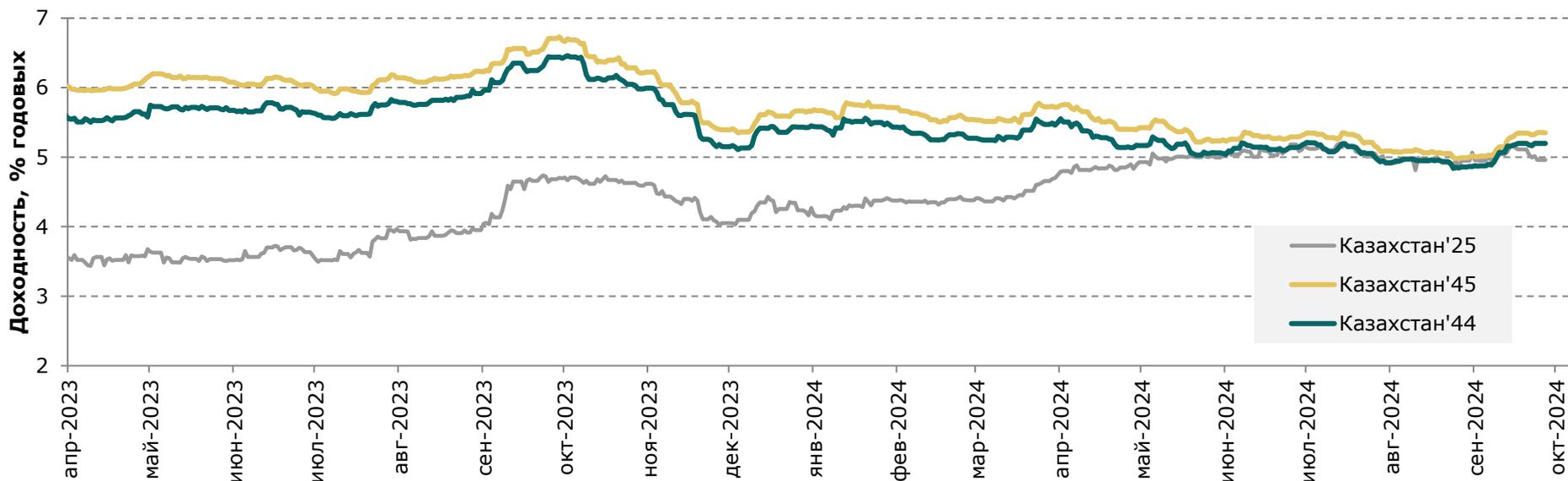
Ежедневный обзор

23 октября 2024 г.

Доходность государственных ценных бумаг США



Динамика доходности суверенных облигаций РК



Ежедневный обзор

23 октября 2024 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	94.28	95.14	3.72	3.23	116.89	137.44	30.09.2026	500	1.87
KAZAKS 1 1/2 09/30/34	EUR	1.50	84.84	85.58	3.32	3.22	90.39	108.03	30.09.2034	650	8.94
KAZAKS 6 1/2 07/21/45	USD	6.50	113.81	114.75	5.39	5.32	164.24	90.58	21.07.2045	1500	11.78
KAZAKS 5 1/8 07/21/25	USD	5.13	100.00	100.34	5.11	4.65	59.03	57.81	21.07.2025	2500	0.71
KAZAKS 4 7/8 10/14/44	USD	4.88	95.58	96.43	5.23	5.16	147.82	74.89	14.10.2044	1000	12.49
KAZAKS 2 3/8 11/09/28	EUR	2.38	96.56	97.34	3.30	3.08	96.48	120.88	09.11.2028	525	3.70
НК КазМунайГаз											
KZOKZ 6 3/8 10/24/48	USD	6.38	96.41	97.22	6.68	6.61	296.16	221.59	24.10.2048	1500	11.64
KZOKZ 5 3/4 04/19/47	USD	5.75	89.64	90.56	6.64	6.56	290.91	216.56	19.04.2047	1250	11.96
KZOKZ 5 3/8 04/24/30	USD	5.38	99.56	100.44	5.47	5.28	178.96	146.80	24.04.2030	1250	4.59
KZOKZ 3 1/2 04/14/33	USD	3.50	85.44	86.34	5.69	5.54	200.28	158.22	14.04.2033	750	7.10
KZOKZ 4 3/4 04/19/27	USD	4.75	98.87	99.87	5.24	4.81	132.04	111.91	19.04.2027	248	2.32
Самрук Казына											
SAMRUK 2 10/28/26	USD	2.00	93.33	94.36	5.55	4.98	149.61	131.88	28.10.2026	500	1.91
КазТрансГаз											
KZTGKZ 4 3/8 09/26/27	USD	4.38	96.28	97.34	5.77	5.37	191.02	170.44	26.09.2027	706	2.69
Банк Развития Казахстана											
DBKAZ 5 3/4 05/12/25	USD	5.75	99.61	100.01	6.48	5.73	167.04	169.47	12.05.2025	336	0.52
DBKAZ 6 03/23/26	USD	6.00	99.70	100.43	6.22	5.68	202.10	187.24	23.03.2026	107	1.33
DBKAZ 2.95 05/06/31	USD	2.95	85.67	86.47	5.60	5.44	193.13	156.15	06.05.2031	255	5.69
ТенгизШевройл											
TENGIZ 4 08/15/26	USD	4.00	96.95	97.68	6.07	5.56	193.15	177.71	15.08.2026	1000	1.47
TENGIZ 3 1/4 08/15/30	USD	3.25	85.55	86.48	6.25	6.04	256.43	222.53	15.08.2030	750	5.10
TENGIZ 2 5/8 08/15/25	USD	2.63	96.91	97.96	6.59	5.22	165.47	163.85	15.08.2025	500	0.78

Ежедневный обзор

23 октября 2024 г.

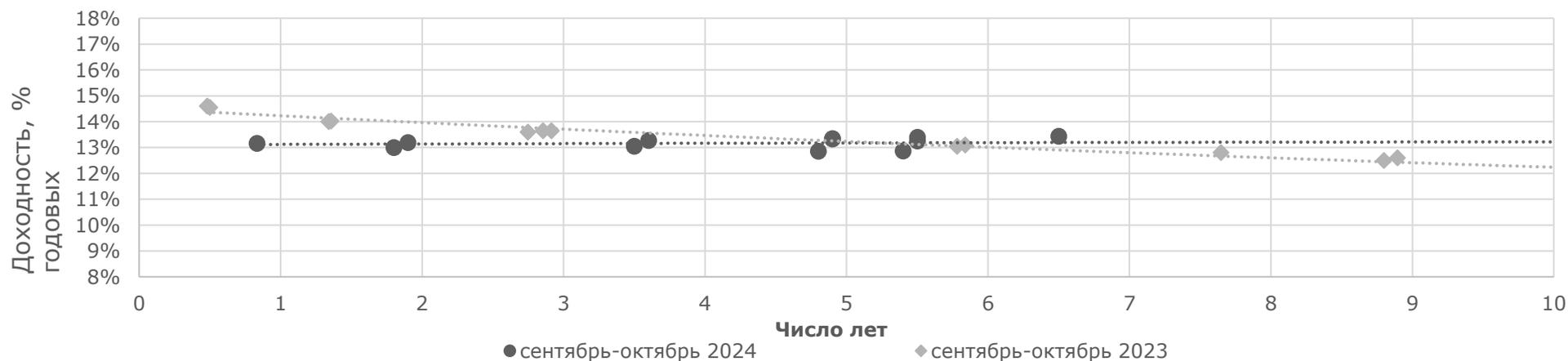
Таблица 3. Информация по узбекским еврооблигациям

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 5.375 02/20/2029	USD	5.38%	96.24	97.01	6.38	6.17	268.72	241.46	20.02.2029	500	3.75
UZBEK 3.700 11/25/2030	USD	3.70%	85.71	86.53	6.59	6.41	289.22	254.27	25.11.2030	555	5.19
НБ Республики Узбекистан											
NBUZB 4.85 10/21/2025	USD	4.85%	98.11	98.81	6.85	6.10	234.27	229.86	21.10.2025	300	0.95
Узпромстройбанк											
SQBZU 5.75 12/02/2024	USD	5.75%	99.77	100.61	7.71	0.26	-93.37	-82.37	02.12.2024	78	0.11
Ипотека Банк											
IPTBZU 5.5 11/19/2025	USD	5.50%	98.17	98.74	7.29	6.73	292.68	286.04	19.11.2025	300	1.00

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%	82.73	83.02	8.81	8.75	355.40	318.48	01.08.2029	750	5.47
CYDSA SAB DE CV	USD	6.25%	90.75	91.99	8.45	8.14	323.89	255.57	04.10.2027	402	4.31
BUKIT MAKMUR MANDIRI UTA	USD	5.50%	89.18	90.34	11.46	11.03	412.67	398.58	14.05.2027	400	2.96
EMPRESA ELECTRICA COCHRA	USD	5.00%	87.58	88.90	11.08	10.43	357.43	332.63	07.05.2028	315	2.27
IOCHPE-MAX/MAX WHEELS MX	USD	6.00%	87.11	88.49	7.77	7.45	272.39	178.59	21.09.2027	400	4.90
ADECOAGRO SA	USD	4.25%	94.86	95.72	7.19	6.98	197.04	236.01	31.10.2024	500	4.35

Кривая доходности ГЦБ РК



Ежедневный обзор

23 октября 2024 г.

Таблица 5. Последние размещения ГЦБ

Эмитент	Тикер	Доходность	Лет до погашения*	Дата размещения
Ценные бумаги Министерства Финансов				
Министерство Финансов	MUM180_0016	13.12%	12.30	15.окт.2024
Министерство Финансов	MUM168_0005	13.12%	10.40	15.окт.2024
Министерство Финансов	MUM096_0012	12.85%	4.80	15.окт.2024
Министерство Финансов	MUM072_0015	12.86%	5.40	15.окт.2024
Министерство Финансов	MOM060_0052	12.99%	1.80	15.окт.2024
Министерство Финансов	MUM192_0002	13.05%	3.50	08.окт.2024
Министерство Финансов	MUM072_0015	13.25%	5.50	24.сен.2024
Министерство Финансов	MUM300_0003	13.31%	15.40	17.сен.2024
Министерство Финансов	MUM096_0012	13.34%	4.90	17.сен.2024
Министерство Финансов	MOM060_0052	13.19%	1.90	10.сен.2024
Министерство Финансов	MUM072_0015	13.39%	5.50	10.сен.2024
Министерство Финансов	MUM192_0002	13.27%	3.60	10.сен.2024
Министерство Финансов	MUM096_0012	13.33%	4.90	03.сен.2024
Министерство Финансов	MUM084_0019	13.43%	6.50	03.сен.2024
Министерство Финансов	MKM012_0158	13.16%	0.83	03.сен.2024
Министерство Финансов	MUM096_0012	13.35%	4.90	27.авг.2024
Министерство Финансов	MUM156_0005	13.30%	2.80	27.авг.2024
Министерство Финансов	MUM180_0015	13.28%	12.00	27.авг.2024
Министерство Финансов	MUM300_0001	13.17%	14.30	27.авг.2024
Министерство Финансов	MUM084_0019	13.43%	6.50	26.авг.2024
Министерство Финансов	MUM120_0017	13.41%	2.60	26.авг.2024
Министерство Финансов	MUM120_0018	13.27%	2.80	20.авг.2024
Министерство Финансов	MUM300_0002	13.16%	14.70	20.авг.2024
Министерство Финансов	MUM192_0002	13.29%	3.60	13.авг.2024
Министерство Финансов	MUM108_0012	13.26%	1.90	13.авг.2024
Министерство Финансов	MUM096_0012	13.41%	4.90	06.авг.2024
Министерство Финансов	MKM012_0158	13.20%	0.90	06.авг.2024
Министерство Финансов	MUM084_0019	13.43%	6.50	26.авг.2024
Министерство Финансов	MUM120_0017	13.41%	2.60	26.авг.2024
Министерство Финансов	MUM300_0003	13.26%	15.40	23.июль.2024
Министерство Финансов	MUM072_0015	13.43%	5.50	23.июль.2024
Министерство Финансов	MUM108_0012	13.30%	1.90	23.июль.2024
Министерство Финансов	MUM168_0005	13.35%	10.50	23.июль.2024
Министерство Финансов	MUM240_0001	13.44%	7.60	23.июль.2024
Министерство Финансов	MUM192_0002	13.27%	3.70	23.июль.2024
Министерство Финансов	MKM012_0158	13.23%	1.00	16.июль.2024
Министерство Финансов	MUM108_0013	13.45%	4.60	16.июль.2024
Министерство Финансов	MUM156_0005	13.39%	2.90	16.июль.2024
Министерство Финансов	MUM084_0019	13.49%	6.50	16.июль.2024
Министерство Финансов	MUM180_0013	13.33%	8.60	16.июль.2024
Министерство Финансов	MUM180_0016	13.30%	12.40	16.июль.2024
Министерство Финансов	MUM108_0012	13.42%	2.00	09.июль.2024
Министерство Финансов	MUM072_0015	13.49%	5.60	09.июль.2024
Министерство Финансов	MUM156_0007	13.49%	9.50	09.июль.2024

Ежедневный обзор

23 октября 2024 г.

Министерство Финансов	MUM240_0001	13.50%	7.80	09.июль.2024
Министерство Финансов	MUM192_0002	13.50%	3.70	09.июль.2024
Министерство Финансов	MUM156_0005	13.45%	2.90	02.июль.2024
Министерство Финансов	MUM012_0158	13.34%	1.00	02.июль.2024
Министерство Финансов	MUM108_0013	13.47%	4.70	02.июль.2024
Министерство Финансов	MUM084_0019	13.36%	6.50	02.июль.2024
Министерство Финансов	MOM048_0054	13.40%	2.20	25.июнь.2024
Министерство Финансов	MUM180_0016	13.49%	12.40	25.июнь.2024
Министерство Финансов	MUM072_0015	13.43%	5.60	25.июнь.2024
Министерство Финансов	MUM192_0002	13.43%	3.80	25.июнь.2024
Министерство Финансов	MUM168_0003	13.49%	7.70	25.июнь.2024
Министерство Финансов	MUM120_0017	13.40%	2.70	21.июнь.2024
Министерство Финансов	MUM240_0002	13.40%	9.80	21.июнь.2024
Министерство Финансов	MUM012_0157	13.39%	0.80	21.июнь.2024
Министерство Финансов	MUM108_0014	13.36%	7.80	21.июнь.2024
Министерство Финансов	MUM084_0019	13.29%	6.70	18.июнь.2024
Министерство Финансов	MUM168_0005	13.33%	10.70	18.июнь.2024
Министерство Финансов	MUM108_0013	13.35%	4.80	18.июнь.2024
Министерство Финансов	MUM180_0006	13.34%	2.80	18.июнь.2024
Министерство Финансов	MUM180_0014	13.31%	8.80	18.июнь.2024
Министерство Финансов	MUM012_0157	13.20%	0.80	18.июнь.2024
Министерство Финансов	MUM240_0001	13.10%	7.90	11.июнь.2024
Министерство Финансов	MUM240_0002	13.13%	9.90	11.июнь.2024
Министерство Финансов	MUM192_0002	13.14%	3.80	11.июнь.2024
Министерство Финансов	MUM072_0015	13.11%	5.70	11.июнь.2024
Министерство Финансов	MOM048_0054	13.11%	2.30	11.июнь.2024
Министерство Финансов	MUM180_0014	12.98%	8.80	04.июнь.2024
Министерство Финансов	MUM120_0017	12.99%	2.70	04.июнь.2024
Министерство Финансов	MUM108_0013	12.95%	4.80	04.июнь.2024
Министерство Финансов	MUM084_0019	12.95%	6.60	04.июнь.2024
Министерство Финансов	MUM012_0157	13.00%	0.80	04.июнь.2024
Министерство Финансов	MUM084_0019	12.75%	6.60	30.май.2024
Министерство Финансов	MUM012_0157	12.90%	0.90	30.май.2024
Министерство Финансов	MUM180_0013	12.80%	8.70	30.май.2024
Министерство Финансов	MUM180_0006	12.94%	2.80	30.май.2024
Министерство Финансов	MUM168_0005	12.55%	10.60	28.май.2024
Министерство Финансов	MUM180_0016	12.54%	12.50	28.май.2024
Министерство Финансов	MUM192_0002	12.86%	3.80	28.май.2024
Министерство Финансов	MUM240_0001	12.90%	7.80	28.май.2024
Министерство Финансов	MUM180_0014	12.86%	8.80	28.май.2024
Министерство Финансов	MUM120_0017	12.64%	2.80	21.май.2024
Министерство Финансов	MUM012_0157	12.60%	0.90	21.май.2024
Министерство Финансов	MUM084_0019	12.66%	6.70	21.май.2024
Министерство Финансов	MUM240_0002	12.68%	9.80	21.май.2024
Министерство Финансов	MUM108_0013	12.61%	4.80	21.май.2024
Министерство Финансов	MUM072_0015	12.55%	5.80	14.май.2024
Министерство Финансов	MUM168_0003	12.56%	7.90	14.май.2024
Министерство Финансов	MUM192_0002	12.52%	3.90	14.май.2024

Ежедневный обзор

23 октября 2024 г.

Министерство Финансов	MUM240_0002	12.57%	10.00	14.май.2024
Министерство Финансов	MUM180_0006	12.37%	2.90	06.май.2024
Министерство Финансов	MUM180_0014	12.15%	9.00	06.май.2024
Министерство Финансов	MUM084_0019	12.27%	6.80	06.май.2024
Министерство Финансов	MUM108_0013	12.30%	4.90	06.май.2024
Министерство Финансов	MKM012_0157	12.22%	0.90	06.май.2024
Министерство Финансов	MUM108_0012	11.97%	2.10	30.апр.2024
Министерство Финансов	MUM072_0015	12.12%	5.80	30.апр.2024
Министерство Финансов	MUM156_0007	12.15%	9.80	30.апр.2024
Министерство Финансов	MUM168_0003	12.15%	7.90	30.апр.2024
Министерство Финансов	MUM084_0019	12.10%	6.70	26.апр.2024
Министерство Финансов	MUM180_0006	12.00%	2.90	26.апр.2024
Министерство Финансов	MKM012_0157	11.70%	0.90	26.апр.2024
Министерство Финансов	MUM108_0013	12.11%	4.90	26.апр.2024
Министерство Финансов	MUM180_0014	12.15%	8.90	26.апр.2024
Министерство Финансов	MUM096_0011	12.11%	4.40	23.апр.2024
Министерство Финансов	MUM168_0005	12.15%	10.70	23.апр.2024
Министерство Финансов	MUM084_0019	12.09%	6.70	23.апр.2024
Министерство Финансов	MUM168_0003	12.15%	7.90	23.апр.2024
Министерство Финансов	MUM072_0015	11.96%	5.80	16.апр.2024
Министерство Финансов	MUM168_0005	12.15%	10.70	16.апр.2024
Министерство Финансов	MUM300_0003	12.15%	15.60	16.апр.2024
Министерство Финансов	MUM096_0011	11.45%	4.50	16.апр.2024
Министерство Финансов	MUM180_0013	12.08%	8.80	16.апр.2024
Министерство Финансов	MUM108_0012	11.83%	2.20	16.апр.2024
Министерство Финансов	MKM012_0157	11.71%	1.00	09.апр.2024
Министерство Финансов	MUM096_0012	11.85%	5.20	09.апр.2024
Министерство Финансов	MUM300_0002	12.15%	15.10	09.апр.2024
Министерство Финансов	MUM156_0007	12.15%	9.70	09.апр.2024
Министерство Финансов	MUM120_0019	11.99%	6.80	09.апр.2024
Министерство Финансов	MUM072_0015	11.96%	5.80	02.апр.2024
Министерство Финансов	MUM180_0006	11.38%	2.90	02.апр.2024
Министерство Финансов	MUM156_0007	12.15%	9.70	02.апр.2024
Министерство Финансов	MUM156_0007	12.15%	9.90	26.мар.2024
Министерство Финансов	MUM084_0019	12.00%	6.90	26.мар.2024
Министерство Финансов	MUM108_0012	11.40%	2.30	26.мар.2024
Министерство Финансов	MUM168_0005	12.15%	11.00	26.мар.2024
Министерство Финансов	MKM012_0156	11.74%	0.80	19.мар.2024
Министерство Финансов	MUM120_0017	11.44%	2.90	19.мар.2024
Министерство Финансов	MUM180_0016	12.15%	12.70	19.мар.2024
Министерство Финансов	MUM120_0019	11.94%	6.70	19.мар.2024
Министерство Финансов	MOM048_0052	11.51%	1.80	12.мар.2024
Министерство Финансов	MUM156_0007	12.15%	9.80	12.мар.2024
Министерство Финансов	MUM168_0005	12.15%	10.80	12.мар.2024
Министерство Финансов	MUM072_0015	11.97%	5.90	12.мар.2024
Министерство Финансов	MKM012_0156	11.90%	0.80	5.мар.2024
Министерство Финансов	MUM132_0007	12.00%	8.30	5.мар.2024
Министерство Финансов	MUM192_0003	11.41%	4.50	5.мар.2024

Ежедневный обзор

23 октября 2024 г.

Министерство Финансов	MUM132_0007	12.00%	8.40	27.фев.2024
Министерство Финансов	MUM084_0019	11.90%	6.90	27.фев.2024
Министерство Финансов	MUM156_0007	12.15%	9.80	27.фев.2024
Министерство Финансов	MUM192_0003	11.50%	4.50	20.фев.2024
Министерство Финансов	MUM156_0007	12.14%	9.80	20.фев.2024
Министерство Финансов	MUM084_0019	11.90%	6.90	20.фев.2024
Министерство Финансов	MUM180_0016	12.15%	12.80	13.фев.2024
Министерство Финансов	MUM120_0018	11.51%	3.30	13.фев.2024
Министерство Финансов	MUM132_0007	12.15%	8.30	13.фев.2024
Министерство Финансов	MUM096_0012	12.00%	5.40	13.фев.2024
Министерство Финансов	MUM300_0002	12.15%	15.30	6.фев.2024
Министерство Финансов	MOM048_0052	11.97%	1.90	6.фев.2024
Министерство Финансов	MUM180_0016	12.15%	12.80	6.фев.2024
Министерство Финансов	MKM009_0019	12.95%	0.70	29.январ.2024
Министерство Финансов	MKM009_0019	12.96%	0.80	23.январ.2024
Министерство Финансов	MUM180_0015	12.15%	12.60	23.январ.2024
Министерство Финансов	MOM048_0052	12.00%	2.00	23.январ.2024
Министерство Финансов	MUM192_0003	12.30%	4.70	23.январ.2024
Министерство Финансов	MUM120_0018	12.74%	3.42	16.январ.2024
Министерство Финансов	MKM012_0156	13.10%	0.97	16.январ.2024
Министерство Финансов	MUM180_0011	12.54%	5.49	16.январ.2024
Министерство Финансов	MUM180_0015	12.12%	12.43	16.январ.2024
Министерство Финансов	MUM144_0009	12.15%	9.49	9.январ.2024
Министерство Финансов	MUM096_0014	12.69%	7.24	9.январ.2024
Министерство Финансов	MKM012_0156	13.34%	0.99	9.январ.2024
Министерство Финансов	MUM120_0018	12.87%	3.43	9.январ.2024
Министерство Финансов	MUM180_0011	12.69%	5.52	9.январ.2024
Министерство Финансов	MUM096_0014	12.81%	7.25	4.январ.2024
Министерство Финансов	MUM144_0009	12.15%	9.50	4.январ.2024
Министерство Финансов	MUM300_0001	12.49%	14.70	4.январ.2024
Министерство Финансов	MUM192_0003	12.87%	4.64	4.январ.2024
Министерство Финансов	MUM132_0007	12.45%	8.64	20.декаб.2023
Министерство Финансов	MUM096_0011	13.00%	4.93	20.декаб.2023
Министерство Финансов	MOM060_0052	13.00%	2.64	13.декаб.2023
Министерство Финансов	MUM096_0013	13.00%	6.23	6.декаб.2023
Министерство Финансов	MOM024_0088	13.75%	1.42	6.декаб.2023
Министерство Финансов	MOM060_0054	13.10%	4.01	29.нояб.23
Министерство Финансов	MUM156_0007	12.15%	10.20	22.нояб.23
Министерство Финансов	MUM096_0011	13.19%	5.10	15.нояб.23
Министерство Финансов	MUM216_0001	11.70%	13.17	15.нояб.23
Министерство Финансов	MUM144_0009	12.25%	10.75	8.нояб.23
Министерство Финансов	MUM096_0014	12.65%	7.52	1.нояб.23
Министерство Финансов	MOM036_0091	14.00%	1.31	24.окт.23
Министерство Финансов	MUM192_0003	13.29%	4.91	24.окт.23
Министерство Финансов	MUM168_0005	12.04%	11.43	18.окт.23
Министерство Финансов	MUM096_0012	13.05%	5.82	18.окт.23
Министерство Финансов	MOM036_0091	14.00%	1.34	11.окт.23
Министерство Финансов	MUM132_0007	12.50%	8.83	11.окт.23

Ежедневный обзор

23 октября 2024 г.

Министерство Финансов	MUM108_0012	13.60%	2.73	4.окт.23
Министерство Финансов	MUM096_0012	13.09%	5.81	27.сен.23
Министерство Финансов	MOM060_0052	13.64%	5.82	27.сен.23
Министерство Финансов	MKM012_0154	14.60%	2.93	20.сен.23
Министерство Финансов	MUM216_0001	11.70%	0.54	20.сен.23
Министерство Финансов	MUM096_0014	12.80%	12.90	20.сен.23
Министерство Финансов	MUM156_0007	12.05%	7.61	13.сен.23
Министерство Финансов	MKM012_0154	14.55%	10.43	13.сен.23
Министерство Финансов	MOM060_0052	13.64%	2.92	6.сен.23
Министерство Финансов	MUM132_0007	12.60%	8.93	6.сен.23
Министерство Финансов	MOM024_0087	14.02%	1.40	6.сен.23
Министерство Финансов	MKM012_0154	14.70%	0.56	23.авг.23
Министерство Финансов	MOM048_0052	13.85%	2.42	23.авг.23
Министерство Финансов	MUM216_0001	11.70%	12.95	23.авг.23
Министерство Финансов	MUM120_0016	14.28%	1.78	16.авг.23
Министерство Финансов	MUM084_0018	13.58%	4.66	16.авг.23
Министерство Финансов	MUM096_0014	13.00%	7.74	16.авг.23
Министерство Финансов	MUM156_0007	12.16%	10.52	16.авг.23
Министерство Финансов	MOM048_0052	13.79%	2.45	09.авг.23
Министерство Финансов	MUM120_0016	14.24%	1.80	09.авг.23
Министерство Финансов	MUM072_0014	13.20%	5.59	02.авг.23

Источник: KASE. *лет до погашения с момента размещения

Ежедневный обзор

23 октября 2024 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)
11.10.2024	440.12	65.20	505.32	87.10	12.90	2.47
04.10.2024	442.59	62.73	505.32	87.59	12.41	2.30
27.09.2024	444.89	60.43	505.32	88.04	12.41	-0.51
20.09.2024	444.38	60.94	505.32	87.94	12.06	4.76
13.09.2024	449.16	56.18	505.35	88.88	11.12	1.96
06.09.2024	451.18	54.22	505.35	89.27	10.73	0.00
29.08.2024	451.13	54.22	505.35	89.27	10.73	0.53
23.08.2024	450.60	54.75	505.35	89.17	10.83	-24.38
16.08.2024	475.01	30.37	505.38	93.99	6.01	4.14
09.08.2024	470.87	34.51	505.38	93.17	6.83	10.74
02.08.2024	460.13	45.25	505.38	91.05	8.95	6.25
26.07.2024	453.88	51.50	505.38	89.81	10.19	-51.50
19.07.2024	404.99	0.00	404.99	100.00	0.00	8.29
12.07.2024	396.71	8.29	404.99	97.95	2.05	11.75
05.07.2024	384.96	20.04	404.99	95.05	4.95	0.76
28.06.2024	384.19	20.80	404.99	94.86	5.14	-6.80
21.06.2024	415.32	14.00	429.32	96.74	3.26	8.90
14.06.2024	406.42	22.90	429.32	94.70	5.30	21.12
07.06.2024	385.30	44.02	429.32	89.80	10.20	-23.21
31.05.2024	408.51	20.81	429.32	95.20	4.85	-14.97
24.05.2024	402.13	5.84	407.97	98.60	1.40	46.70
17.05.2024	355.43	52.54	407.97	87.10	12.90	0.00
10.05.2024	355.42	52.56	407.97	87.10	12.90	-51.89
04.05.2024	407.31	0.66	407.97	99.80	0.20	-85.60
26.04.2024	492.86	12.36	505.23	97.60	2.40	93.30
19.04.2024	399.31	105.66	505.23	79.00	20.10	0.00
12.04.2024	399.31	105.92	505.23	79.00	20.10	89.30
05.04.2024	488.60	16.62	505.23	96.70	3.30	53.00
29.03.2024	435.48	69.62	505.09	86.20	13.80	0.00
20.03.2024	435.48	69.62	505.09	86.20	13.80	0.00
15.03.2024	435.48	69.62	505.09	86.20	13.80	0.00
07.03.2024	435.48	69.62	505.09	86.20	13.80	18.10
01.03.2024	756.86	51.49	808.35	93.60	6.40	-62.20
23.02.2024	694.70	113.65	808.35	85.90	14.10	10.00
16.02.2024	704.92	103.43	808.35	87.20	12.80	36.00
02.02.2024	961.00	50.00	1 011.00	95.00	5.00	-2.00
26.01.2024	958.99	52.01	1 011.00	94.90	5.10	0.60
19.01.2024	959.54	51.45	1 011.00	94.90	5.10	1.45
12.01.2024	961.00	50.00	1 011.00	95.10	4.90	39.60

Источник: Национальный Банк РК

АО «Halyk Finance»

Департамент торговых идей

E-mail
dti@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».