



Ежедневный обзор

Фондовые индексы США показали отрицательную динамику

Ежедневный обзор

24 октября 2024 г.

Коротко на текущий момент:

- Фондовые индексы США показали отрицательную динамику;
- Акции Tesla выросли на 12.1%;
- Акции AT&T выросли на 4.6%;
- Lam Research выпустила отчет по результатам квартала;
- Qualcomm и ARM падают на фоне судебных разбирательств и угроз отзыва лицензий;
- Крупнейший производитель электроэнергии в США выпустил отчет за третий квартал;
- Забастовка работников Boeing продолжается;
- Крупный золотодобытчик показывает негативную динамику;
- Увеличение трансфертов из Нацфонда подчеркивает недостатки бюджетного планирования Казахстана;
- Мажилис принял закон о ратификации соглашения с ЕАЭС о правилах выдачи складских свидетельств на сельхозпродукцию.

Валютный рынок:

- Индекс доллара США (DXY), показывающий отношение курса доллара к корзине из шести мировых валют, вырос на 0.3% до уровня в 104.4 п.;
- Курс USD/KZT укрепился на 0.1% до уровня в 485.0.

Стоимость Brent упал на 1.4%

В среду цена на нефть упала на 1.4% до \$75 за барр., после выхода новостей о запасах сырой нефти в США. Согласно данным Информационного агентства энергетики (EIA), запасы сырой нефти в США составили 5.5 млн барр., против консенсус-прогноза в 0.7 млн барр. Увеличение запасов сырой нефти усилило опасения участников рынка о росте предложения, что оказало давление на цены нефти.

Фондовые индексы

Индексы	Регион	Посл. знач.	Изменение	
			За день	С начала года
Americas				
S&P 500	США	5 797.4	-0.92%	21.20%
Dow Jones	США	42 515.0	-0.96%	12.74%
NASDAQ	США	18 276.7	-1.60%	21.08%
EMEA				
Euro Stoxx 50	Еврозона	4 922.6	-0.34%	9.04%
FTSE 100	Великобритания	8 258.6	-0.58%	6.94%
CAC 40	Франция	7 497.5	-0.50%	-0.50%
DAX	Германия	19 377.6	-0.23%	16.02%
IBEX 35	Испания	11 865.2	0.27%	17.64%
FTSE MIB	Италия	34 697.2	-0.10%	14.39%
Asia/Pacific				
Nikkei 225	Япония	38 104.9	-0.80%	13.61%
Hang Seng	Гонконг	20 760.2	1.27%	21.81%
Shanghai	Китай	3 302.8	0.52%	11.78%
Sensex	Индия	80 082.0	-0.17%	10.59%
Singapore	Сингапур	3 600.8	0.37%	12.02%
Emerging markets				
Bovespa	Бразилия	129 233.1	-0.55%	-3.69%
RTSI\$	Россия	1 151.9	-0.20%	5.59%
NIFTY 50	Индия	24 429.2	-0.03%	12.17%
Borsa Index	Турция	8 714.7	-1.40%	17.82%
KASE	Казахстан	5 218.4	-0.26%	25.42%

Товарный рынок

	Знач.	Изменение			
		1D	1W	1M	YTD
Brent	75.0	-1.4%	1.0%	-0.3%	-2.7%
Медь	9 521.5	-0.6%	-0.4%	-2.8%	12.0%
Цинк	3 144.0	0.2%	3.0%	4.5%	18.3%
Золото	2 715.6	-1.2%	1.6%	2.2%	31.6%
Серебро	33.7	-3.3%	6.3%	5.0%	41.6%
Природный газ	2.3	1.3%	-1.1%	-8.2%	-6.8%
Алюминий	2 669.5	1.4%	3.3%	4.4%	12.0%

Ежедневный обзор

24 октября 2024 г.

Фондовые индексы США показали отрицательную динамику

S&P 500 снизился на 0.92% за счет падения акций технологического сектора (-1.7%), сектора товаров вторичного спроса (-1.8%) и сектора коммуникаций (-1.4%). Причиной коррекции на рынке информационных технологий стало обнаружение конструктивного дефекта в новейших ИИ чипах Blackwell от Nvidia (-3%). Это вызвало обеспокоенность инвесторов о будущем рынка полупроводников, крайне чувствительного к успешному росту «зеленого» гиганта. Помимо этого, сектор вторичных товаров пострадал после того, как акции McDonald's упали на 5.2% из-за расследования CDC по вспышке E. coli, связанной с их гамбургерами, в результате которой зафиксирована одна смерть. Компания временно убирает Quarter Pounder из ресторанов в затронутых регионах. Акции Tesla выросли на 12.1%, благодаря отличным финансовым и операционным результатам.

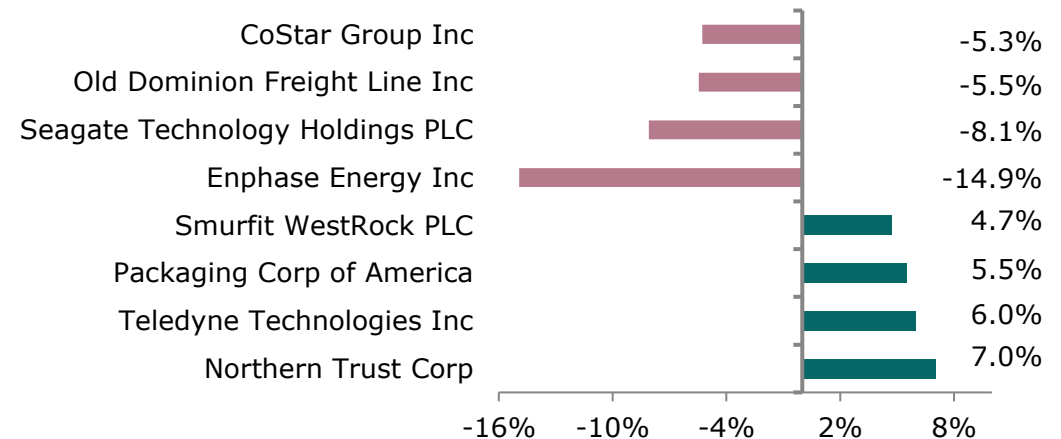
В сентябре продажи существующих домов неожиданно упали до самого низкого уровня с 2010 года, составив 3.84 миллиона (на 1% ниже, чем в августе). Несмотря на рост количества доступных домов и снижение ставок, покупатели могут откладывать свои решения из-за неопределенности на выборах и ожидания дальнейшего снижения ипотечных ставок.

Акции Tesla выросли на 12.1%

Акции производителя автомобилей Tesla выросли на 12.1% после выпуска отчета за третий квартал. Выручка компании составила \$25.18 млрд, что ниже ожидания в \$25.4 млрд. Прибыль на акцию составила \$0.72, против консенсуса в \$0.6.

В третьем квартале компания поставила 462 890 автомобилей, что на 6.4% больше, чем в предыдущем квартале, это стало первым кварталом роста поставок в текущем году. Данные показатели превысили прошлогодний показатель в 435 059 автомобилей. Однако аналитики Уолл-стрит ожидали, что Tesla поставит ближе к 463 897 автомобилей.

Лидеры и аутсайдеры индекса S&P 500



Долговой рынок

	Валюта	YTM	YTM на			
			1D	1W	1M	YTD
US Treasuries (10YR)	US\$	4.22%	4.25%	4.09%	3.75%	4.03%
US Treasuries (30YR)	US\$	4.50%	4.52%	4.39%	4.09%	3.93%
UK Gilts (30YR)	GBP	4.20%	4.17%	4.06%	3.90%	4.49%
Germany (10YR)	EUR	2.30%	2.32%	2.18%	2.21%	2.48%
Kazakhstan (3YR)	US\$	4.63%	4.65%	4.74%	4.62%	3.49%

Валютный рынок

	Знач.	Изменение			
		1D	1W	1M	YTD
DXY	104.4	0.3%	0.8%	3.7%	1.0%
USD/KZT	485.0	-0.1%	-0.6%	1.2%	8.8%
USD/RUB	96.0	0.2%	-1.5%	3.3%	5.4%
EUR/USD	1.08	-0.2%	-0.7%	-3.6%	-0.7%
GBP/USD	1.29	-0.5%	-0.5%	-3.7%	1.7%
USD/JPY	152.8	1.1%	2.1%	6.7%	5.6%

Ежедневный обзор

24 октября 2024 г.

Автопроизводитель сообщил, что в третьем квартале валовая маржа от производства и хранения энергии достигла рекорда в 30.5%, а в 2024 г. ожидается, что этот бизнес увеличится более чем в два раза в годовом исчислении.

»» **Акции AT&T выросли на 4.6%**

Акции телекоммуникационной компании AT&T выросли после того, как компания опубликовала данные о прибыли за третий квартал. Согласно отчету компании, прибыль на акцию составила \$0.60, против прогноза в \$0.57. Однако выручка компании оказалась ниже ожиданий, \$30.21 млрд, против консенсус-прогноза в \$30.45 млрд. За квартал AT&T добавила 403 000 телефонных подключений, что меньше, чем годом ранее, и ниже прогнозов аналитиков. Операционные расходы выросли из-за неденежных расходов на обесценение гудвилла в размере \$4.4 млрд, связанных с подразделением проводной связи. Свободный денежный поток снизился до \$5.1 млрд.

»» **Lam Research выпустила отчет по результатам квартала**

Квартальный отчет поставщика производственного оборудования для полупроводниковой отрасли Lam Research Corp, обеспечил 5.6% рост на постмаркете. В первую очередь инвесторов приятно удивила прибыль компании, составившая \$0.86 на акцию, заметно выше прогнозируемой рынком \$0.80 на акцию. Выручка за квартал в \$4.17 млрд также побила ожидания аналитиков на 3%. Прогнозы на следующий квартал по выручке в \$4.3 млрд превысили консенсус-прогноз на 1.7%. Таким образом, котировки компании вернулись к сентябрьским значениям, компенсировав эффект коррекции на рынке полупроводников, вызванной отчетом ASML на прошлой неделе.

»» **Qualcomm и ARM падают на фоне судебных разбирательств и угроз отзыва лицензий**

Два ключевых технологических гиганта продолжают публичную ссору на фоне разногласий по выплатам лицензий. Вчера ARM Holdings (-6.7%) выдвинула предупреждение об отзыве собственных лицензий у Qualcomm Inc. (-3.8%) по истечении 60

Ежедневный обзор

24 октября 2024 г.

дней. ARM Holdings заявляет что Qualcomm, крупнейший производитель чипов на ARM архитектуре, не оплачивает гонорары по лицензии Nuvia, поглощенной в 2021 году, несмотря на то что те дублировали существующие лицензии. По причине неспособности договориться о новых условиях лицензионного соглашения, две компании встретятся в суде 16 декабря, за 7 дней до заявленного срока отзыва лицензий.

» Крупнейший производитель электроэнергии в США выпустил отчет за третий квартал

NextEra Energy сообщила о росте прибыли в третьем квартале, благодаря увеличению инвестиций и новым проектам. Чистая прибыль составила \$1.85 миллиарда (90 центов на акцию), по сравнению с \$1.22 миллиарда (60 центов на акцию) в прошлом году.

Скорректированная прибыль составила \$1.03 на акцию, что выше ожиданий аналитиков в 98 центов. Операционные доходы составили \$7.57 миллиарда, в то время как аналитики ожидали \$8.06 миллиарда.

Чистая прибыль подразделения возобновляемой энергетики NextEra Energy Resources составила \$1.22 миллиарда, в прошлом году был зафиксирован убыток в \$230 миллионов. Подразделение добавило 3 гигаватта новых проектов в портфель и подписало соглашения с двумя крупными клиентами. Florida Power & Light, крупнейшее подразделение NextEra и крупнейшая электросетевая компания США, получила \$1.29 млрд прибыли, увеличившись с \$1.18 млрд в прошлом году.

Генеральный директор Джон Кетчум заявил, что инвестиции Florida Power & Light в укрепление и технологии умных сетей предотвратили сотни тысяч отключений электроэнергии во время ураганов. Компания продолжает ожидать скорректированную прибыль в диапазоне от \$3.23 до \$3.43 на акцию за год. Компания также сообщила, что проводит инженерные исследования и обсуждает с американскими регуляторами возможность повторного запуска закрытой атомной электростанции Duane Arnold в Айове.

Ежедневный обзор

24 октября 2024 г.

Кроме того, акции дочерней компании NextEra Energy Partners упали на 16.3% после квартального отчета. Убыток составил \$0.43 на акцию по сравнению с прибылью \$0.57 годом ранее. Компания повысила целевой показатель по замене ветряных установок до 1.9 ГВт к 2026 году, увеличив с прежних 1.3 ГВт. Также объявлена квартальная выплата в размере \$0.9175 на акцию, что составляет годовой прирост почти на 6%.

»» **Забастовка работников Boeing продолжается**

Сотрудники Boeing пока не вернутся к работе. Голосование за завершение 40-дневной забастовки провалилось, что добавляет проблем компании.

Объединение машиностроителей и работников аэрокосмической отрасли, представляющее около 33 тысяч сотрудников Boeing на Северо-Западе, сообщило, что 64% проголосовавших отклонили новое трудовое соглашение. Оно предусматривало повышение зарплат на 35% за четыре года.

Это уже второе соглашение, которое работники отклонили. Ранее в сентябре было предложено повышение на 25%. Если забастовка продолжится, может потребоваться увеличение зарплат на 40-45% для ее завершения.

Акции Boeing упали на 1.8%, завершив торги на уровне \$157.06, при этом с начала года их стоимость снизилась на 40%.

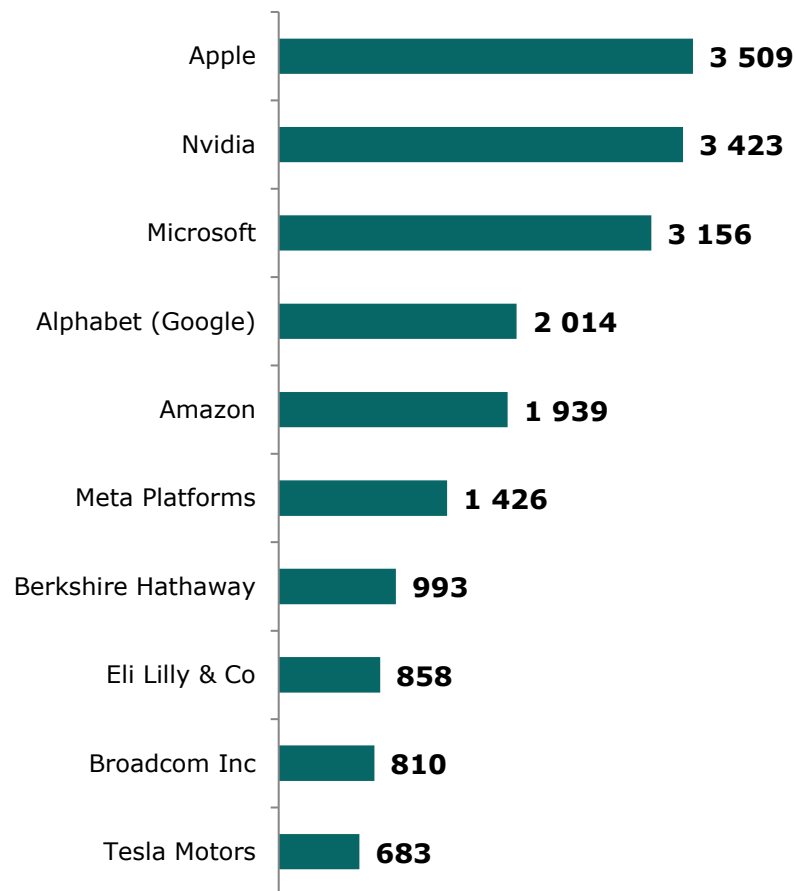
»» **Крупный золотодобытчик показывает негативную динамику**

Акции Newmont упали на 6.6% на пост-рыночных торгах после публикации квартальных результатов, которые не оправдали ожиданий аналитиков. Несмотря на то, что компания отчиталась о своей самой крупной прибыли за последние пять лет, чистая прибыль составила \$922 млн, что почти в шесть раз больше по сравнению с прошлым годом. Тем не менее, компания не смогла превзойти высокие ожидания аналитиков. Выручка компании выросла на 84.4% до \$4.6 млрд, что на \$60 миллионов ниже консенсус-прогноза. Скорректированная чистая прибыль составила 81 цент на акцию, что также оказалось ниже ожиданий аналитиков на 5 центов.

Ежедневный обзор

24 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	-0.9%	-53.7	503	100%
Information Technology	-1.7%	-31.9	69	32.2%
Financials	-0.1%	-1.0	72	13.3%
Health Care	-0.5%	-3.0	62	11.3%
Consumer Discretionary	-1.8%	-10.4	50	9.7%
Communications Services	-1.4%	-7.0	22	8.7%
Industrials	-0.3%	-1.5	78	8.5%
Consumer Staples	-0.1%	-0.4	38	5.8%
Energy	-0.5%	-0.9	22	3.4%
Utilities	1.0%	1.5	31	2.6%
Real Estate	1.0%	1.4	31	2.3%
Materials	-0.4%	-0.5	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

24 октября 2024 г.

- **Увеличение трансфертов из Нацфонда подчеркивает недостатки бюджетного планирования Казахстана**

Заявленное намерение властей Казахстана увеличить трансферты из Национального фонда показывает недостатки бюджетного планирования, но не подрывает надежные фискальные буферы государства, заявляет рейтинговое агентство Fitch.

Ранее вице-министр национальной экономики Казахстана Азамат Амрин сообщал, что неисполнение по доходам в республиканский бюджет 2024 г. составляет около Т3 трлн, в этой связи правительство намерено увеличить целевой трансферт из Нацфонда на текущий год.

«Намерения казахстанской власти увеличить трансферты из Национального фонда подчеркивают недостатки бюджетного планирования страны, но не подрывают надежные фискальные буферы», – говорится в сообщении Fitch.

«Снижение неопределенности вокруг бюджетного планирования могло бы лучше закрепить фискальную политику. Заявление министра прозвучало на фоне значительного увеличения трансфертов Нацфонда после того, как бюджетные результаты оказались ниже целевого показателя правительства за 8 месяцев 2024 г.», – отмечается в нем.

Fitch прогнозирует увеличение дефицита государственного бюджета Республики почти на 1% ВВП в 2024 г.

Бюджет на 2024 г. предусматривал сокращение трансфертов из Нацфонда до Т3.6 трлн (с Т4 трлн в 2023 г. или 3.3% к ВВП), из которых Т2 трлн являются гарантированным компонентом. Однако трансферты за 9М2024 г. выросли на 23% до Т4 трлн (по сравнению с аналогичным периодом прошлого года) из-за более высоких целевых трансфертов.

Источник: Интерфакс

- **Мажилис принял закон о ратификации соглашения с ЕАЭС о правилах выдачи складских свидетельств на сельхозпродукцию**

Мажилис парламента Казахстана на пленарном заседании в среду принял закон «О ратификации Соглашения о правилах выпуска (выдачи), обращения и погашения в рамках Евразийского экономического союза складских свидетельств на сельскохозяйственную продукцию».

Документ был подписан 31 июля 2023 г. в Москве.

Соглашение направлено на развитие сотрудничества в области сельского хозяйства и взаимной торговли сельскохозяйственной продукцией посредством использования складских свидетельств (бездокументарных не эмиссионных ценных бумаг) в рамках ЕАЭС.

Виды сельхозпродукции, на которые выпускаются (выдаются) складские свидетельства, определяются законодательством стран ЕАЭС. Согласно документу, складские свидетельства, выпущенные (выданные) в странах ЕАЭС, включённые в реестры складских свидетельств и соответствующие требованиям соглашения, взаимно признаются этими государствами.

Источник: Интерфакс

Ежедневный обзор

24 октября 2024 г.

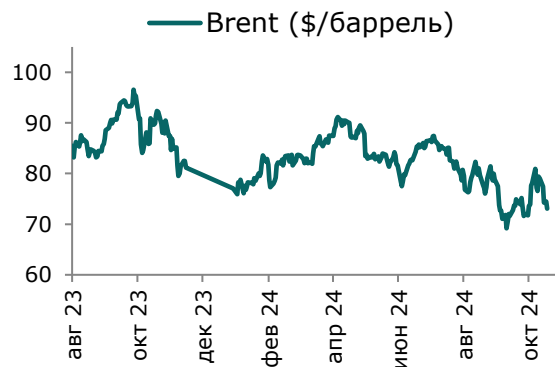
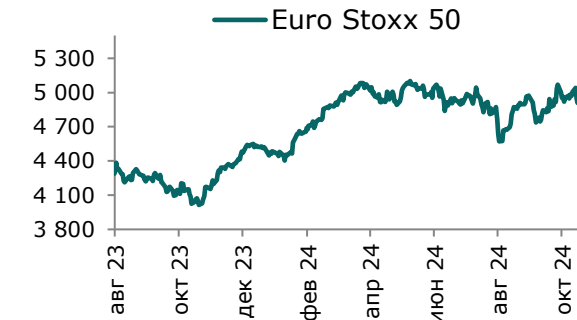
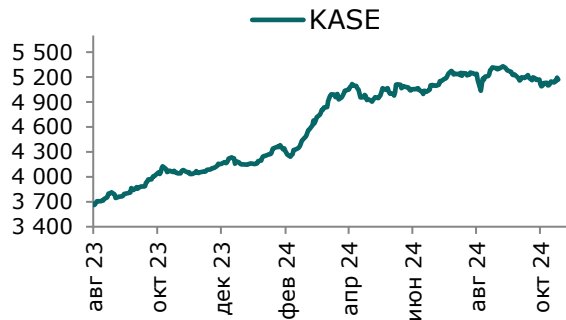
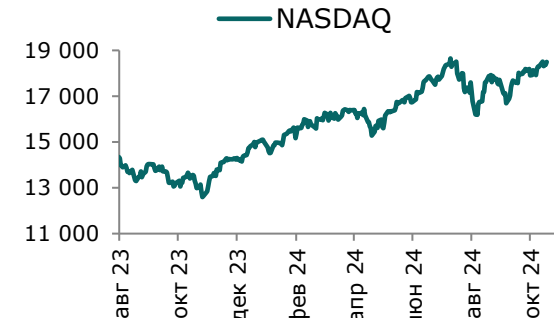
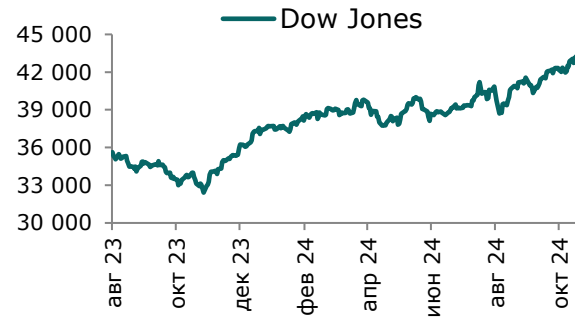
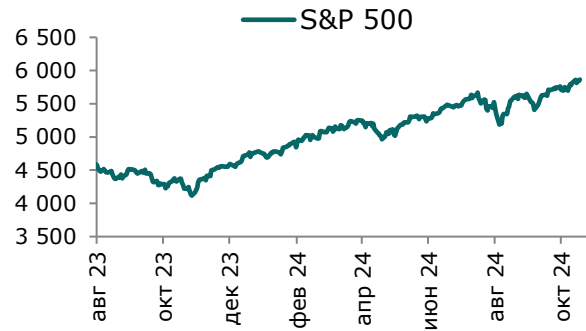
Таблица 1. Динамика изменения валют стран СНГ развивающихся и развитых стран

Валютная пара (индекс)	Страна	Базовая ставка	Инфляция* 2022	Инфляция* 2023	Курс	1D	1W	1M	YTD
USD/KZT	Казахстан	14.25%	14.9%	14.8%	485.0	-0.1%	-0.6%	1.2%	8.8%
USD/RUB	Россия	19.00%	13.8%	6.0%	96.0	0.2%	-1.5%	3.3%	5.4%
USD/GEL	Грузия	8.00%	9.4%	2.4%	2.7	-0.3%	0.3%	0.2%	5.0%
USD/KGS	Кыргызстан	9.00%	14.7%	8.0%	85.4	0.0%	0.8%	1.6%	-3.0%
USD/TJS	Таджикистан	9.00%	4.5%	3.8%	10.7	0.2%	0.1%	0.4%	-1.9%
USD/UZS	Узбекистан	13.50%	12.3%	8.8%	12 819	0.0%	0.2%	0.6%	11.2%
USD/UAH	Украина	13.00%	20.1%	13.4%	41.3	0.1%	0.2%	-0.1%	12.0%
Развивающиеся страны									
USD/CNY	Китай	4.35%	2.0%	0.2%	7.1	0.1%	0.1%	0.5%	-1.7%
USD/BRL	Бразилия	10.75%	9.3%	4.6%	5.7	0.0%	0.6%	4.6%	17.3%
USD/INR	Индия	6.50%	6.7%	5.7%	84.1	0.0%	0.0%	0.6%	2.2%
USD/ZAR	ЮАР	8.00%	6.9%	5.9%	17.8	1.3%	0.9%	3.0%	-5.3%
USD/TRY	Турция	50.00%	72.0%	53.4%	34.3	0.1%	0.3%	0.5%	31.4%
Развитые страны									
DXU	США	5.00%	8.0%	4.1%	104.4	0.3%	0.8%	3.7%	1.0%
USD/CAD	Канада	3.75%	6.8%	3.9%	1.4	0.1%	0.6%	3.0%	4.2%
GBP/USD	Великобритания	5.00%	9.1%	7.4%	1.3	-0.5%	-0.5%	-3.7%	1.7%
USD/CHF	Швейцария	1.00%	2.8%	2.2%	0.9	0.1%	0.1%	2.7%	-3.6%
USD/JPY	Япония	0.25%	2.5%	3.3%	152.8	1.1%	2.1%	6.7%	5.6%
USD/KRW	Южная Корея	3.25%	5.1%	3.6%	1 382.3	0.4%	1.3%	4.0%	6.4%

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

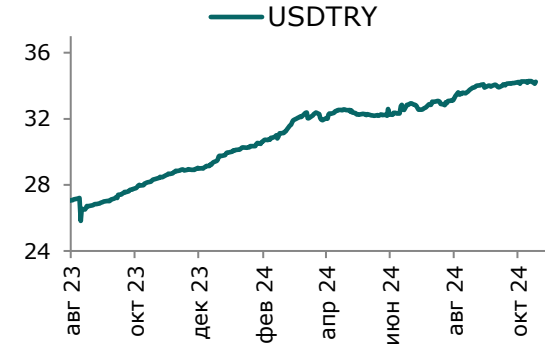
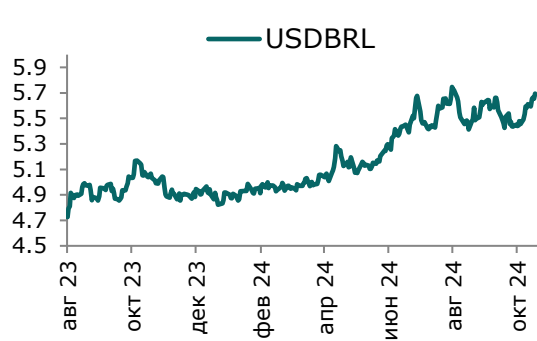
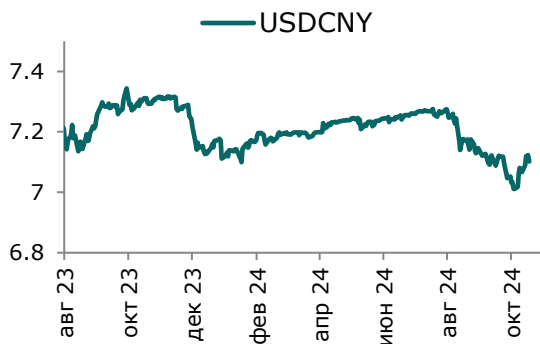
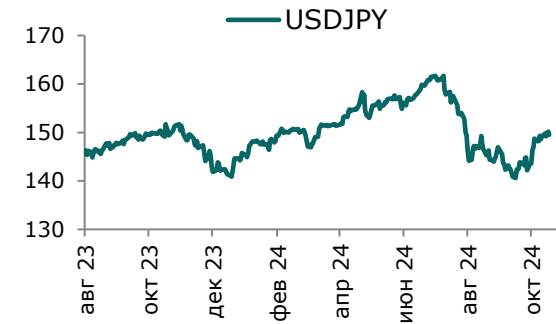
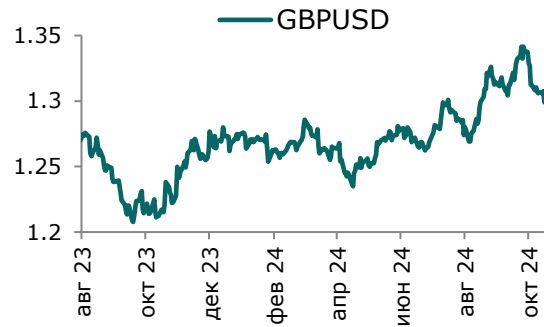
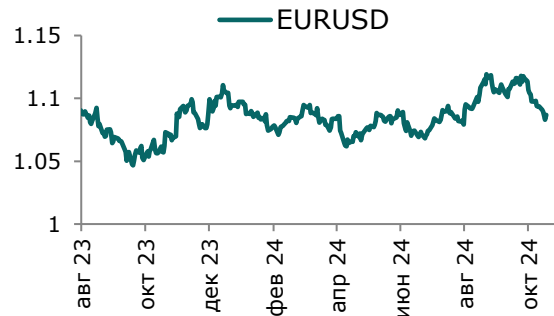
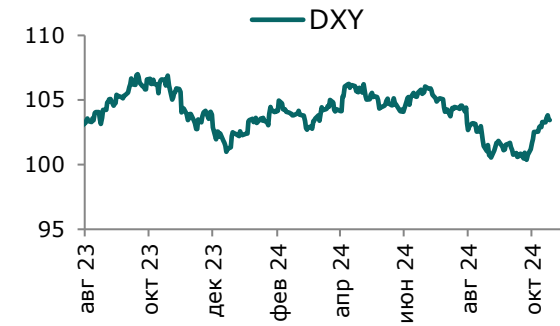
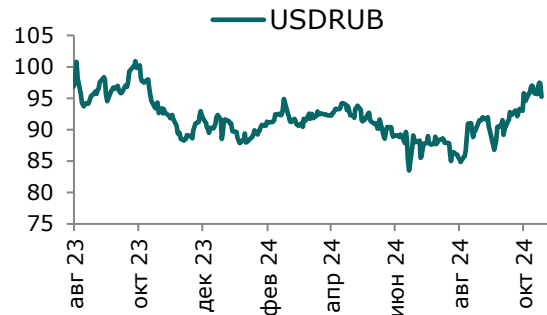
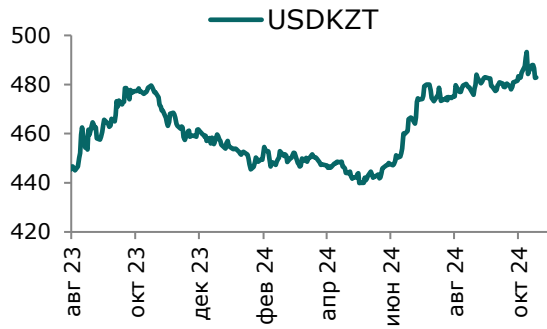
Ежедневный обзор

24 октября 2024 г.



Ежедневный обзор

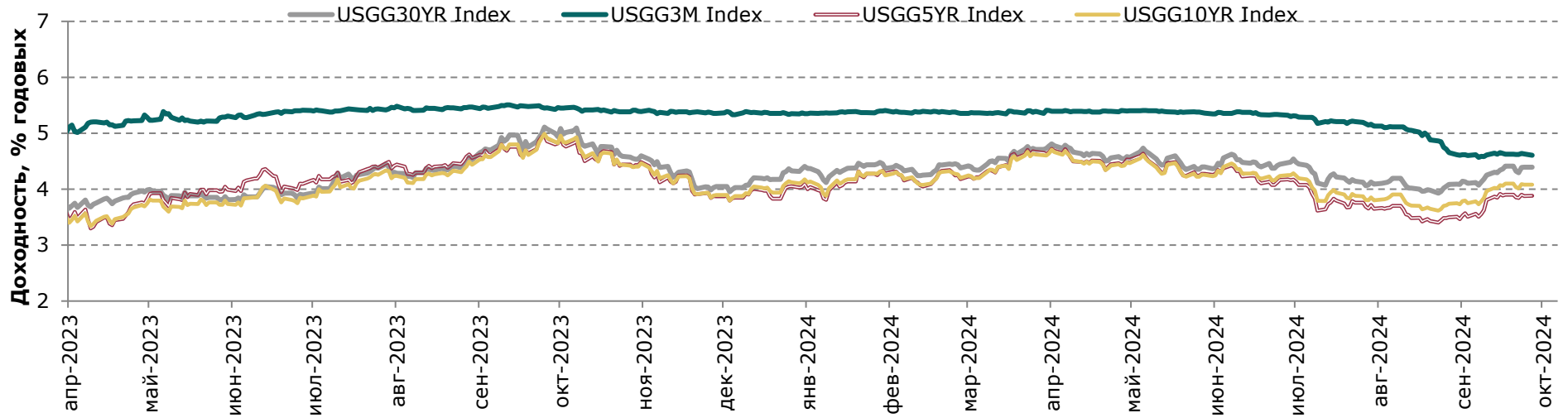
24 октября 2024 г.



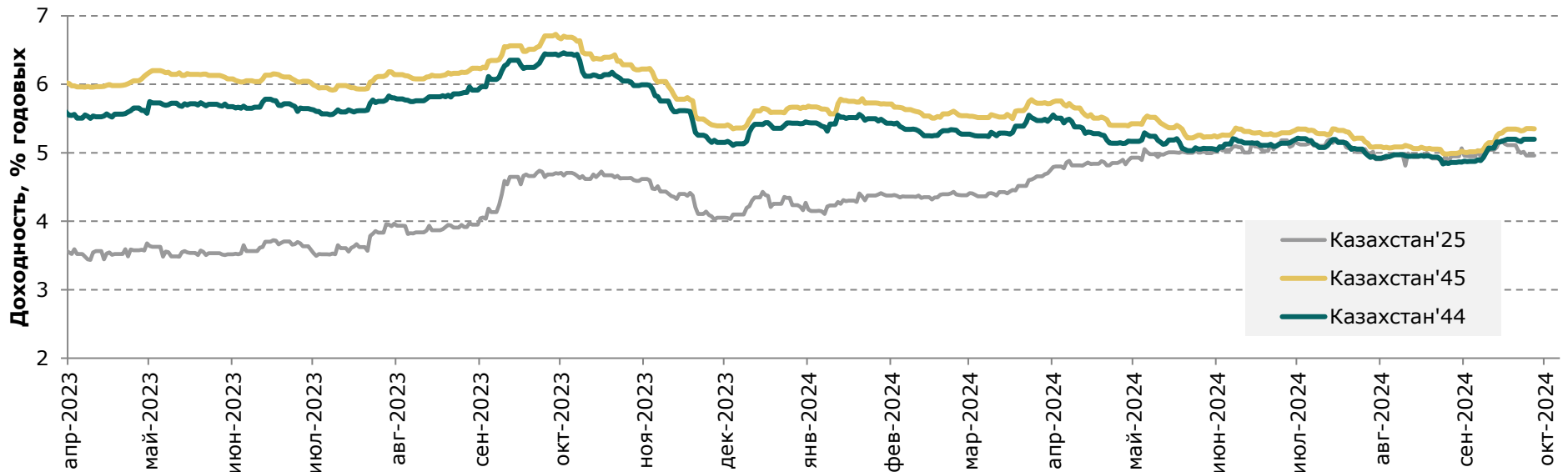
Ежедневный обзор

24 октября 2024 г.

Доходность государственных ценных бумаг США



Динамика доходности суверенных облигаций РК



Ежедневный обзор

24 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-Sprд	G-Sprд			
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

24 октября 2024 г.

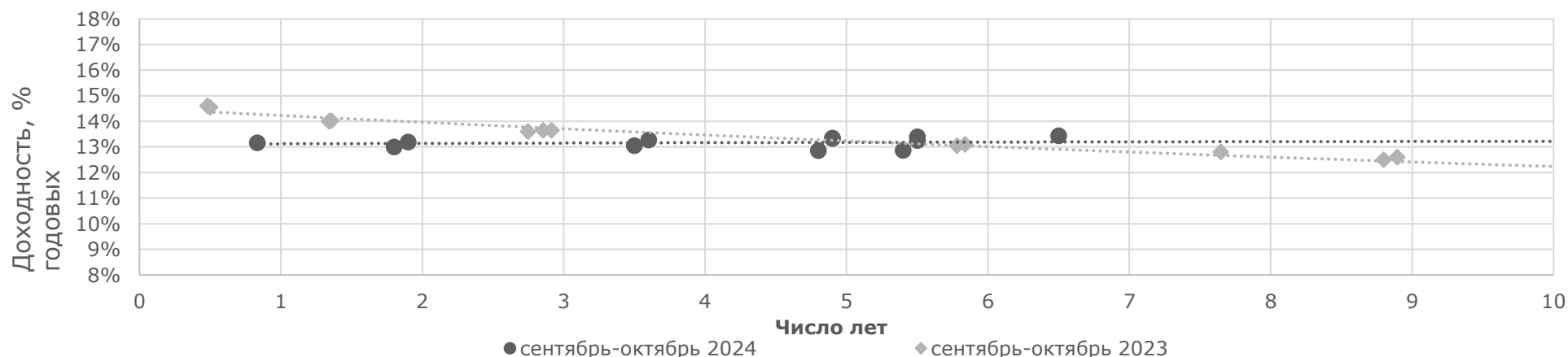
Таблица 3. Информация по узбекским еврооблигациям

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

24 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

24 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	MKM012_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	MKM012_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	MKM012_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	MKM012_0157	13.00%	0.80	04.июнь.2024
Министерство Финансов	MUM084_0019	12.75%	6.60	30.май.2024
Министерство Финансов	MKM012_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	MKM012_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

24 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

24 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.дек.2023
Министерство Финансов	MUM096_0011	13.00%	4.93	20.дек.2023
Министерство Финансов	MOM060_0052	13.00%	2.64	13.дек.2023
Министерство Финансов	MUM096_0013	13.00%	6.23	6.дек.2023
Министерство Финансов	MOM024_0088	13.75%	1.42	6.дек.2023
Министерство Финансов	MOM060_0054	13.10%	4.01	29.ноя.23
Министерство Финансов	MUM156_0007	12.15%	10.20	22.ноя.23
Министерство Финансов	MUM096_0011	13.19%	5.10	15.ноя.23
Министерство Финансов	MUM216_0001	11.70%	13.17	15.ноя.23
Министерство Финансов	MUM144_0009	12.25%	10.75	8.ноя.23
Министерство Финансов	MUM096_0014	12.65%	7.52	1.ноя.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

24 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

24 октября 2024 г.

Таблица 6. Доля владения нот НК нерезидентами, млрд тенге

Доля владения нот НК 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».