

ГЛОБАЛЬНЫЕ РЫНКИ

Индекс S&P 500 взял передышку после достижения исторических максимумов. Хотя экономические данные в четверг не были восприняты Уолл-стрит как катастрофические, они подчеркнули сложность задачи ФРС по снижению инфляции до целевого уровня в 2%, не создавая при этом значительного охлаждения рынка труда. Это добавило неопределенности в вопросе дальнейших шагов ФРС. На данный момент трейдеры на рынке облигаций продолжают ставить на замедление темпов снижения ставки до 25 базисных пунктов в ноябре.

Три представителя ФРС — Джон Уильямс, Остин Гулсби и Томас Баркин — не выказали беспокойства по поводу более высокой, чем ожидалось, инфляции, заявив, что ФРС может продолжить снижение ставок. Однако Рафаэль Бостик из Атлантического ФРС был исключением. В интервью The Wall Street Journal он заявил, что в сентябрьских прогнозах он предлагал ещё одно снижение ставки на четверть процентного пункта до конца года. ФРС остаётся провести два заседания в 2024 году.

Индекс S&P 500 упал на 0,2%. Большинство секторов продемонстрировали снижение, однако акции энергетических компаний выросли вместе с ценами на нефть, в то время как рынок ожидал ответа Израиля на ракетную атаку Ирана. Акции мегакапитализации оказались в смешанной динамике: Nvidia Corp. выросла, а Apple Inc. снизилась. Tesla Inc. немного упала накануне запуска полностью автономного автомобиля компании.

Данные, опубликованные в четверг, подчеркнули сложную задачу, стоящую перед ФРС. Базовая инфляция в США в сентябре выросла больше, чем ожидалось, что указывает на замедление прогресса в борьбе с ростом цен. Отдельные данные показали, что количество заявок на пособие по безработице в США на прошлой неделе выросло до самого высокого уровня более чем за год. Доходность 10-летних казначейских облигаций осталась почти без изменений на уровне 4,07%.

Китайские акции упали, отставая от своих азиатских коллег, на фоне растущей осторожности перед важным брифингом в эти выходные, который может прояснить ситуацию с фискальными стимулами Пекина. Индекс CSI 300 снизился на 1,9% перед перерывом на обед, нивелировав рост, наблюдавшийся в четверг. В то же время, в Японии и Южной Корее акции росли, несмотря на потери на Уолл-стрит после более высоких, чем ожидалось, данных по инфляции, которые усилили внимание к следующему шагу Федеральной резервной системы США. Австралийские акции оставались стабильными.

Все взгляды направлены на субботний брифинг, на котором министр финансов Китая, вероятно, объявит новые меры поддержки для оживления замедляющейся экономики. Инвесторы и аналитики ожидают, что Пекин выделит до 2 трлн юаней (\$283 млрд) на новые фискальные стимулы, стремясь поддержать рост и восстановить доверие.

Курс иены практически не изменился и остался на уровне около 148 за доллар после укрепления в четверг, а индекс доллара оставался стабильным. Южнокорейский вон сохранил свои позиции после того, как Банк Кореи снизил ключевую процентную ставку на 25 базисных пунктов до 3,25%, что соответствовало ожиданиям.

Цены на нефть немного снизились, частично компенсируя рост на 3,6% в четверг, когда трейдеры ожидали ответа Израиля на ракетную атаку Ирана. Цены на золото продолжили рост в четверг, поскольку трейдеры усилили ставки на то, что Федеральная резервная система снизит процентную ставку в следующем месяце на фоне последних экономических данных из США.

Новости корпораций:

- Delta Air Lines Inc. прогнозирует прибыль и выручку ниже ожиданий Уолл-стрит на последние месяцы года, указывая на медленное восстановление после сложного летнего туристического сезона.
- Domino's Pizza Inc. сократила прогноз по росту продаж и количеству новых точек на 2024 год, что связано с замедлением потребительских расходов.
- Pfizer Inc. пригрозила судебными исками двум бывшим руководителям, которые сотрудничали с активистом-инвестором Starboard Value для продвижения изменений в компании.
- GXO Logistics Inc., поставщик логистических услуг, отделившийся от компании XPO Inc. в 2021 году, рассматривает возможность продажи.
- Eli Lilly & Co. усиливает свою юридическую кампанию против компаний, которым временно разрешили производить и продавать копии её препаратов для похудения, пока в США не закончилась нехватка этих средств.
- Toronto-Dominion Bank выплатит почти \$3,1 млрд штрафов и других санкций и столкнётся с ограничением на свои активы в розничном банковском секторе США после признания вины в несоблюдении законов по борьбе с отмыванием денег.

КОТИРОВКИ

Индексы	Значение	1D	1W	1M	6M	YTD
S&P500	5 780,05	-0,21%	0,50%	4,07%	11,17%	21,18%
NASDAQ COMP	18 282,05	-0,05%	0,80%	5,10%	11,19%	21,79%
DOW JONES	42 454,12	-0,14%	0,24%	3,90%	10,39%	12,64%
KASE	5 119,06	0,33%	-0,16%	-0,79%	3,22%	22,25%
Товары	Значение	1D	1W	1M	6M	YTD
BRENT	\$79,16	-0,30%	1,42%	12,81%	-6,69%	5,55%
GOLD	\$2 644,29	0,55%	-0,35%	5,28%	11,45%	28,18%
Валюта	Значение	1D	1W	1M	6M	YTD
USD	490.84 ₹	0.36%	1.65%	2.80%	9.77%	7.98%
EUR	536.88 ₹	0.12%	0.70%	1.86%	10.53%	6.90%
RUB	5.04 ₹	-0.20%	-0.79%	-3.82%	5.00%	-0.40%
LSE NASDAQ	Значение	1D	1W	1M	6M	YTD
KAP	\$38,00	0,00%	-1,81%	-1,55%	-8,87%	-7,09%
HSBK	\$17,52	2,82%	3,67%	8,15%	-0,23%	15,57%
AIRA	\$6,38	-1,69%	-4,06%	-1,09%	-21,23%	
KSPI US	\$108,11	4,85%	2,41%	-11,42%	-6,88%	16,88%
Акции KASE	Значение	1D	1W	1M	6M	YTD
HSBK	₹209,48	1,69%	0,52%	6,88%	0,06%	28,04%
KZAP	₹18 430,00	0,58%	0,74%	1,89%	-1,97%	-0,13%
KCEL	₹3 240,00	-0,03%	0,17%	-0,30%	7,50%	65,73%
KEGC	₹1 509,00	-0,05%	0,27%	2,17%	0,88%	1,82%
KZTK	₹37 994,43	-0,25%	-1,47%	-1,06%	8,13%	10,13%
KZTO	₹815,03	-0,72%	-1,44%	0,00%	-2,91%	-5,78%
CCBN	₹1 918,25	-0,09%	-0,04%	-0,61%	19,15%	96,33%
KSPI	₹52 198,40	0,39%	-1,14%	-13,71%	-1,28%	14,47%
KMGZ	₹13 935,00	0,14%	-0,11%	-0,75%	13,02%	20,74%
AIRA	₹788,80	-0,59%	-1,71%	1,21%	-16,40%	

Источники: Bloomberg, Нацбанк РК, KASE.

ДИНАМИКА СЕКТОРОВ S&P 500

Сектор	1D	1W	1M	6M	YTD
INFORMATION TECHNOLOGY	-0,07%	2,20%	6,04%	10,34%	19,65%
MATERIALS	0,21%	0,09%	4,97%	4,11%	11,31%
CONSUMER DISCRETIONARY	-0,47%	-0,39%	4,63%	9,64%	10,42%
UTILITIES	-0,31%	-3,43%	2,17%	21,41%	23,89%
ENERGY	0,79%	-0,98%	10,25%	-5,43%	10,10%
INDUSTRIAL	-0,54%	0,30%	6,13%	9,32%	19,17%
COMMUNICATION SERVICE	-0,86%	-1,34%	6,41%	8,54%	23,43%
REAL ESTATE	-0,88%	-1,31%	-3,98%	14,24%	7,13%
FINANCIAL	-0,32%	-0,14%	3,20%	12,18%	21,11%
CONSUMER STAPLES	-0,44%	-0,39%	-1,73%	9,63%	12,92%
HEALTH CARE	-0,35%	0,72%	-1,42%	8,40%	12,04%

Источник: Bloomberg

КАЗАХСТАНСКИЙ РЫНОК

Индекс KASE в четверг поднялся на 0,33%, достигнув отметки 5 119,06 пунктов. Лидером по числу сделок среди акций стал АО "Народный Банк Казахстана" с 1 625 сделками. Наибольший объем торгов был зафиксирован по акциям АО "Кселл", составив 281,1 млн тенге. Рост показали акции трёх компаний: АО "Народный Банк Казахстана" (+1,69%), АО "Казатомпром" (+0,58%) и АО Kaspi.kz (+0,39%).

Доходность однодневных операций репо с государственными ценными бумагами (TONIA) увеличилась на 20 базисных пунктов и составила 13,99% годовых. Ставка однодневного свопа с тенге под залог долларов США (SWAP-1D USD) выросла на 8 б.п. до 7,94% годовых. Общий объем торгов на денежном рынке составил 809,388 млрд тенге.

К 17:00 четверга средневзвешенный курс доллара США к тенге с расчётами "завтра" составил 491,74 тенге, что на 2,25 тенге выше предыдущего уровня. Объем торгов составил 363,797 млн долларов США с 955 сделками. Минимальная цена составила 488,85 тенге, максимальная — 496,26 тенге, последняя сделка прошла по курсу 492,90 тенге.

Стоимость августовских фьючерсов на нефть Brent на лондонской бирже ICE Futures

Корпоративные новости:

- КМГ стал обладать 87,65%-й долей Coöperatieve KMG EP U.A. и 95,10%-й долей KMG EP Netherlands Energy Coöperatief U.A.

ЕВРООБЛИГАЦИИ КАЗАХСТАНСКИХ ЭМИТЕНТОВ

Эмитент	ISIN	Валюта	Сумма выпуска (MM - млн, MMM - млрд)	Купон	Дата погашения	Доходность YTM ask	Цена ask	S&P	Moody's	Fitch	Мин.лот
Development Bank of Kazakhstan JSC	XS2337670694	USD	254.52MM	2.950	05/06/2031	5.420	86.52		Baa1	BBB	200000.00
Development Bank of Kazakhstan JSC	XS2800066297	USD	500.00MM	5.500	04/15/2027	5.009	101.14		Baa1	BBB	200000.00
Development Bank of Kazakhstan JSC	XS0248160102	USD	106.67MM	6.000	03/23/2026	4.997	101.37	BBB-	Baa1	BBB	100000.00
Development Bank of Kazakhstan JSC	XS2472852610	USD	335.75MM	5.750	05/12/2025	5.583	100.09		Baa1	BBB	200000.00
Eurasian Development Bank	XS2315951041	EUR	357.24MM	1.000	03/17/2026	7.872	91.07	NR	WR	WD	119081.00
Kazakhstan Government International Bond	XS2914770545	USD	1.50MMM	4.714	04/09/2035	4.864	98.78	BBB-	Baa1	BBB	200000.00
Kazakhstan Government International Bond	XS1120709826	USD	1.00MMM	4.875	10/14/2044	5.148	96.61	BBB-	Baa1	BBB	200000.00
Kazakhstan Government International Bond	XS1263139856	USD	1.50MMM	6.500	07/21/2045	5.294	115.08	BBB-	Baa1	BBB	200000.00
Kazakhstan Government International Bond	XS1263054519	USD	2.50MMM	5.125	07/21/2025	4.814	100.22	BBB-	Baa1	BBB	200000.00
Kazakhstan Government International Bond	XS2050933626	EUR	708.70MM	1.500	09/30/2034	3.249	85.31	BBB-	Baa1	BBB	109031.00
Kazakhstan Government International Bond	XS2050933899	EUR	545.16MM	0.600	09/30/2026	3.278	94.99	BBB-	Baa1	BBB	109031.00
Kazakhstan Government International Bond	XS1120709669	USD	1.50MMM	3.875	10/14/2024	0.000	100.00	BBB-	Baa1	BBB	200000.00
Kazakhstan Government International Bond	XS1901718335	EUR	594.95MM	2.375	11/09/2028	3.124	97.18	BBB-	Baa1	BBB	113323.00
KazMunayGas National Co JSC	XS2242422397	USD	750.00MM	3.500	04/14/2033	5.552	86.25		Baa1	BBB	200000.00
KazMunayGas National Co JSC	XS1807299331	USD	1.50MMM	6.375	10/24/2048	6.570	97.66		Baa1	BBB	200000.00
KazMunayGas National Co JSC	XS1807300105	USD	1.25MMM	5.375	04/24/2030	5.323	100.25		Baa1	BBB	200000.00
KazMunayGas National Co JSC	XS1595714087	USD	1.25MMM	5.750	04/19/2047	6.552	90.63	BB+	Baa1	BBB	200000.00
KazMunayGas National Co JSC	XS1595713782	USD	248.09MM	4.750	04/19/2027	4.785	99.92	BB+	Baa1	BBB	200000.00
QazaqGaz NC JSC	XS1682544157	USD	706.32MM	4.375	09/26/2027	5.367	97.33		Baa2	BB+	200000.00
Fund of National Welfare Samruk-Kazyna JSC	XS2399149694	USD	500.00MM	2.000	10/28/2026	4.721	94.78	BBB-		BBB	200000.00
Tengizchevroil Finance Co International Ltd	USG87602AA90	USD	1.00MMM	4.000	08/15/2026	5.476	97.44	BB+	Baa2		200000.00
Tengizchevroil Finance Co International Ltd	XS2010030083	USD	750.00MM	3.250	08/15/2030	6.098	86.19	BB+	Baa2		200000.00
Tengizchevroil Finance Co International Ltd	XS2010030240	USD	500.00MM	2.625	08/15/2025	5.538	97.66	BB+	Baa2		200000.00

Источник: Bloomberg

КВАРТАЛЬНЫЕ ОТЧЁТЫ

8 октября

До торгов PepsiCo (PEP)

10 октября

До торгов Progressive (PGR), Delta Air Lines (DAL), Domino's Pizza Inc (DPZ)

11 октября

До торгов JPMorgan (JPM), Wells Fargo&Co (WFC), Bank of NY Mellon (BK), Fastenal (FAST)

СОБЫТИЯ ТЕКУЩЕЙ НЕДЕЛИ

7 октября

Прогноз

Текущее значение

Факт

Китай - Национальный день

9 октября

Прогноз

Текущее значение

Факт

США - Публикация протоколов FOMC

10 октября

Прогноз

Текущее значение

Факт

США - Базовый индекс потребительских цен (ИПЦ) (м/м) (сент)

0,2%

0,3%

США - Индекс потребительских цен (ИПЦ) (м/м) (сент)

0,1%

0,2%

11 октября

Прогноз

Текущее значение

Факт

США - Индекс цен производителей (PPI) (м/м) (сент)

0,1%

0,2%

Великобритания - ВВП (м/м) (авг)

0,2%

0,0%

Россия - Индекс потребительских цен (ИПЦ) (м/м) (сент)

0,4%

0,2%

СОБЫТИЯ ПРЕДСТОЯЩЕЙ НЕДЕЛИ

14 октября

Прогноз

Текущее значение

Факт

Япония - Выходной

16 октября

Прогноз

Текущее значение

Факт

Великобритания - Индекс потребительских цен (ИПЦ) (г/г) (сент)

2,2%

17 октября

Прогноз

Текущее значение

Факт

Евросоюз - Индекс потребительских цен (ИПЦ) (г/г) (сент)

1,8%

Евросоюз - Решение по процентной ставке (окт)

3,65%

США - Объем розничных продаж (м/м) (сент)

0,1%

18 октября

Прогноз

Текущее значение

Факт

Китай - ВВП (г/г) (3 кв.)

4,7%

АО "Инвестиционная компания Standard"

Республика Казахстан, 050010

г. Алматы, пр. Достык 38,

БЦ «Кендала», оф. 201С



+7 (727) 310 01 10



pr@stdi.kz



<https://www.stdi.kz>

АО «Инвестиционная компания Standard». Лицензия №3.2.247/22 от 16.06.2023 года, выданная АРРФР РК на осуществление брокерско-дилерской деятельности и деятельности по управлению инвестиционным портфелем без права привлечения добровольных пенсионных взносов.

Настоящий информационный материал носит исключительно информационный характер и не является индивидуальной инвестиционной рекомендацией для совершения любой сделки в отношении любых ценных бумаг и иных инструментов, на которые в настоящем материале может содержаться ссылка. Настоящий материал содержит информацию из различных источников, которые могут считаться надежными. При этом существует вероятность, что не все указанные сведения абсолютно точны. Мы не несем ответственности за использование клиентами информации, содержащейся в данном материале, а также за сделки и операции с ценными бумагами и иными финансовыми инструментами, на которые есть ссылки в материале. Мы не берем на себя обязательство регулярно обновлять информацию, которая содержится в данном материале, а также вносить различные корректировки в материалы. Инвестиции в некоторые инструменты имеют значительные риски, в том числе валютные и кредитные. Существует необходимость инвесторам самостоятельно изучать все аспекты для совершения тех или иных сделок с любыми активами, в том числе, которые указаны в данном материале. АО «Инвестиционная компания Standard», его руководство и сотрудники не могут гарантировать абсолютную точность, полноту и достоверность такой информации и не несут ответственности за возможные потери клиента в связи с ее использованием. Вознаграждение аналитиков не связано и не зависит от содержания аналитических обзоров, которые они готовят. Настоящая информация не предназначена для дальнейшего публичного распространения и не может быть опубликована полностью либо частично без предварительного письменного разрешения АО «Инвестиционная компания Standard».

© 2024 г., все права защищены