

КОТИРОВКИ

ГЛОБАЛЬНЫЕ РЫНКИ

Рынки акций США не показали значительных изменений перед данными по инфляции в США, на фоне неопределенности вокруг последних геополитических событий. Уолл-Стрит всё ещё оправляется от резких колебаний в прошлый понедельник, и многие инвесторы воздерживаются от крупных ставок, ожидая дополнительных сигналов о состоянии крупнейшей экономики мира.

Большинство подгрупп SP500 упали, хотя рост технологического сектора и энергетики компенсировали падение. Индекс Russell 2000 для малых компаний увеличил своё снижение в августе до 8,5%. Индекс волатильности Cboe — VIX — немного вырос после беспрецедентного всплеска на прошлой неделе.

Cboe Global Markets Inc. признала, что низкие объемы торговли в преддверии открытия сыграли роль в резком движении VIX в прошлый понедельник, но заявила, что его рост был оправдан нарастающим беспокойством по поводу риска распространения от краха японской валюты и акций, что привело к распродаже кэри-трейдов.

Акции Японии выросли после праздников, так как ослабление иены поддержало экспортёров. Индекс MSCI Asia-Pacific увеличился на 1%, что позволило ему полностью компенсировать потери прошлой недели, когда мировой риск-аппетит снизился, а индекс волатильности VIX в США поднялся выше 65, по сравнению с средним уровнем около 19,5.

Цены на нефть оставались близкими к уровню \$80, достигнутому в понедельник, поскольку США считают вероятность иранской атаки на Израиль всё более вероятной. Суверенный долг Израиля был понижен на один уровень агентством Fitch Ratings, которое сохранило негативный прогноз по кредиту из-за продолжающегося военного конфликта и его влияния на государственные финансы страны. Доходность казначейских облигаций сохранила прирост понедельника.

Индексы Nikkei 225 и Topix упали более чем на 7% с конца июля, когда Банк Японии повысил ключевую процентную ставку и объявил о планах сократить покупки облигаций.

Повышение ставки способствовало укреплению иены до того, как центральный банк заявил, что не будет ужесточать политику так быстро, чтобы не рисковать дальнейшей волатильностью на рынке. Инвесторы по всему миру распродали сделки по кэри-трейдам, финансируя покупки активов, от акций до облигаций развивающихся рынков, с помощью валюты.

После последствий прошлой недели рынки будут сосредоточены на данных по потребительским ценам США в среду, чтобы определить, будет ли у Федеральной резервной системы больше свободы или ограничений в переориентации на рынок труда и в достаточной степени предварительном снижении ставок для обеспечения «мягкой посадки».

Ожидается что индекс потребительских цен в среду вырастет на 0,2% по сравнению с июнем как по общему показателю, так и по так называемому базовому индексу, исключаяющему продовольственные товары и энергию. Индекс цен производителей, который будет опубликован за день до CPI, вероятно может стать основной новостью движущей рынок.

Новости корпораций:

- Bank of Nova Scotia реализует планы по увеличению капитала в США с помощью сделки на \$2,8 млрд за миноритарную долю в KeyCorp, одним из наиболее пострадавших американских региональных банков в прошлом году.
- Johnson & Johnson преодолела ключевое препятствие для продвижения плана на \$6,5 млрд по разрешению тысяч исков от людей, утверждающих, что её детская пудра вызвала у них рак.
- Акции B. Riley Financial Inc. упали на фоне нового раунда списаний и расширяющегося расследования в США, касающегося точности предоставленных инвесторам данных о её финансовом состоянии.
- JetBlue Airways Corp. начала продажу облигаций и кредитов на сумму \$2,75 млрд, обеспечивая её программой лояльности, поскольку авиаперевозчик стремится увеличить резервы и финансировать общие корпоративные цели.
- Eli Lilly & Co. продала облигации на \$5 млрд в понедельник, для покупки производителя лекарств для лечения заболеваний желудочно-кишечного тракта Morphic Holding Inc.

Источники: Bloomberg, Нацбанк РК, KASE.

ДИНАМИКА СЕКТОРОВ S&P 500

Источник: Bloomberg

Индексы	Значение	1D	1W	1M	6M	YTD
S&P500	5 344,39	0,00%	3,05%	-4,83%	6,42%	12,05%
NASDAQ COMP	16 780,61	0,21%	3,58%	-8,79%	5,26%	11,79%
DOW JONES	39 357,01	-0,36%	1,69%	-1,61%	1,44%	4,42%
KASE	5 213,76	0,15%	3,56%	-0,42%	17,57%	24,51%
Товары	Значение	1D	1W	1M	6M	YTD
BRENT	\$82,30	3,31%	7,86%	-2,14%	3,82%	8,91%
GOLD	\$2 472,90	1,71%	2,58%	2,55%	22,42%	19,87%
Валюта	Значение	1D	1W	1M	6M	YTD
USD	479.03 ₸	0.42%	0.39%	0.84%	7.23%	5.38%
EUR	523.39 ₸	0.50%	0.18%	1.19%	8.81%	4.21%
RUB	5.31 ₸	-1.12%	-5.68%	-2.39%	8.37%	4.94%
LSE NASDAQ	Значение	1D	1W	1M	6M	YTD
KAP	\$36,65	-0,27%	2,95%	-7,91%	-12,63%	-10,39%
HSBK	\$17,88	1,71%	6,05%	0,90%	15,50%	17,94%
AIRA	\$6,90	0,00%	5,99%	-7,26%	-26,60%	
KSPI US	\$122,92	2,14%	5,97%	-7,75%		
Акции KASE	Значение	1D	1W	1M	6M	YTD
HSBK	₸207,89	1,61%	3,94%	0,62%	18,79%	27,07%
KZAP	₸18 165,11	-0,45%	3,21%	-4,19%	-5,99%	-1,56%
KCEL	₸3 146,00	-1,69%	6,83%	8,67%	28,57%	60,92%
KEGC	₸1 477,50	-0,17%	-0,03%	-0,34%	4,94%	-0,30%
KZTK	₸37 847,00	0,45%	0,90%	-3,22%	10,02%	9,70%
KZTO	₸811,00	-0,09%	-0,12%	-2,05%	-2,41%	-6,24%
CCBN	₸1 984,88	0,40%	2,79%	-0,11%	80,49%	103,15%
KSPI	₸63 002,00	-0,55%	7,55%	-1,27%	44,73%	38,16%
KMGZ	₸13 463,90	0,85%	1,77%	-0,12%	10,81%	16,66%
AIRA	₸826,99	1,47%	-0,23%	-4,81%		

Источники: Bloomberg, Нацбанк РК, KASE.

Сектор	1D	1W	1M	6M	YTD
INFORMATION TECHNOLOGY	0,81%	4,68%	-11,4%	0,51%	7,60%
MATERIALS	-0,45%	0,17%	-2,61%	5,18%	2,99%
CONSUMER DISCRETIONARY	-0,43%	1,36%	-9,37%	-3,40%	-2,96%
UTILITIES	0,16%	1,96%	3,37%	20,97%	16,20%
ENERGY	0,51%	3,76%	-0,93%	6,67%	6,97%
INDUSTRIAL	-0,50%	2,46%	-0,44%	5,55%	8,43%
COMMUNICATION SERVICE	-0,73%	2,84%	-1,98%	6,52%	16,23%
REAL ESTATE	-0,65%	2,22%	3,84%	8,40%	3,56%
FINANCIAL	-0,49%	3,04%	-0,57%	7,44%	11,82%
CONSUMER STAPLES	-0,53%	1,21%	1,55%	7,23%	9,40%
HEALTH CARE	-0,39%	1,73%	0,64%	3,57%	9,38%

Источник: Bloomberg

КАЗАХСТАНСКИЙ РЫНОК

Индекс KASE в понедельник увеличился на 0,15%, достигнув 5 213,76 пункта. Наибольшее количество сделок среди акций из представительского списка было совершено с акциями АО "Народный Банк Казахстана" – 1 239. Самый крупный объем торгов пришёлся на акции АО "Национальная компания "КазМунайГаз" – 97,7 млн тенге. Акции пяти эмитентов показали рост: АО "Народный Банк Казахстана" (+1,61%), АО "Эйр Астана" (+1,47%), АО "Национальная компания "КазМунайГаз" (+0,85%), АО "Казахтелеком" (+0,45%) и АО "Банк ЦентрКредит" (+0,40%).

Доходность операций репо с государственными ценными бумагами (ГЦБ) на один день (TONIA) снизилась на 1 б.п., составив 12,99% годовых. Ставка заимствования тенге под залог долларов США на один день (SWAP-1D (USD)) уменьшилась на 33 б.п., составив 7,62% годовых. Объем торгов однодневными инструментами денежного рынка достиг 634,067 млрд тенге.

На 17:00 средневзвешенный курс доллара США к тенге "завтра" по итогам торгов в понедельник составил 479,16 тенге, что на 1,86 тенге выше предыдущего значения. Объем торгов составил 152,433 млн долларов США при 525 заключённых сделках. Минимальная цена составила 477,50 тенге за доллар США, максимальная – 480,05 тенге, последняя сделка – 479,85 тенге.

К 18:00 по времени Алматы стоимость октябрьских фьючерсов на нефть Brent на лондонской бирже ICE Futures выросла на 0,87%, достигнув \$80,35 за баррель.

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	XS2800066297	USD	500.00MM	5.500	04/15/2027	5.491	100.01		Baa2	BBB	200000.00
Development Bank of Kazakhstan JSC	XS2337670694	USD	254.52MM	2.950	05/06/2031	5.835	84.12		Baa2	BBB	200000.00
Development Bank of Kazakhstan JSC	XS0248160102	USD	106.67MM	6.000	03/23/2026	5.732	100.40	BBB-	Baa2	BBB	100000.00
Development Bank of Kazakhstan JSC	XS2472852610	USD	335.75MM	5.750	05/12/2025	5.447	100.21		Baa2	BBB	200000.00
Eurasian Development Bank	XS2315951041	EUR	357.24MM	1.000	03/17/2026	11.290	85.70	NR	WR	WD	119081.00
Kazakhstan Government International Bond	XS1263139856	USD	1.50MMM	6.500	07/21/2045	5.320	114.79	BBB-	Baa2	BBB	200000.00
Kazakhstan Government International Bond	XS1120709826	USD	1.00MMM	4.875	10/14/2044	5.149	96.57	BBB-	Baa2	BBB	200000.00
Kazakhstan Government International Bond	XS1263054519	USD	2.50MMM	5.125	07/21/2025	4.980	100.13	BBB-	Baa2	BBB	200000.00
Kazakhstan Government International Bond	XS2050933626	EUR	708.70MM	1.500	09/30/2034	3.350	84.32	BBB-	Baa2	BBB	109031.00
Kazakhstan Government International Bond	XS2050933899	EUR	545.16MM	0.600	09/30/2026	3.339	94.45	BBB-	Baa2	BBB	109031.00
Kazakhstan Government International Bond	XS1120709669	USD	1.50MMM	3.875	10/14/2024	4.491	99.89	BBB-	Baa2	BBB	200000.00
Kazakhstan Government International Bond	XS1901718335	EUR	594.95MM	2.375	11/09/2028	3,107	97,13	BBB-	Baa2	BBB	113323.00
KazMunayGas National Co JSC	XS1595713782	USD	1.00MMM	4.750	04/19/2027	5.496	98.15	BB+	Baa2	BBB	200000.00
KazMunayGas National Co JSC	XS1807300105	USD	1.25MMM	5.375	04/24/2030	5.703	98.41		Baa2	BBB	200000.00
KazMunayGas National Co JSC	XS1807299331	USD	1.50MMM	6.375	10/24/2048	6.773	95.28		Baa2	BBB	200000.00
KazMunayGas National Co JSC	XS1595714087	USD	1.25MMM	5.750	04/19/2047	6.779	88.16	BB+	Baa2	BBB	200000.00
KazMunayGas National Co JSC	XS2242422397	USD	750.00MM	3.500	04/14/2033	6.004	83.26		Baa2	BBB	200000.00
QazaqGaz NC JSC	XS1682544157	USD	706.32MM	4.375	09/26/2027	5.879	95.76		Baa2	BB+	200000.00
Fund of National Welfare Samruk-Kazyna JSC	XS2399149694	USD	500.00MM	2.000	10/28/2026	5.579	92.65	BBB-		BBB	200000.00
Tengizchevroil Finance Co International Ltd	XS2010030083	USD	750.00MM	3.250	08/15/2030	6.575	83.71	BB+	Baa2		200000.00
Tengizchevroil Finance Co International Ltd	USG87602AA90	USD	1.00MMM	4.000	08/15/2026	6.091	96.09	BB+	Baa2		200000.00
Tengizchevroil Finance Co International Ltd	XS2010030240	USD	500.00MM	2.625	08/15/2025	6.128	96.62	BB+	Baa2		200000.00

КВАРТАЛЬНЫЕ ОТЧЁТЫ

13 августа	
До торгов	Home Depot
14 августа	
До торгов	Cisco, Cardinal Health, Amcor PLC
15 августа	
До торгов	Walmart, Applied Materials, Admiral Group
19 августа	
До торгов	Paulo Alto Networks, Estee Lauder

СОБЫТИЯ ТЕКУЩЕЙ НЕДЕЛИ

13 августа	Прогноз	Текущее значение
США - Индекс цен производителей (PPI) (м/м) (июль)	0,2%	0,2%
14 августа	Прогноз	Текущее значение
Великобритания - Индекс потребительских цен (ИПЦ) (г/г) (июль)	2,3%	2,0%
США - Индекс потребительских цен (ИПЦ) (г/г) (июль)	3,0%	3,0%
15 августа	Прогноз	Текущее значение
Япония - ВВП (кв/кв) (2 кв.)	0,6%	-0,5%
Великобритания - ВВП (кв/кв) (2 кв.)	0,6%	0,7%
США - Число первичных заявок на получение пособий по безработице	235K	233K
США - Объём розничных продаж (м/м) (июль)	0,4%	0,0%

СОБЫТИЯ ПРЕДСТОЯЩЕЙ НЕДЕЛИ

20 августа	Прогноз	Текущее значение
Евросоюза - Индекс потребительских цен (ИПЦ) (г/г) (июль)		2,6%
22 августа	Прогноз	Текущее значение
США - Индекс деловой активности в производственном секторе (PMI) (авг)		49,6
США - Продажи на вторичном рынке жилья (июль)		3,89M
23 августа	Прогноз	Текущее значение
США - Продажи нового жилья (июль)		617K

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>



t.me/IKStandard

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