

ПРЕСС-РЕЛИЗ

г. Алматы

18 января 2024 года

KASE представляет результаты работы биржевого рынка по итогам 2023 года

АО "Казахстанская фондовая биржа" (KASE или Биржа) информирует об основных итогах деятельности за 2023 год.

- Совокупный объем торгов на KASE в 2023 году составил 410,7 трлн тенге и вырос относительно 2022 года на 57,0 % или 149,1 трлн тенге.
- По итогам 2023 года значение Индекса KASE увеличилось на 28,8 % до 4 187,4 пунктов.
- Капитализация рынка акций выросла за год на 26,4 % до 26,7 трлн тенге.
- Объем торгуемого на KASE корпоративного долга снизился на 6,5 % до 13,5 трлн тенге.
- В 2023 году процедуру листинга прошли ценные бумаги 36 новых эмитентов: два в секторе акций, пять в секторе KASE Global, 28 в секторе корпоративные облигации и один в секторе ценных бумаг международных финансовых организаций.
- По состоянию на 01 января 2024 года в торговых списках KASE находились негосударственные ценные бумаги 656 наименований 237 эмитентов.
- На 01 января 2024 года в Центральном депозитарии числилось 693 тыс. лицевых счетов, физических лиц и 1,7 млн брокерских счетов держателей, учитываемые через омнибус-счета. По итогам 2023 года физическими лицами зарегистрировано 161 тыс. новых лицевых субсчетов.

ПРОЕКТЫ БИРЖИ

В 2023 году KASE продолжила реализацию Стратегии развития на 2022 – 2024 годы, которая включает четыре ключевых направления: повышение ликвидности на биржевых рынках, развитие центрального контрагента, внедрение инноваций и повышение ценности KASE для стейкхолдеров. В рамках реализации Стратегии развития в 2023 году Биржа внедрила ряд проектов по указанным направлениям.

KASE передала осуществление клиринговой и расчетной деятельности на фондовом рынке своей дочерней организации АО "Клиринговой центр KASE" (далее – Клиринговый центр). Целью данного проекта является снижение рисков участников рынка, сокращение транзакционных издержек участников за счет кроссмаржирования и неттинга.

С 25 сентября клиринговыми участниками Клирингового центра являются 42 финансовые организации – члены KASE по категории "фондовая". На момент передачи функций центрального контрагента по фондовому рынку в Клиринговый центр на клиринговое обслуживание были приняты более 1 500 финансовых инструментов, в том числе 989 выпусков ценных бумаг 253 эмитентов, находящихся в официальном списке KASE.

В целях повышения ликвидности на биржевых рынках с 06 марта 2023 года на KASE открыты торги новыми инструментами на валютном рынке – долларом США и евро с расчетами в юанях со сроками осуществления расчетов T+0, T+1 и T+2.

С 02 октября 2023 года KASE приступила к расчету и публикации индексов рынка ГЦБ Республики Казахстан без сегментирования по срокам до погашения (агрегированные индексы).

В течение 2023 года Биржа продолжила работу по выходу компаний малого и среднего бизнеса на организованный рынок ценных бумаг. При поддержке Министерства национальной экономики РК были

внесены поправки в Национальный проект по развитию предпринимательства на 2021-2025 годы, в котором предусмотрено предоставление субсидирования купонной ставки и гарантий по облигациям (опционально). В 2023 году процедуру листинга прошли первые три выпуска облигаций с субсидированием купонной ставки – облигации ТОО "BRBAPK", "зеленые" облигации ТОО "KazWind Energy" ("КазВинд Энерджи") и ТОО "Black Biotechnology (Блэк Биотехнолоджи)".

КЛЮЧЕВЫЕ МЕРОПРИЯТИЯ

В 2023 году при участии Биржи в рамках празднования 30-летия KASE был проведен ряд мероприятий:

- совместно с Акиматом города Астаны и Фондом Земли "Устойчивое развитие" провела торжественную церемонию закладки аллеи KASE в Президентском Парке столицы Казахстана и посадила 100 саженцев сакуры;
- проведено общее годовое собрание членов Международной ассоциации бирж стран СНГ (МАБ СНГ) и Круглый стол валютных и фондовых бирж МАБ СНГ;
- проведена генеральная Ассамблея Федерации евро-азиатских фондовых бирж (FEAS), заседания её Правления и Комитета по аудиту. В рамках ассамблеи проведены Стратегическая сессия и Круглый стол о рынке капитала, в ходе которых участники обсудили новости и перспективы развития бирж – участниц федерации;
- в г. Алматы проведен Международный биржевой форум "Роль бирж в трансформации финансовых рынков" при поддержке Национального Банка Республики Казахстан, Агентства Республики Казахстан по регулированию и развитию финансового рынка и ОЮЛ "Ассоциация финансистов Казахстана" в рамках XI Конгресса финансистов Казахстана. На форуме международные и казахстанские эксперты обсудили мировые тенденции развития финансовых рынков, регуляторные изменения и их влияние на бизнес-среду; вызовы и возможности для развивающихся рынков в области наращивания ликвидности, создание привлекательных условий для локальных и иностранных инвесторов; революционное влияние цифровых инноваций на ландшафт рынка финансовых продуктов и услуг; критическая роль финансового рынка в реализации глобальной ESG-повестки;
- в рамках Международного биржевого форума состоялась церемония награждения партнеров, листинговых компаний и членов KASE, а также экспертов и ведущих специалистов финансового сектора, которые внесли существенный вклад в развитие фондового рынка Казахстана.

Мероприятия для инвесторов и бизнеса

В 2023 году Биржа продолжила организовывать обучающие программы для эмитентов и инвесторов, студентов и представителей средств массовой информации. Используя опыт предшествующих лет, KASE эффективно применяла как онлайн-формат, так и офлайн-формат мероприятий.

Обучающие мероприятия

В целях повышения финансовой грамотности KASE провела следующие мероприятия:

- ознакомительные семинары для студентов Казахстанско-Немецкого университета, Университета КИМЭП, Алматинского экономического колледжа (АЭК) и Университета КАЗГЮУ имени М.С. Нарикбаева, которые были направлены на предоставление информации об основах фондового рынка, использовании мобильного приложения KASE Mobile для проекта "Биржевой симулятор";
- онлайн-вебинары "Фьючерсы на KASE", на котором освещены базовые принципы работы фьючерсов, порядок и доступ к торговле фьючерсами на Бирже;
- онлайн вебинар "Введение в PRI: развитие практики ответственного инвестирования и повышение уровня знаний в области ESG в мировом инвестиционном секторе", где представители PRI Academy рассказали о принципах ответственного инвестирования и деятельности PRI с мировым инвестиционным сектором и продвижением ESG, а также о возможностях расширения компетенций в этом направлении;
- комплексная обучающая программа "Мой портфель на KASE", направленная на повышение финансовой грамотности розничных инвесторов;

- ярмарки казахстанских брокеров "KASE FEST" на площадках ведущих ВУЗов в пяти городах Казахстана в поддержку ежегодной программы World Investor Week 2023 Всемирной федерации фондовых бирж (WFE), церемонии "Ring the Bell for Financial Literacy" и SPO акций АО "KEGOC";
- конкурс среди розничных инвесторов на рынке акций, направленный на продвижение биржевой торговли в Республике Казахстан;
- учебные торги в рамках 15-го образовательного проекта "Биржевой симулятор" для повышения финансовой грамотности студентов ВУЗов Казахстана;
- продолжились выпуски передачи "Биржевые новости KASE" на радио "Business FM", которые освещают информацию о динамике биржевых рынков KASE, проектах Биржи и тенденциях на международных рынках.

Мероприятия для бизнеса

В 2023 году Биржей был проведен ряд мероприятий для бизнеса:

- в рамках проекта "День эмитента" прошли онлайн-встречи с инвесторами, профессиональными участниками рынка ценных бумаг и СМИ руководства ТОО "МФО "Кредит Time", АО "КазТрансОйл", АО "Казхателеком", АО "Кселл", ТОО "Форпост", АО "Home Credit Bank", АО "KEGOC", АО НК "КазМунайГаз" и ТОО "МФО "TAS FINANCE GROUP", в рамках которых представители компаний поделились информацией о финансовых результатах, основных направлениях бизнеса, реализуемых проектах и прогнозных ожиданиях;
- вебинары в целях повышения финансовой грамотности предпринимателей "Инструменты привлечения финансирования на фондовом рынке и их преимущества" и "Управление капиталом компании и способы привлечения финансирования" в рамках обучающей программы "Привлечение финансирования на KASE";
- круглый стол с представителями Союза промышленников и предпринимателей "Ел тірегі", Ассоциации кондитеров, Союза зернопереработчиков Казахстана и Союза машиностроителей Казахстана на тему "Привлечение финансирования на KASE".

Международное сотрудничество

- KASE стала членом Ассоциации ССР12, которая включает более 40 членов, организующих деятельность более 60 центральных контрагентов (ЦК) по всему миру.
- KASE и Green Investment Group (GIG) заключили Меморандум о взаимном сотрудничестве, целью которого является развитие и внедрение принципов устойчивого развития на фондовом рынке Казахстана.
- KASE и Центрально-Азиатская фондовая биржа заключили меморандум о взаимном сотрудничестве, целью которого является обмен опытом в сфере развития рынков капитала и фондовых бирж двух республик.
- KASE провела "KASE Day in Tashkent" в Республике Узбекистан при содействии АО "Узбекская республиканская валютная биржа" и АО "Республиканская фондовая биржа "Тошкент". Мероприятие было направлено на предоставление информации о возможностях получения членства, условиях привлечения финансирования на казахстанском фондовом рынке для узбекских компаний и инвестирования временно свободных средств на рынках KASE.
- На площадке KASE прошла встреча с представителями стран-участниц Центрально-Азиатского регионального экономического сотрудничества (ЦАРЭС) Азиатского банка развития. Участники встречи ознакомились с экспозицией Музея Биржи, узнали процесс запуска и проведения торгов на KASE, а также о роли KASE в финансовой системе страны, инфраструктуре и финансовых инструментах Биржи, трендах биржевого рынка, реализованных проектах и планах KASE в рамках Стратегии развития на 2022-2024 годы.

РЫНОК АКЦИЙ

Капитализация рынка акций с начала года выросла на 26,4 % или 5,6 трлн тенге и составила 26,7 трлн тенге (59,0 млрд USD).

На конец 2023 года в торговых списках Биржи находились акции 99 наименований 84 эмитентов.

В 2023 году в официальный список Биржи были включены акции трех наименований двух эмитентов (АО "ALTYN SAMRUK QAZAQSTAN", АО "ФИНАНСОВЫЙ ХОЛДИНГ "РЕСПУБЛИКА").

В 2023 году из торгового списка Биржи исключены акции 18 наименований, из них в четвертом квартале из официального списка Биржи были исключены акции трех наименований: простые акции АО "Страховая компания "Amanat", АО "First Heartland Securities" по инициативе их эмитента и АО "CHINATOWN" в связи с ликвидацией в качестве юридического лица.

Объем торгов акциями в 2023 году относительно 2022 года увеличился на 8,5 % или 26,3 млрд тенге до 333,6 млрд тенге. Среднедневной объем торгов составил 1 356,0 млн тенге (на вторичном рынке – 1 224,0 млн тенге), среднее количество сделок – 3 261 (на вторичном рынке – 3 109 сделок), средний объем одной сделки – 415,8 тыс. тенге (на вторичном рынке – 393,7 тыс. тенге).

Объем первичного рынка оценивается в 32,5 млрд тенге, снизившись относительно 2022 года на 76,5% или 106,0 млрд тенге. В 2023 году в секторе акций прошли следующие размещения:

В январе 2023 года АО "AMF Group" разместило 561 678 акций на сумму 144,9 млн тенге.

В октябре 2023 года в рамках подписки АО "Phystech II" разместило 13 650 000 акций на сумму 13,7 млрд тенге.

В октябре-ноябре состоялось SPO АО "KEGOC", в рамках которого в торговой системе KASE компания привлекла 18,7 млрд тенге, что составило 82,4 % от общего объема размещения.

В ходе подписки на простые акции KZ1C00000959 (KEGC) АО "KEGOC" на KASE от инвесторов поступило 37 445 заявок на общую сумму 28,8 млрд тенге. Спрос к предложению на KASE составил 127 %. На KASE удовлетворено 37 444 заявки в совокупном объеме 18,7 млрд тенге. Таким образом, было удовлетворено 64,9 % от общего объема спроса на KASE. При этом в полном объеме были удовлетворены все активные заявки, поданные физическими лицами, заявки юридических лиц были удовлетворены частично, и одна заявка институционального инвестора не была удовлетворена. По результатам размещения на счета физических лиц поступило бумаг на сумму 12,6 млрд тенге (67,6 % от объема размещения на KASE), объем удовлетворенных заявок, поданных институциональными инвесторами, составил 4,4 млрд тенге (23,4 %), юридическими лицами – 1,7 млрд тенге (9,0 %).

В рамках права преимущественной покупки для действующих акционеров АО "KEGOC", которая проходила на KASE с 28 сентября по 27 октября 2023 года, была осуществлена продажа акций объемом 3,9 млн тенге.

В разрезе основных категорий инвесторов на первичном рынке доля физических лиц составила 39,3 %, доля банков – 4,3 %, доля брокерско-дилерских организаций – 3,0 %, других институциональных инвесторов – 6,1 %, прочих юридических лиц – 47,2 %. Участие нерезидентов оценивается в 0,4 %.

Объем торгов на вторичном рынке акций увеличился на 78,3 % или 132,2 млрд тенге и составил 301,1 млрд тенге. В разрезе основных категорий инвесторов на вторичном рынке наиболее активными являются физические лица, на долю которых пришлось 42,9 % от брутто-оборота торгов акциями. Участие банков оценивается в 4,3 %, брокерско-дилерских организаций – в 9,8 %, других институциональных инвесторов – в 6,5 %, на долю прочих юридических лиц пришлось 36,4 %. Участие нерезидентов оценивается в 29,8 % от брутто-оборота торгов акциями.

ИНДЕКС KASE

С начала 2023 года Индекс KASE вырос на 28,8 % до 4 187,38 пунктов. 05 декабря 2023 года Индекс KASE вновь обновил исторический максимум и составил 4 251,24. Минимальное значение было зафиксировано 16 марта – 3 243,13 пунктов.

В первом квартале 2023 года Индекс KASE стабильно находился в диапазоне 3 243,13-3 382,79 пунктов. Со второго квартала наблюдался стабильный рост казахстанского рынка. По итогам года положительную динамику продемонстрировали все акции Представительского списка Индекса KASE за исключением акций KEGOC. Наибольший рост показали акции финтех сектора и энергетического сектора, а именно АО "Банк ЦентрКредит", АО "Национальная атомная компания "Казатомпром" и АО

Kaspi.kz. Основными факторами роста акций Индекса KASE являются публикация финансовых отчетов, дивидендные выплаты, а также рост стоимости сырья на мировых рынках.

Совокупный объем торгов индексными акциями по итогам 2023 года составил 229,0 млрд тенге, учитывая включение акций АО "НК "КазМунайГаз" в Представительский список Индекса KASE 03 февраля 2023 года. Данный показатель увеличился в 2,9 раз по отношению к аналогичному показателю 2022 года.

Изменение цен акций по последним сделкам, входящих в представительский список Индекса KASE

| Эмитент | Торговый код | Цена, тенге за акцию | | | Объем торгов*, млн тенге | | |
|---|--------------|----------------------|-------------|--------|--------------------------|----------|------------|
| | | на 01.01.24 | на 01.01.23 | Δ, % | 2023 год | 2022 год | Δ |
| АО "Банк ЦентрКредит" | CCBN | 977,06 | 640,00 | +52,7% | 6 387,0 | 12 350,8 | -5 963,8 |
| АО "Национальная атомная компания "Казатомпром" | KZAP | 18 460,00 | 12 874,00 | +43,4% | 9 393,9 | 4 428,7 | +4 965,2 |
| АО Kaspi.kz | KSPI | 45 600,00 | 33 196,50 | +37,4% | 4 259,2 | 3 646,3 | +612,9 |
| АО "Народный банк Казахстана" | HSBK | 163,60 | 126,47 | +29,4% | 14 082,3 | 11 810,7 | +2 271,6 |
| АО "НК "КазМунайГаз" | KMGZ | 11 541,00 | 9 430,00 | +22,4% | 156 544,2 | 23 172,1 | +133 372,1 |
| АО "Казактелеком" | KZTK | 34 500,00 | 28 362,32 | +21,6% | 8 173,7 | 2 547,3 | +5 626,3 |
| АО "КазТрансОйл" | KZTO | 865,00 | 734,00 | +17,8% | 11 038,5 | 3 567,3 | +7 471,3 |
| АО "Kcell" | KCEL | 1 954,98 | 1 725,00 | +13,3% | 13 880,8 | 17 199,5 | -3 318,7 |
| АО "KEGOC" | KEGC | 1 482,00 | 1 620,02 | -8,5% | 5 247,3 | 1 118,0 | +4 129,3 |

*без учета крупных сделок и сделок нерегулярного характера

Акции **АО "Банк ЦентрКредит"** за год выросли в цене на 52,7 %. По итогам девяти месяцев 2023 года чистая прибыль составила 103,6 млрд тенге. При этом, годовая чистая прибыль Банка за 2022 финансовый год выросла более чем в семь раз – с 20,6 до 145,1 млрд тенге. Собственный капитал Банка за девять месяцев 2023 года увеличился с 273,9 млрд тенге до 381,8 млрд тенге за счет роста нераспределенной прибыли на 44,7%. S&P Global Ratings в июле повысило долгосрочный кредитный рейтинг Банка с В+ до ВВ- с прогнозом "Стабильный", Moody's Investors Service повысило рейтинг Банка с до Ва2 с Ва3 и сохранило прогноз "Позитивный". Банк не направлял чистую прибыль на выплату дивидендов.

Простые акции **АО "Национальная атомная компания "Казатомпром"** в 2023 году выросли на 43,4 %, уступив только акциям АО "Банк ЦентрКредит". Основным фактором роста являлись цены на сырье на мировых товарных рынках, которые продемонстрировали существенный рост в течение 2023 года на фоне нарушения логистики и цепочки поставок из-за политического кризиса в Нигер, на долю которого приходится 4,7% от мирового объема производства топливного урана. Годовая чистая прибыль Казатомпром увеличилась более чем в 2 раза до 473,0 млрд тенге в 2022 году с 220 млрд тенге 2021 года. По итогам девяти месяцев 2023 года чистая прибыль Компании снизилась с 138,9 млрд тенге до 78,6 млрд тенге за счет уменьшения выручки с 134,2 млрд тенге до 93,6 млрд тенге. 25 мая годовое общее собрание акционеров приняло решение выплатить дивиденды в размере 200,9 млрд тенге, или 774,88 тенге на одну акцию. Moody's Investors Service подтвердил рейтинг Компании на уровне Ваа2 и изменил прогноз со "Стабильного" на "Позитивный".

За 2023 год простые акции **АО Kaspi.kz** выросли на 37,4 %. Чистая прибыль Группы выросла в 2022 году на 35,3% – с 435,2 млрд тенге до 588,8 млрд тенге. Чистая прибыль за девять месяцев 2023 год также увеличилась на 50% с 400,6 млрд тенге до 600,8 млрд тенге. 10 апреля 2023 года акционеры утвердили выплату дивидендов по простым акциям Компании за 2022 год в размере 600 тенге на акцию. 24 мая 2023 года акционеры приняли решение о выплате дивидендов по простым акциям за первый квартал 2023 года в размере 750 тенге за одну акцию. 23 августа внеочередным общим собранием акционеров было принято решение о выплате дивидендов по простым акциям за второй квартал 2023 года в размере 750 тенге на одну акцию. 20 ноября акционеры Компании приняли решение о выплате дивидендов за третий квартал 2023 года в размере 850 тенге на одну акцию.

Простые акции **АО "Народный сберегательный банк Казахстана"** по итогам года выросли в цене на 29,4 %. Чистая прибыль Банка увеличилась с 462,4 млрд тенге в 2021 году до 553,8 млрд тенге в 2022 году. Прибыль на акцию выросла с 30,16 тенге до 50,84 тенге. 25 мая 2023 года по итогам деятельности за 2022 год Банк принял решение направить на выплату дивидендов 276,9 млрд тенге или 25,38 тенге

на акцию. По итогам девяти месяцев 2023 года чистая прибыль Банка выросла с 410,9 млрд тенге до 537,3 млрд тенге.

Акции **АО "НК "КазМунайГаз"** демонстрировали стабильный рост в течение 2023 года. С начала 2023 года акции показали рост в 22,4 % до 11 541,00 тенге, при этом рост от цены IPO составил 37,3 %. Чистая прибыль Компании за 2022 год выросла до 1 317,3 млрд тенге с 1 286,5 млрд тенге в 2021 году. За девять месяцев 2023 года чистая прибыль снизилась до 949,0 млрд тенге с 1 161,3 млрд тенге годом ранее. Снижение произошло за счет сокращения выручки по договорам с покупателями на более чем 10 % до 6 087,4 млрд тенге, снижения доли прибыли в совместных предприятиях на 27,4 % до 565,2 млрд тенге. 19 мая 2023 года Совет директоров Компании рекомендовал направить 300 млрд тенге на выплату дивидендов за 2022 год в размере 491,71 тенге на одну простую акцию. 22 июня 2023 года Fitch Ratings повысило рейтинг Компании на уровень BBB, прогноз "стабильный". 13 декабря 2023 Moody's подтвердило долгосрочный рейтинг Компании на уровне Baa2, повысив прогноз со "стабильного" на "позитивный". S&P Global Ratings также подтвердил рейтинг Компании на уровне "BB+", пересмотрев прогноз на "стабильный".

Простые акции **АО "Казхтелеком"** выросли в цене на 21,6 %. Консолидированная чистая прибыль Группы за 2022 год увеличилась на 32 % с 97,4 до 128,8 млрд тенге. За девять месяцев 2023 года чистая прибыль выросла до 89,3 млрд тенге по сравнению с 88,7 млрд тенге за аналогичный период прошлого года. 27 октября общим собранием акционеров было принято решение направить на выплату дивидендов за 2022 год 33,4 млрд тенге или 3 038,36 тенге на одну простую акцию.

За 2023 год цена акций **АО "КазТрансОйл"** выросла на 17,8 %. Консолидированная годовая чистая прибыль за 2022 год снизилась с 50,6 до 19,8 млрд тенге. По итогам девяти месяцев 2023 года чистая прибыль выросла с 25,2 до 33,3 млрд тенге за счет увеличения затрат себестоимости со 173,2 млрд тенге до 219,4 млрд тенге, а также роста расходов от выбытия и обесценения основных средств с 0,3 млрд тенге до 12,9 млрд тенге. 24 мая 2023 года общее собрание акционеров приняло решение направить на выплату дивидендов 15,0 млрд тенге или 39,00 тенге на одну простую акцию. Fitch Ratings повысило рейтинг Компании с "BBB-" до "BBB" с прогнозом "Стабильный".

Акции **АО "Кселл"** по итогам выросли на 13,3 % до 1 954,98 тенге. По итогам 2022 года чистая прибыль компании выросла на 24,1 % до 40,4 млрд тенге. При этом, по итогам девяти месяцев 2023 года чистая прибыль снизилась до 23,6 млрд тенге по сравнению с 32,5 млрд тенге аналогичного периода 2022 года. Компания решила не распределять чистый доход компании за 2022 год и не выплачивать дивиденды по простым акциям.

Снижение в 2023 году в 8,5 % продемонстрировали простые акции **АО "KEGOC"**. При этом, основное снижение цены произошло до проведения SPO. В рамках SPO цена размещения бумаг составила 1 482 тенге за акцию. После проведения SPO акции торговались в диапазоне 1 475-1 560 тенге за акцию. Опубликованная консолидированная финансовая отчетность за 2022 год показала снижение чистой прибыли Компании с 52,6 млрд тенге в 2021 году до 26,7 млрд тенге. Финансовая отчетность за девять месяцев 2023 года продемонстрировала увеличение чистой прибыли на 39% до 28,6 млрд тенге с 20,6 млрд тенге годом ранее. АО "KEGOC" выплатило дивиденды по простым акциям за второе полугодие 2022 года в размере 50,59 тенге на одну акцию. При этом, учитывая выплаты дивидендов за первое полугодие 2022 года на акцию в размере 50,59 тенге, суммарный размер выплаченных дивидендов за 2022 год составил 30,2 млрд тенге или 65,44 тенге на одну простую акцию. 26 сентября 2023 года акционеры приняли решение о выплате дивидендов за первое полугодие 2023 года в размере 77,74 тенге на акцию.

СЕКТОР "KASE GLOBAL"

На конец декабря 2023 года в секторе KASE Global находились акции 45 наименований и 11 ETF иностранных эмитентов. В 2023 году в сектор KASE Global были включены ProShares Bitcoin Strategy ETF и Global X Robotics & Artificial Intelligence ETF.

По итогам 2023 года в секторе "KASE Global" объем торгов составил 36,5 млрд тенге, увеличившись в сравнении с 2022 годом на 41,7 % или 10,8 млрд тенге. Среднедневной объем торгов составил 148,6 млн тенге, среднедневное количество сделок – 246, средний объем одной сделки – 603,3 тыс. тенге.

Наибольшее количество сделок в секторе "KASE Global" за 2023 год заключено со следующими акциями:

- Tesla (TSLA_KZ) – 6 714 сделок на общую сумму 1 610,4 млн тенге
- Ford Motor Company (F_KZ) – 6 017 сделок на общую сумму 220,7 млн тенге;
- Intel Corporation (INTC_KZ) – 5 135 сделок на общую сумму 1 108,9 млн тенге.

Среди основных категорий инвесторов на долю брокерско-дилерских организаций пришлось 36,0 %, на долю других институциональных инвесторов – менее 0,1 %, на долю прочих юридических лиц – 26,2 %, на долю физических лиц – 37,8 % Доля нерезидентов составляет 0,6 %.

КОРПОРАТИВНЫЕ ОБЛИГАЦИИ

Объем корпоративного долга в обращении в 2023 году снизился на 6,5 % или 944,2 млрд тенге до 13,5 трлн тенге (29,7 млрд USD).

На конец декабря 2023 года в официальном списке KASE находились корпоративные облигации 412 выпуска 106 эмитентов. За 2023 год в официальный список KASE были включены облигации 126 выпусков 59 эмитента (29 новых эмитентов), из них в четвертом квартале – облигации 54 выпусков 37 эмитентов (20 новых эмитентов). В 2023 году из официального списка KASE были исключены 58 выпусков корпоративных облигаций 35 эмитентов, из них в четвертом квартале 18 выпусков 17 эмитентов.

Значение индекса доходности корпоративных облигаций KASE_BMY в 2023 году выросло на 180 базисных пункта до 14,46 % годовых.

Объем торгов корпоративными облигациями на KASE снизился относительно 2022 года на 12,1 % или 301,5 млрд тенге до 2,2 трлн тенге. Среднедневной объем торгов составил 8,9 млрд тенге (на вторичном рынке – 2,7 млрд тенге), среднедневное количество сделок – 180 сделок (на вторичном рынке – 166 сделок), средний объем одной сделки – 49,4 млн тенге (на вторичном рынке – 16,2 млн тенге).

В 2023 году на первичном рынке корпоративных облигаций были размещены облигации 79 выпусков 40 эмитентов на общую сумму 1 522,4 млрд тенге, что выше показателя 2022 года на 2,0 % или 30,2 млрд тенге. В четвертом квартале 2023 года были размещены корпоративные облигации 24 выпусков 22 эмитентов на общую сумму 213,6 млрд тенге, снизившись относительно показателя третьего квартала на 62,3 %:

- АО "Казахстанский фонд устойчивости" привлекло 60,2 млрд тенге, разместив два выпуска облигаций со средневзвешенной доходностью к погашению 13,86–14,79 % годовых и сроком до погашения от 0,8 до двух лет;
- ТОО "RG Brands Kazakhstan" привлекло 9,3 млрд тенге, разместив облигации с доходностью к погашению 29,80 % годовых и сроком до погашения 9,8 лет;
- ТОО "МФО "TAS FINANCE GROUP" (ТАС ФИНАНС ГРУПП) привлекло 8,4 млрд тенге, разместив двухлетние облигации с доходностью к погашению 22,00 % годовых;
- ТОО "Алтын Сапа АЛМ" привлекло 4,6 млрд тенге, разместив облигации с доходностью к погашению 25,00 % годовых и сроком до погашения 1,9 лет;
- АО "МФО ОнлайнКазФинанс" привлекло 4,5 млрд тенге, разместив двухлетние облигации со средневзвешенной доходностью к погашению 21,00 % годовых;
- ТОО "Ел Орда Арнау" привлекло 3,2 млрд тенге, разместив облигации с доходностью к погашению 25,00 % годовых и сроком до погашения 1,9 лет;
- ТОО "Capital Leasing Group (Капитал Лизинг Груп)" привлекло 3,0 млрд тенге, разместив трехлетние облигации под 21,50 % годовых;
- ТОО "KazWind Energy" ("КазВинд Энерджи") привлекло 3,0 млрд тенге, разместив пятилетние "зеленые" облигации с доходностью к погашению 21,75 % годовых;
- ТОО "Black Biotechnology (Блэк Биотехнолоджи)" привлекло 1,5 млрд тенге, разместив трехлетние "зеленые" облигации со средневзвешенной доходностью к погашению 21,50 % годовых;
- ТОО "Birinshi Lombard" (Бірінші Ломбард) привлекло 1,4 млрд тенге, разместив двухлетние облигации с доходностью к погашению 24,00 % годовых;
- АО "Лизинг Групп" привлекло \$1,0 млн (459,7 млн тенге), разместив облигации под 9,90 % годовых и сроком до погашения 0,8 лет;
- ТОО "Микрофинансовая организация "R-Finance" привлекло 366,5 млн тенге, разместив трехлетние облигации под 25,00 % годовых;
- ТОО "Orbis Leasing" привлекло 230,1 млн тенге, разместив облигации под 20,00 % годовых и сроком до погашения;

- ТОО "ТССП Групп" привлекло 51,2 млн тенге, разместив облигации под 20,00 % годовых и сроком до погашения;
- АО "ALTYN SAMRUK QAZAQSTAN" привлекло \$80,0 тыс. (36,6 млн тенге), разместив трехлетние облигации под 9,00 % годовых.

В разрезе основных категорий инвесторов на первичном рынке корпоративных облигаций доля банков занимает 17,6 %, брокерско-дилерских организаций – 1,3 %, других институциональных инвесторов – 22,1 %, прочих юридических лиц – 54,7 %, физических лиц – 4,3 %. Доля участия нерезидентов составила 8,3 %.

Объем торгов на вторичном рынке облигаций относительно 2022 года уменьшился на 33,3 % или 331,8 млрд тенге до 664,9 млрд тенге.

В разрезе основных категорий инвесторов на вторичном рынке корпоративных облигаций доля банков составила 12,9 %, брокерско-дилерских организаций – 6,1 %, других институциональных инвесторов – 13,1 %, прочих юридических лиц – 57,0 %, доля физических лиц – 10,9 %. Доля нерезидентов составила 21,5 %.

ГОСУДАРСТВЕННЫЕ ЦЕННЫЕ БУМАГИ (ГЦБ)

Сумма государственного долга по номиналу, торгуемого на KASE, составила 23,9 трлн тенге (52,6 млрд USD), увеличившись за 2023 год на 10,7 % или 2,3 трлн тенге.

Суммарный объем торгов ГЦБ на KASE составил 8,0 трлн тенге и вырос относительно 2022 года на 33,5 % или 2,0 трлн тенге. Среднедневной объем торгов составил 32,6 млрд тенге (на вторичном рынке – 11,3 млрд тенге), среднее количество сделок – 22 (на вторичном рынке – 16), средний объем одной сделки – 1,5 млрд тенге (средний объем одной сделки на вторичном рынке – 0,7 млрд тенге).

Объем торгов на первичном рынке ГЦБ вырос на 26,3 % или на 1 090,2 млрд тенге до 5 235,8 млрд тенге. Из них 139,6 млрд тенге привлекли акиматы 15-ти областей, г. Алматы, г. Астана и г. Шымкент. Министерство финансов привлекло 5 096,3 млрд тенге со средневзвешенной доходностью 11,50–17,78 % годовых, разместив 36 выпусков (10 новых выпусков и 26 выпусков были укрупнены) со сроком до погашения 0,5–16,0 лет.

При этом в четвертом квартале 2023 года объем размещений составил 339,9 млрд тенге, из них 54,0 млрд тенге привлекли акиматы 11-ти областей, Министерство финансов – 286,0 млрд тенге. Ставки на аукционах размещений Министерства финансов складывались в диапазоне 11,70–14,00 % годовых в рамках размещений 15-ти выпусков со сроком до погашения 1,3–12,7 лет.

В 2023 году в разрезе основных категорий инвесторов на первичном рынке на долю банков пришлось 48,8 %, на долю брокеров-дилеров – 1,6 %, на долю других институциональных инвесторов – 40,7 %, на долю прочих юридических лиц – 8,9 %, на долю физических лиц – менее 0,1 %. Доля нерезидентов на первичном рынке ГЦБ составила менее 0,1 %.

Объем торгов на вторичном рынке вырос на 49,4 % или на 918,5 млрд тенге и достиг 2 777,2 млрд тенге. Доля торгов нотами Национального Банка на вторичном рынке составила 48,8 % или 1 354,8 млрд тенге от общего объема торгов, доля МЕКАМ – 46,9 % или 1 303,8 млрд тенге, доля еврооблигаций Республики Казахстан – 0,3 % или 8,5 млрд тенге, оставшиеся 4,0 % или 110,1 млрд тенге приходятся на сделки с ГЦБ иностранных государств.

В четвертом квартале объем торгов ГЦБ на вторичном рынке составил 713,9 млрд тенге, при этом доля торгов нотами Национального Банка на вторичном рынке – 66,0 % или 471,4 млрд тенге от общего объема торгов, доля МЕКАМ – 31,5 % или 224,7 млрд тенге, доля еврооблигаций – 0,5 % или 3,3 млрд тенге, оставшиеся 2,0 % или 14,5 млрд тенге пришелся на сделки с ГЦБ иностранных государств.

В 2023 году в разрезе основных категорий инвесторов на вторичном рынке на долю банков пришлось 42,4 %, на долю брокеров-дилеров – 4,0 %, на долю других институциональных инвесторов – 7,3 %, на долю прочих юридических лиц – 45,2 %, на долю физических лиц – 1,1 %. Участие нерезидентов оценивается в 8,6 %.

ОБЛИГАЦИИ МЕЖДУНАРОДНЫХ ФИНАНСОВЫХ ОРГАНИЗАЦИЙ (МФО)

На конец 2023-го года в торговых списках KASE находилось 60 выпусков облигаций пяти международных финансовых организаций: 11 выпусков Азиатского банка развития, 27 выпусков Евразийского банка развития, 16 выпусков Европейского банка реконструкции и развития, четыре выпуска Международной финансовой корпорация (IFC) и один выпуск Исламской корпорации по развитию частного сектора.

В 2023 году в официальный список включено 25 выпусков облигаций: 15 выпусков Евразийского банка развития, 4 выпуска Европейского банка реконструкции, 3 выпуска Азиатского банка развития, два выпуска IFC и один выпуск Исламской корпорации по развитию частного сектора.

В 2023 году из официального списка были исключены 5 выпусков облигаций: один выпуск Азиатского банка развития и четыре выпуска Евразийского банка развития в связи с истечением срока обращения.

За 2023 год объем торгов составил 337,1 млрд тенге, что выше результата прошлого года в 2,7 раза или на 210,1 млрд тенге. Количество сделок по сравнению с прошлым годом увеличилось 31,0 %, достигнув 473 сделок.

На первичном рынке сектора облигаций международных финансовых организаций в 2023 году были размещены 13 выпусков пяти международных финансовых организаций на общую сумму 280,2 млрд тенге, что выше показателя 2022 года в 3,2 раза или на 193,7 млрд тенге. При этом в четвертом квартале было размещено шесть выпусков трех международных финансовых организаций на общую сумму 117,8 млрд тенге, что выше третьего квартала в 4,7 раза:

- Евразийский банк развития привлек:
 - 9,9 млрд тенге, разместив дисконтные облигации с доходностью 16,20 % годовых и сроком до погашения 28 дней;
 - \$10,1 млн (4,7 млрд тенге), разместив трехлетние облигации под 5,72 % годовых;
 - 50,0 млрд тенге, разместив облигации под 14,20 % годовых и сроком до погашения 3,5 года;
- Европейский банк реконструкции и развития привлек 40,0 млрд тенге, разместив двухлетние облигации под 13,60 % годовых;
- Международная финансовая корпорация привлекла 13,2 млрд тенге, разместив два выпуска облигации под 13,65% годовых и 13,90 % годовых и сроком до погашения 4,9 и 2,6 лет.

В разрезе основных категорий инвесторов в 2023 году на первичном рынке доля банков составила 56,2 %, брокерско-дилерских организаций – 4,8 %, других институциональных инвесторов – 20,8 %, прочих юридических лиц – 18,0 % и физических лиц – 0,2 %. Доля нерезидентов составила менее 0,1 %.

На вторичном рынке объем торгов составил 56,9, млрд тенге, что на 40,5 % или на 16,4 млрд тенге выше, чем в 2022 году.

В разрезе основных категорий инвесторов на вторичном рынке за 2023 год на долю банков пришлось 2,6 %, на долю брокерско-дилерских организаций – 8,8 %, на долю других институциональных инвесторов – 22,5 %, на долю прочих юридических лиц – 62,4 %, на долю физических лиц – 3,6 %. Участие нерезидентов оценивается в 21,7 %.

ПАИ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ФОНДОВ

На 01 января 2024 года в секторе "Ценные бумаги инвестиционных фондов" находился 18 инструментов паевых инвестиционных фондов под управлением пяти управляющих компаний и шесть ETF.

В 2023 году объем торгов составил 14,3 млрд тенге и вырос относительно 2022 года на 61,3 % или 5,4 млрд тенге. В разрезе основных категорий инвесторов 41,0 % приходится на физические лица, 15,6 % – на брокерско-дилерские организации, 7,3 % – на других институциональных инвесторов, 36,1 % – на прочих юридических лиц. Доля нерезидентов составила 8,3 %.

ПРОИЗВОДНЫЕ ЦЕННЫЕ БУМАГИ

По состоянию на 01 января 2024 года в официальном списке KASE находились глобальные депозитарные расписки (ГДР) пяти выпусков, базовыми активами которых являются простые акции АО "Национальная атомная компания "Казатомпром", АО "Народный сберегательный банк Казахстана", АО Kaspi.kz, АО "Казакхтелеком" и АО "ForteBank".

Объем торгов в 2023 году составил 1,8 млрд тенге и снизился относительно 2022 года на 90,0% или на 16,6 млрд тенге. В разрезе основных категорий инвесторов 33,8 % пришлось на брокерско-дилерские организации, 10,3 % – на счета других институциональных инвесторов, 15,7 % – на прочих юридических лиц, 40,3 % - на долю физических лиц. Доля нерезидентов составила 0,1 %.

СЧЕТА ФИЗИЧЕСКИХ ЛИЦ НА РЫНКЕ ЦЕННЫХ БУМАГ

По состоянию на 01 января 2024 года в Центральной депозитарии числилось 693 тыс. лицевых счетов, физических лиц и 1,7 млн брокерских счетов держателей, учитываемые через омнибус-счета. По итогам 2023 года физическими лицами зарегистрировано 161 тыс. новых лицевых счетов.

РЫНОК ИНОСТРАННЫХ ВАЛЮТ

В 2023 году в торгах на рынке иностранных валют на KASE принимало участие 35 членов KASE. Объем торгов составил 29,7 трлн тенге, что выше аналогичного показателя 2022 года на 42,9 % или 8,9 трлн тенге. Среднедневной объем торгов составил 120,8 млрд тенге, среднее количество сделок – 605, средний объем одной сделки – 199,5 млн тенге.

С 06 марта 2023 года на валютном рынке были запущены торги парами доллар США-китайский юань и евро-китайский юань. С валютной парой доллар США-китайский юань за март-декабрь 2023 года заключено 828 сделок объемом 2,9 млрд долларов США (1,3 трлн тенге) с расчетами в китайской валюте. По итогам 2023 года доля торгов парой доллар США-китайский юань в общем объеме торгов иностранной валютой составила 4,4 %.

В 2023 году доля торгов валютной парой доллар США-казахстанский тенге в общем объеме торгов иностранной валютой снизилась до 62,7 %, в 2022 году доля торгов данной валютной парой составляла 75,7 %. При этом возросла доля торгов валютной парой евро-доллар США и по итогам года составила 23,1 %.

В нижеприведенной таблице приводятся основные характеристики торгуемых на KASE валютных пар (в скобках указано изменение показателя к аналогичному периоду прошлого года, изменение курса отражает номинальное изменение средневзвешенного биржевого курса иностранной валюты к KZT).

| Пара | Объем, млн единиц валюты | Доля в объеме торгов, % | Число сделок | Мин. и макс. курсы, кол-во котируемой валюты за ед. базовой | Курс на конец периода (изм.%) |
|---------|--------------------------|-------------------------|----------------------|---|-------------------------------|
| USD/KZT | 40 812,9 (+26,3 %) | 62,7 % (-9,1 %) | 106 919 (+34 057) | 426,85-486,00 | 454,69 (-1,7 %) |
| RUB/KZT | 403 342,6 (+36,0 %) | 7,1 % (-3,2 %) | 30 872 (+22 498) | 4,4256-6,8900 | 5,0644 (-20,2 %) |
| CNY/KZT | 4 444,9 (-47,9 %) | 1,0 % (-1,9 %) | 1 869 (-306) | 61,0800-68,9800 | 63,9540 (-3,1 %) |
| EUR/KZT | 999,5 (x2,5) | 1,7 % (+0,8 %) | 4 354 (+3 079) | 456,51-513,54 | 504,00 (+2,3 %) |
| EUR/USD | 13 887,7 (x2,2) | 23,1 % (+8,9 %) | 4 078 (+3 027) | 1,0454-1,1255 | 1,1120 (+4,7 %) |
| USD/CNY | 2 872,5 (-) | 4,4% (-) | 828 (-) | 6,8510-7,3580 | 7,1124 (+2,8 %) |
| EUR/CNY | 0,1 (-) | <0,1% (-) | 1 (-) | 7,8265 | 7,8265 (-) |

ДЕНЕЖНЫЙ РЫНОК

Совокупный объем торгов на денежном рынке составил 370,1 трлн тенге, увеличившись относительно показателя прошлого года на 59,6 % или на 138,2 трлн тенге.

Вслед за снижением базовой ставки Национального Банк РК и ставками денежного рынка, композитный индикатор денежного рынка MM_Index, представляющий собой средневзвешенное значение через объем сделок значение доходности по операциям валютного свопа USD/KZT и операциями автоматического репо с ГЦБ, открытыми на один рабочий день, уменьшился на 266 б.п. с 17,85 % годовых до 15,19 % годовых.

Рынок операций репо

Совокупный объем операций репо за 2023 год составил 306,6 трлн тенге, что больше аналогичного показателя 2022 года на 103,9 трлн тенге или на 51,3 %. Среднедневной объем операций составил 1 246,3 млрд тенге, среднее количество ежедневных заключенных сделок – 1 185, средний объем одной сделки – 1 051,6 млн тенге. В структуре операций репо 78,9 % составили операции авторепо с ГЦБ, авторепо с НЦБ – 21,1 %, прямое репо с НЦБ – 0,02%, прямое репо с ГЦБ – 0,002 %. Была заключена 21 сделка авторепо с КСУ на 1,5 млрд тенге, превысив показатель прошлого года в 5,1 млн тенге.

По итогам 2023 года индикатор TONIA снизился на 144 б.п. с 17,63 % до 16,19 % годовых, значение индикатора TRION – на 137 б.п. с 17,56 % до 16,19 % годовых, значение индикатора TWINA - на 154 б.п. с 17,04% до 15,50% годовых.

Операции валютного свопа

Совокупный объем операций валютного свопа увеличился в 2,2 раза или на 34,3 трлн тенге до 63,5 трлн тенге с 29,2 трлн тенге в 2022 году. Среднедневной объем операций в 2022 году составил 258,1 млрд тенге, среднее количество сделок – 28, средний объем одной сделки – 9,2 млрд тенге.

В структуре валютного свопа 62 831,9 млрд тенге, или 99,0 % от объема торгов свопами, пришлось на свопы USDKZT; 658,5 млрд тенге, или 1,0 %, – на RUBKZT; 2,3 млрд тенге, или менее 0,1 %, – на EURKZT.

| Валютная пара | Инструмент | Объем, млрд тенге | Объем, млн ед. валюты | Доля в объеме торгов, % |
|---------------|--------------|-------------------|-----------------------|-------------------------|
| USD/KZT | USDKZT_0_001 | 25 144,7 | 54 682,2 | 39,6% |
| | USDKZT_0_002 | 37 234,2 | 81 509,7 | 58,6% |
| | USDKZT_0_01W | 226,5 | 497,0 | 0,4% |
| | USDKZT_0_01M | 101,0 | 220,2 | 0,2% |
| | USDKZT_0_03M | 124,2 | 275,0 | 0,2% |
| | USDKZT_1_001 | 1,3 | 2,7 | <0,1% |
| EUR/KZT | EURKZT_0_001 | 0,2 | 0,5 | <0,1% |
| | EURKZT_1_001 | 2,0 | 4,1 | <0,1% |
| RUB/KZT | RUBKZT_0_001 | 43,6 | 8 589,5 | 0,1% |
| | RUBKZT_0_002 | 615,0 | 113 800,0 | 1,0% |

Доходность однодневного долларowego свопа SWAP-1D (USD) значительно снизилась в течение 2023 года на 901 б.п. с 18,62 % годовых до 9,60% годовых. Доходность двухдневного валютного свопа SWAP-2D (USD) уменьшилась на 670 б.п. с 18,68 % годовых до 11,98 % годовых.

РЫНОК ДЕРИВАТИВОВ

В настоящий момент в данном секторе биржевого рынка к торговле доступны беспоставочные фьючерсы на курс доллара США к тенге, курс российского рубля к тенге, простые акции АО "Народный сберегательный банк Казахстана", простые акции АО "НАК "Казатомпром" и Индекс KASE.

По фьючерсам на Индекс KASE обязанности маркет-мейкера на KASE исполняет АО "NGDEM Finance", по фьючерсам на простые акции АО "Народный сберегательный банк Казахстана" – АО "Halyk Finance".

В 2023 году было заключено 15 сделок с фьючерсами на курс российского рубля к тенге на сумму 29,4 млрд тенге. Объем торгов деривативами за 2023 год превысил аналогичный показатель за 2022 год в 3,7 раза. Количество сделок за 2023 год увеличилось в три раза в сравнении с показателем прошлого года. На другие базовые активы (доллар США, Индекс KASE, простые акции АО "Народный сберегательный банк Казахстана" и АО "НАК "Казатомпром") сделок не заключалось.

Для справки

АО "Казахстанская фондовая биржа" (KASE) является ведущей фондовой биржей в Центрально-Азиатском регионе. KASE занимает второе место среди бирж СНГ по объему торгов ценными бумагами, и пятое место по объему капитализации рынка акций бирж FEAS.

Это универсальная торговая площадка для корпоративных и государственных ценных бумаг, облигаций международных финансовых институтов, иностранных валют, операций рынка денег – репо

и своп, а также производных инструментов. KASE является членом Международной федерации бирж (WFE), Федерации Евро-Азиатских фондовых бирж (FEAS) и других международных и отечественных профессиональных объединений, а также участником инициативы ООН "Фондовые биржи за устойчивое развитие".

Дополнительная информация: +7 (727) 237 53 42, pr@kase.kz.