



Қазақстан қор биржасы
Казахстанская фондовая биржа
Kazakhstan Stock Exchange

Типовая презентация

на 01 октября 2022 года

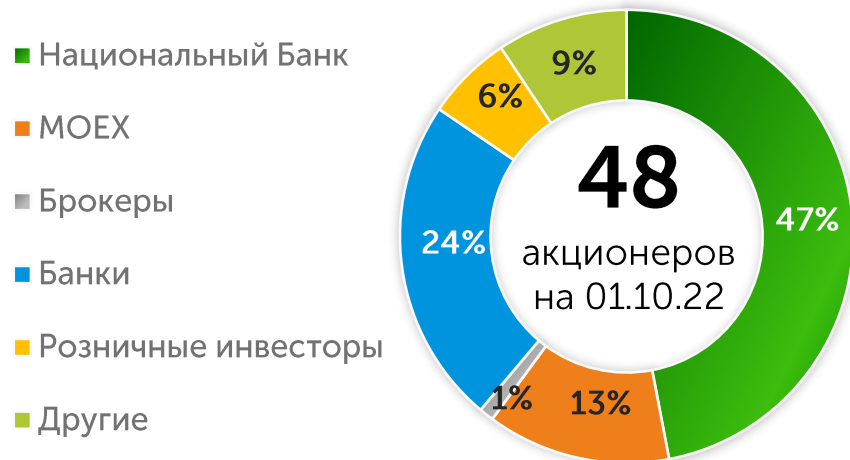


АО "Казахстанская фондовая биржа"

47,0% - НБРК

13,1% – МОЕХ

38,8% - финансовые организации



KASE была основана 17 ноября 1993 года под наименованием "Казахская межбанковская валютная биржа" два дня спустя после введения национальной валюты Казахстана – тенге

KASE – коммерческая организация, функционирующая в организационно-правовой форме акционерного общества

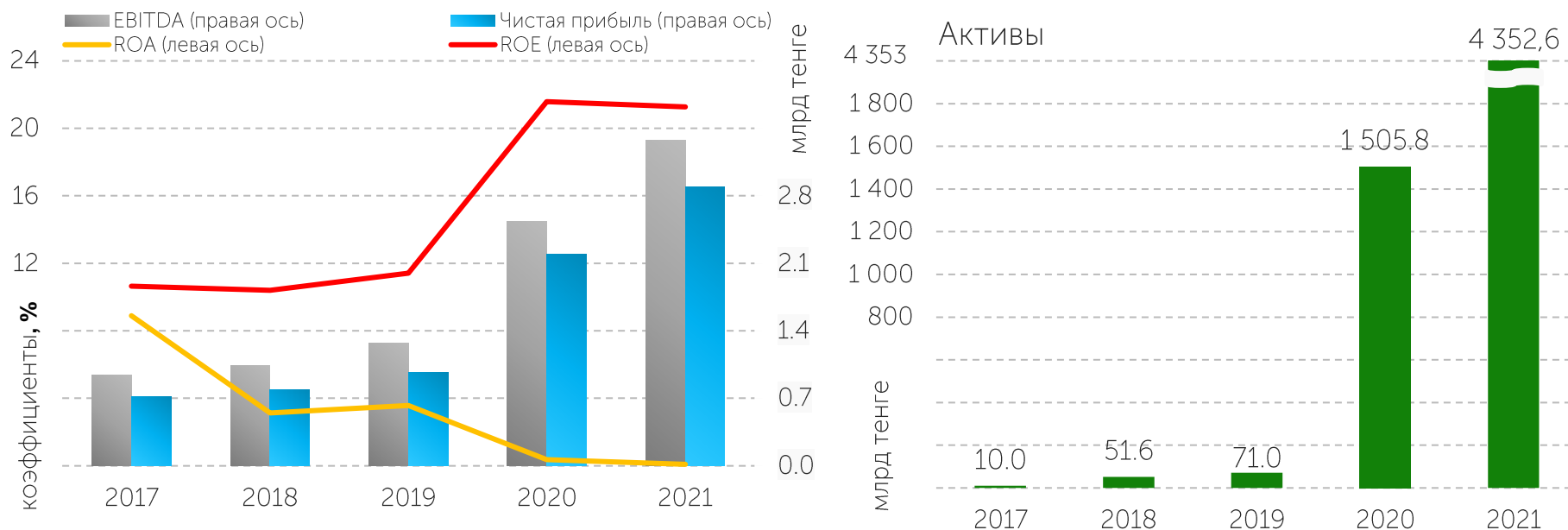
Акции и капитал KASE

На 01 июля 2022 года:

| | |
|------------------------------|------------------|
| собственный капитал | 23 246,7 млн KZT |
| оплаченный уставный капитал | 4 065,6 млн KZT |
| количество объявленных акций | 5 000 000 |
| количество размещенных акций | 1 075 231 |
| балансовая стоимость акции | 21 620,2 KZT |

Показатели доходности KASE

| | Активы, млн KZT | Чистая прибыль, млн KZT | Доходность активов, % | Доходность капитала, % |
|------|--------------------|----------------------------|--------------------------|---------------------------|
| 2021 | 4 352 567,9 | 3 905,1 | 0,1 | 22,0 |
| 2020 | 1 505 801,9 | 2 893,5 | 0,4 | 21,3 |
| 2019 | 71 041,1 | 2 192,7 | 3,6 | 21,6 |
| 2018 | 51 583,8 | 965,3 | 3,1 | 11,4 |
| 2017 | 10 009,5 | 792,8 | 8,9 | 10,4 |



Примечание: ROA, ROE рассчитаны на основании среднегодовых показателей активов и капитала

42

Фондовая

32

Валютная

27

Деривативы

51

всего участников рынка

21

банков второго уровня (из 22)
резиденты РК

22

брокерских компаний (из 22)
резиденты РК

46

локальных участников

3

иностранного участника
(ООО "ИВА Партнерс", ООО ИК "Фридом Финанс",
АО "Райффайзенбанк",)

2

МФО (Межгосударственный банк,
Евразийский банк развития)

12

участников, предоставляющих
услуги прямого доступа (DMA)

Новые члены KASE:

2022

- АО "Инвестиционная компания Standard" / фондовая
- АО "Дочерняя организация Народного Банка Казахстана "Halyk Finance" / валютная
- АО "ЕвроЦентрАстана" / фондовая и деривативы
- АО "UD Capital" / фондовая и деривативы
- АО "NGDEM Finance" / деривативы

2021

- АО "Tengri Partners Investment Banking" / валютная
- АО "Райффайзенбанк" / валютная
- АО "First Heartland Securities" / деривативы
- АО "АЛЬФА-БАНК" / валютная

2020

- АО "ForteFinace" / фондовая и деривативы
- АО "Исламский банк "Заман-Банк" / валютная

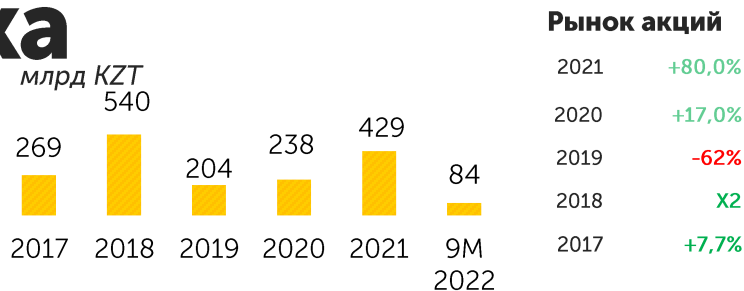
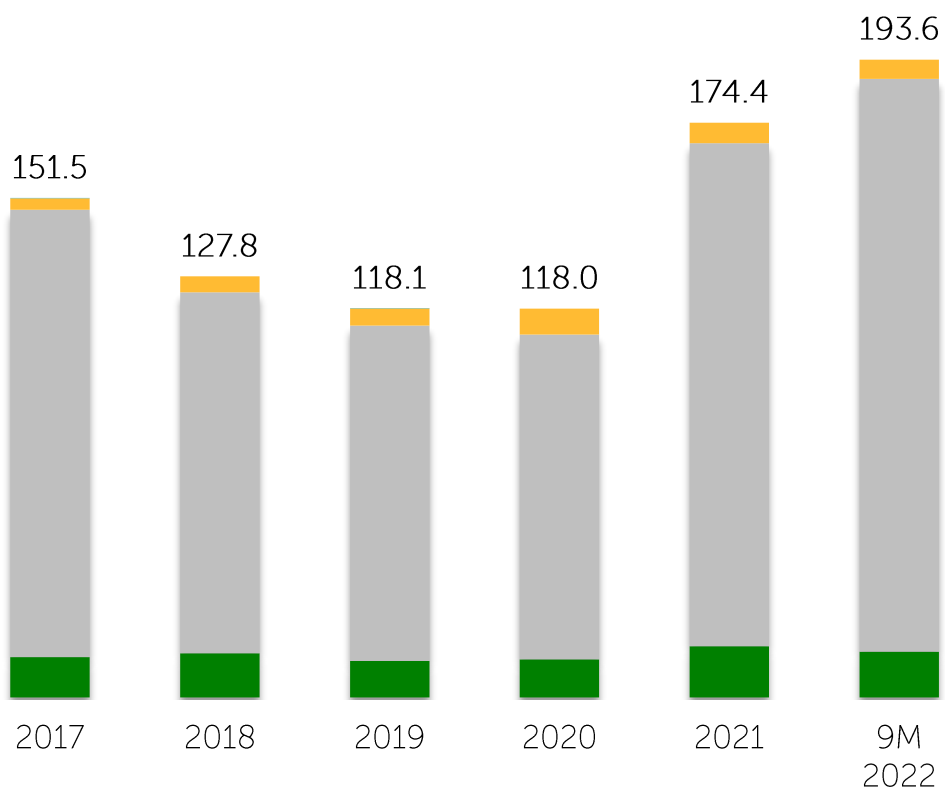
Показатели биржевого рынка за девять месяцев 2022 года

| Сектор биржевого рынка | Объем, млрд KZT | Объем млн USD | Среднедневное количество сделок | Среднедневной объем сделок, млн KZT | Средний объем одной сделки, млн KZT |
|---------------------------|--------------------|------------------|---------------------------------------|-------------------------------------------|-------------------------------------------|
| Рынок ценных бумаг | 5 899,3 | 12 852,7 | 1 612 | 32 413,8 | 20,1 |
| Акции | 83,9 | 182,4 | 1 362 | 461,0 | 0,3 |
| KASE Global | 20,4 | 45,8 | 107 | 112,1 | 1,1 |
| Корпоративные долговые ЦБ | 1 176,0 | 2 573,3 | 69 | 6 461,5 | 94,2 |
| ГЦБ | 4 523,1 | 9 840,0 | 14 | 24 852,2 | 1 824,6 |
| Облигации МФО | 73,2 | 161,4 | 2 | 402,2 | 266,2 |
| ЦБ инвестиционных фондов | 6,6 | 14,6 | 56 | 36,4 | 0,6 |
| Производные ценные бумаги | 16,1 | 35,2 | 3 | 88,5 | 31,3 |
| Рынок иностранных валют | 13 937,3 | 30 208,7 | 333 | 76 578,5 | 229,8 |
| Рынок денег | 173 742,6 | 382 105,0 | 919 | 954 629,4 | 1 039,2 |
| Операций репо | 152 920,7 | 336 435,6 | 898 | 840 223,8 | 936,1 |
| Операций валютного свопа | 20 821,8 | 45 669,4 | 21 | 114 405,6 | 5 440,8 |
| Деривативы | – | – | – | – | – |
| Итого | 193 579,2 | 425 166,4 | 2 863 | 1 063 621,7 | 371,4 |

Объем и структура рынка



Динамика объема торгов по секторам, трлн KZT



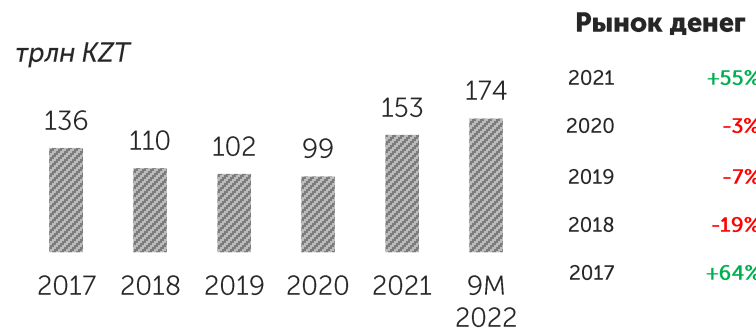
| | |
|------|--------|
| 2021 | +80,0% |
| 2020 | +17,0% |
| 2019 | -62% |
| 2018 | x2 |
| 2017 | +7,7% |



| | |
|------|-------|
| 2021 | -26% |
| 2020 | -1% |
| 2019 | +18% |
| 2018 | x2 |
| 2017 | +127% |



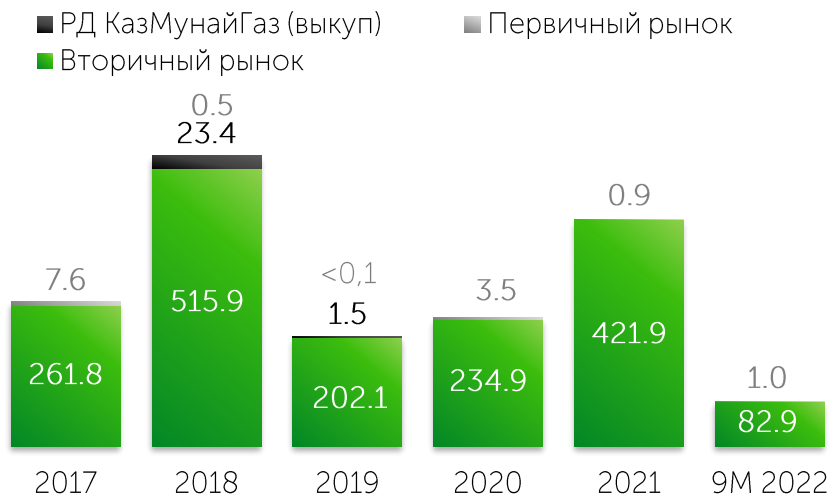
| | |
|------|------|
| 2021 | +34% |
| 2020 | +4% |
| 2019 | -17% |
| 2018 | +9% |
| 2017 | +18% |



| | |
|------|------|
| 2021 | +55% |
| 2020 | -3% |
| 2019 | -7% |
| 2018 | -19% |
| 2017 | +64% |

Рынок акций

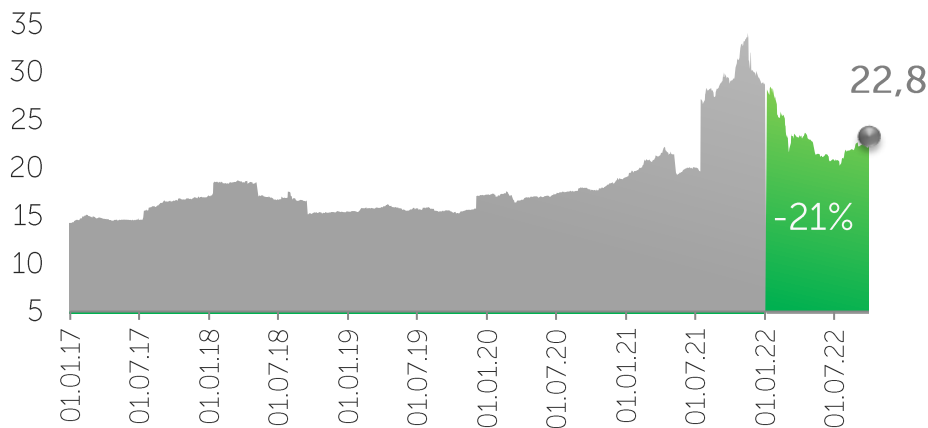
Объем сделок, млрд KZT



Новые листинги



Капитализация рынка акций, трлн KZT



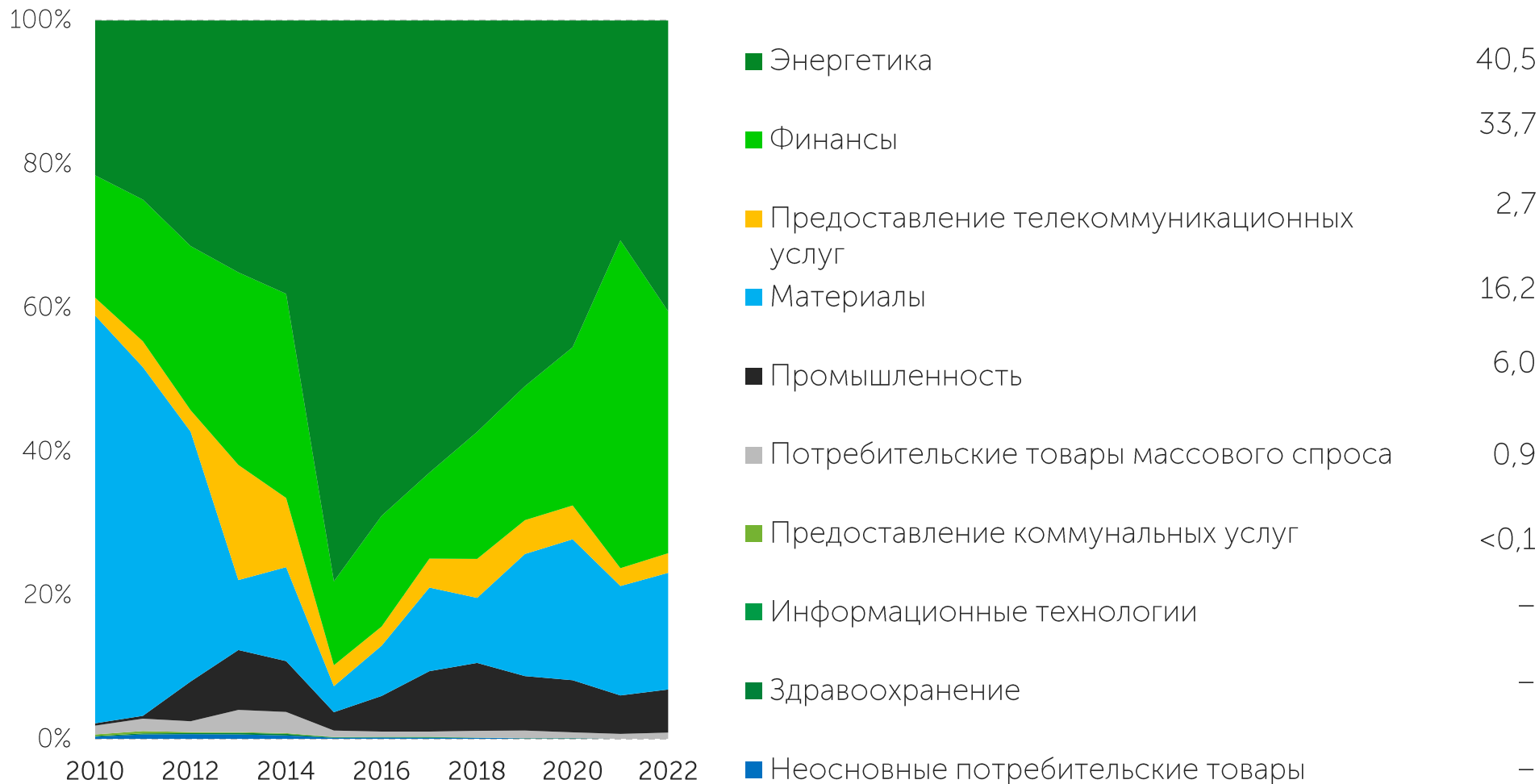
Основные показатели за 9М 2022 года



* с учетом индивидуальных счетов и уникальных кодов по омнибус счетам

Отраслевая структура списков акций

Доля от капитализации, %

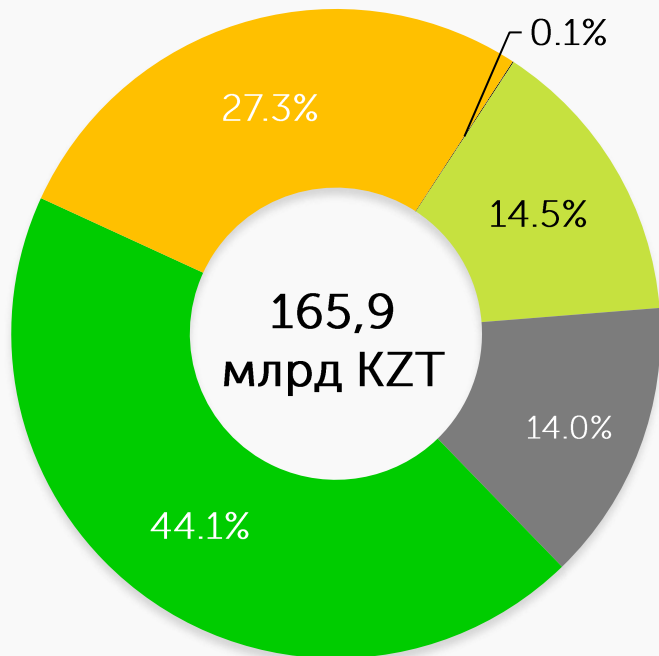


Примечание: в качестве классификатора используется "Global Industry Classification Standard (GICS)®"

Источник: KASE

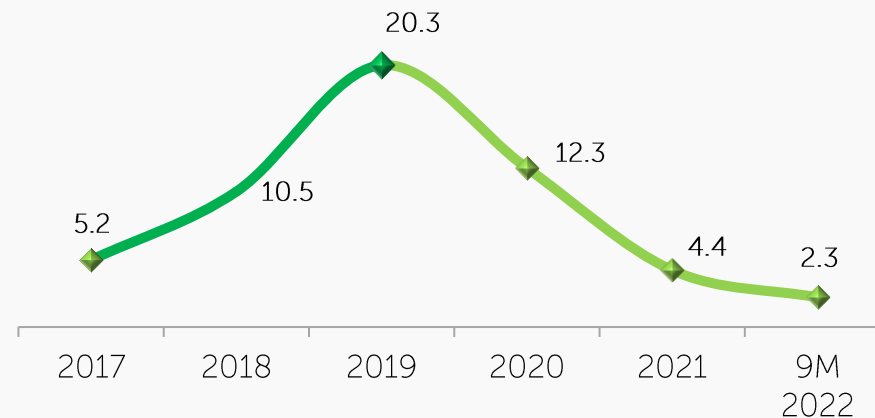
Рынок акций: инвесторская база

Доли основных категорий инвесторов на вторичном рынке за 9М 2022 года*

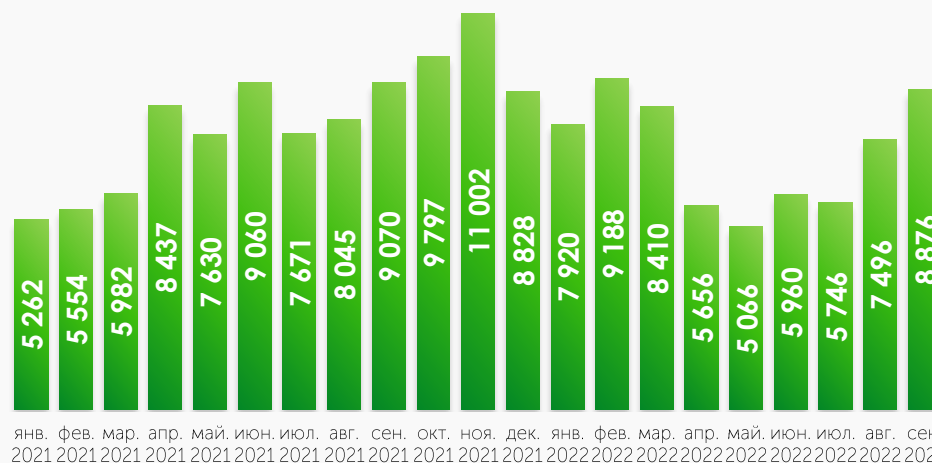


- Банки
- Брокеры-дилеры
- Др. институциональные инвесторы
- Физические лица
- Прочие юридические лица

Доля нерезидентов в брутто-обороте*, %



Динамика активных розничных инвесторов на рынке акций**



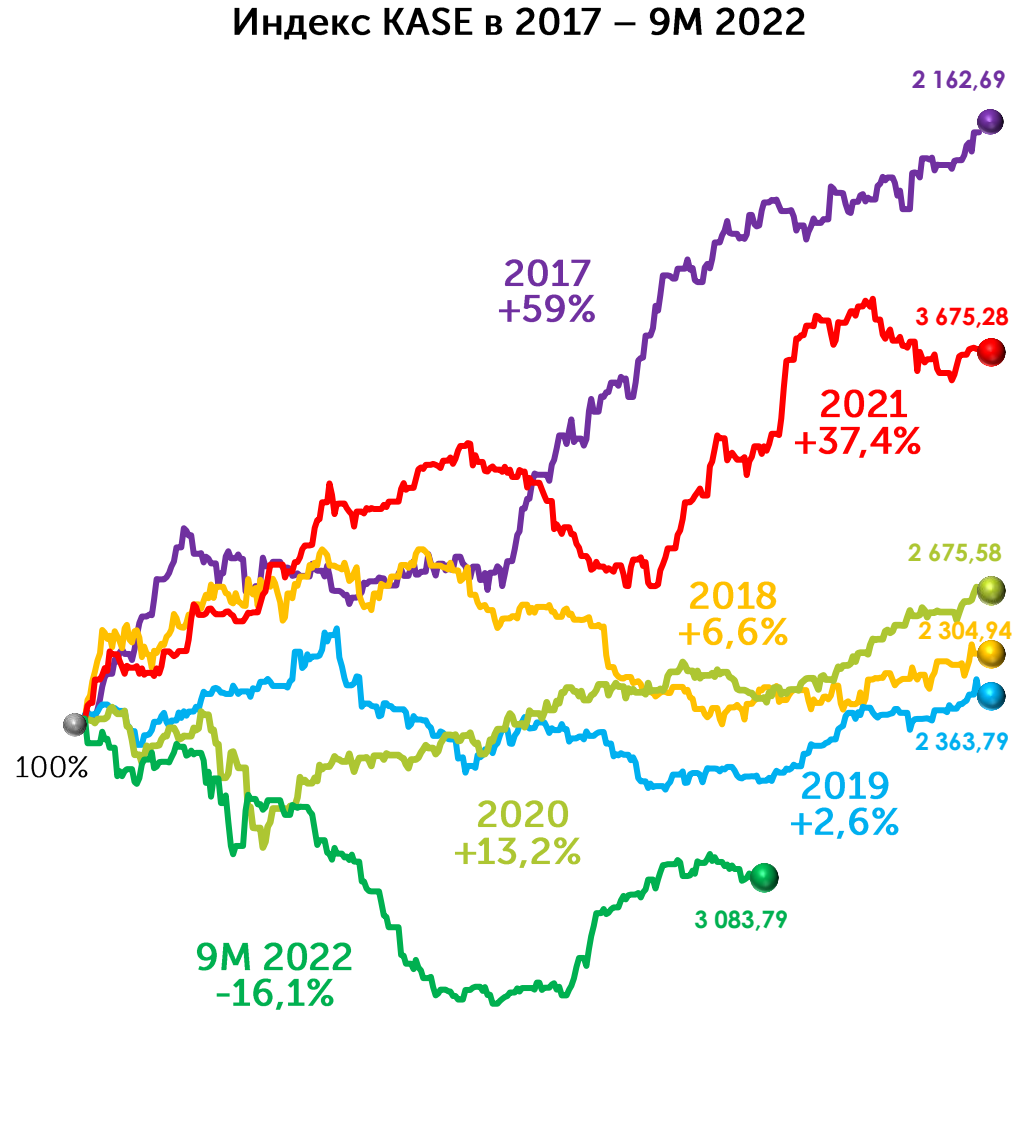
* от общего брутто-оборота торгов акциями без учета крупных сделок

Источник: KASE

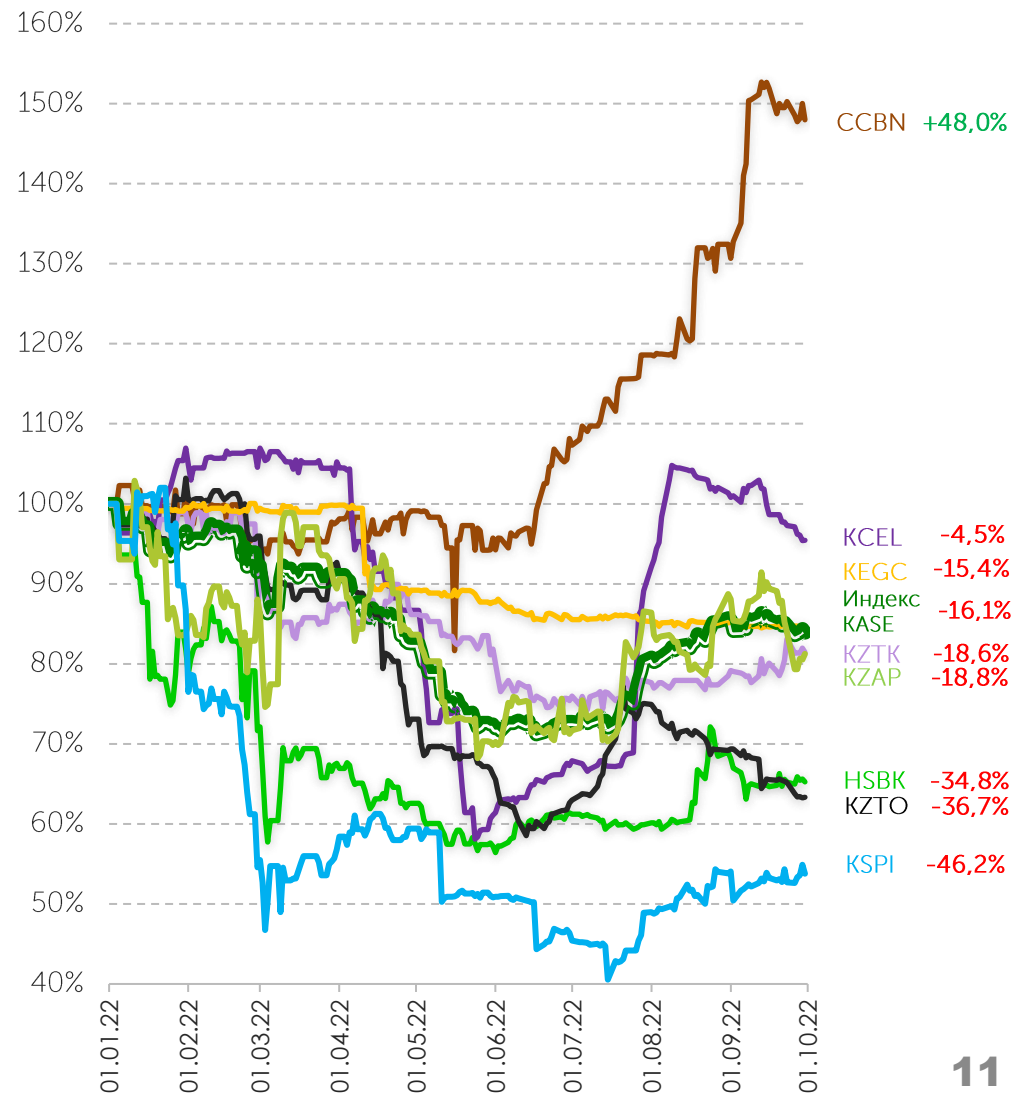
** с учетом индивидуальных счетов и уникальных кодов по омнибус счетам

Динамика Индекса KASE

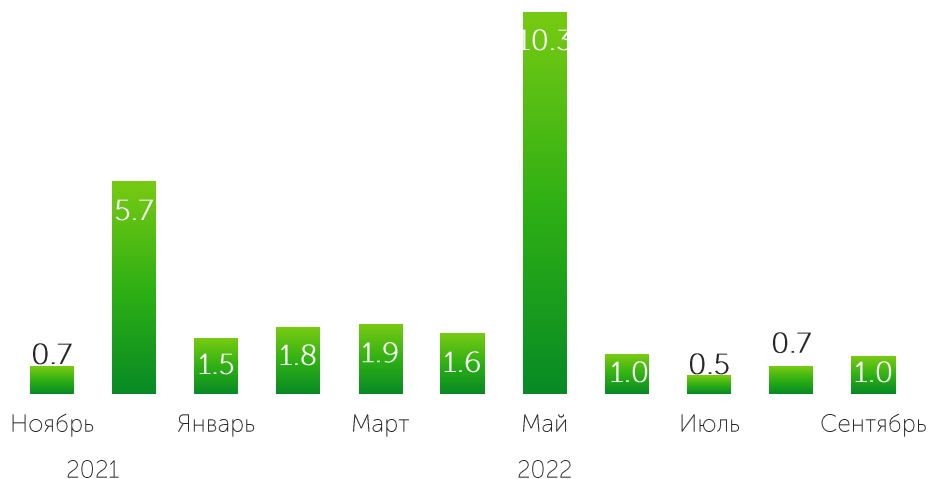
Индекс KASE в 2017 – 9М 2022



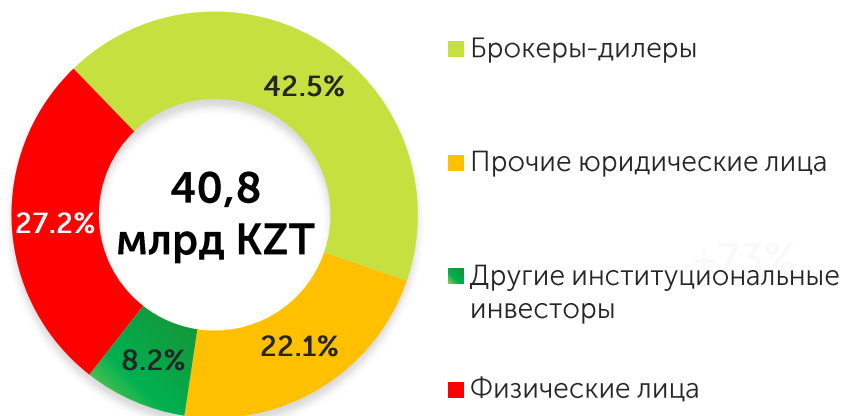
Динамика составляющих Индекса KASE



Объем сделок, млрд KZT



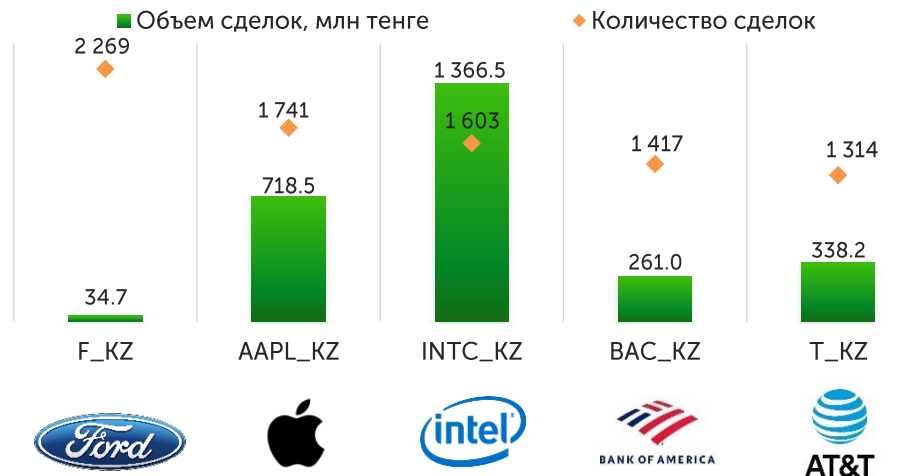
Доли основных категорий инвесторов за 9М 2022 года*



* от общего брутто-оборота торгов в секторе KASE Global без учета крупных сделок

Источник: KASE

Топ-5 наиболее популярных акций сектора KASE Global по итогам 9М 2022 года



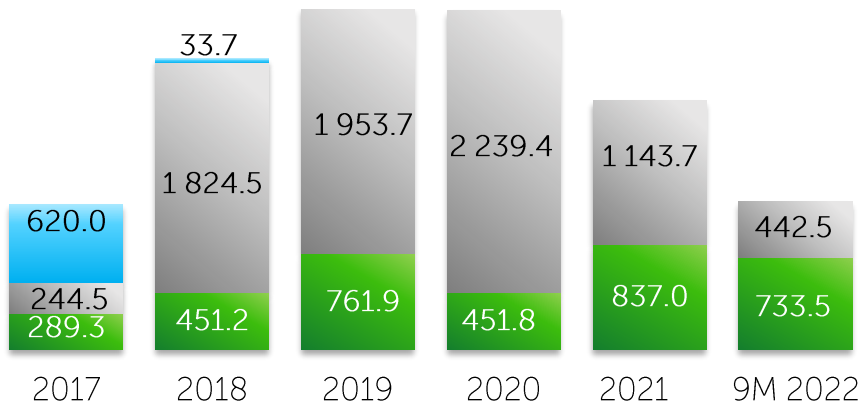
Основные показатели за 9М 2022 года



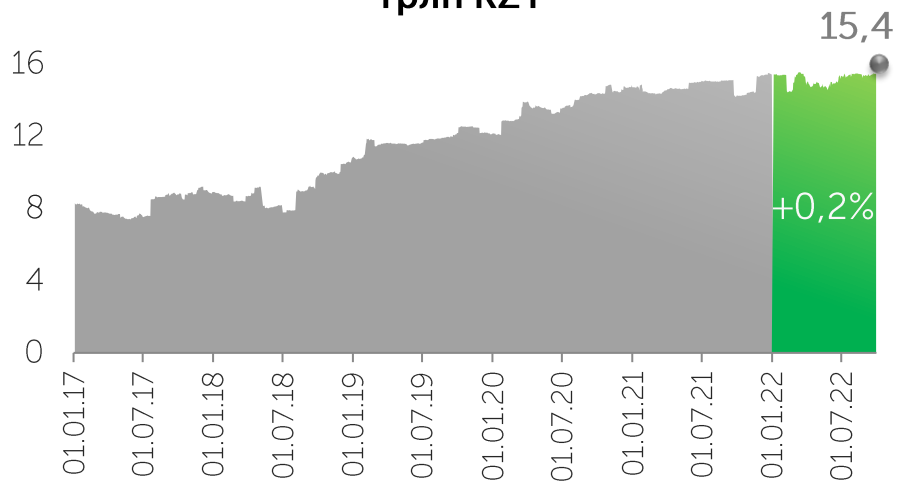
Рынок корпоративных облигаций

Объем сделок, млрд KZT

- Программа финансовой поддержки банковского сектора
- Первичный рынок
- Вторичный рынок

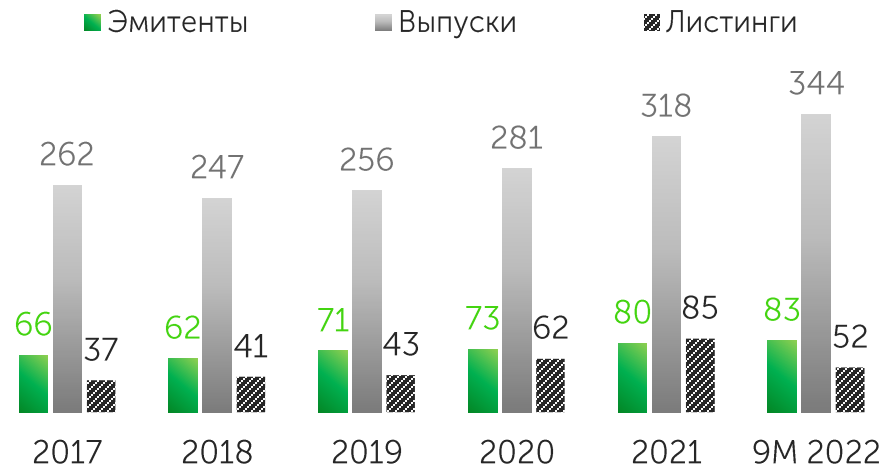


Объем корпоративного долга в обращении, трлн KZT

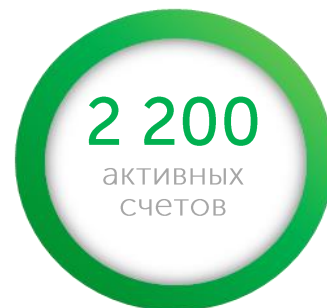


Источник: KASE

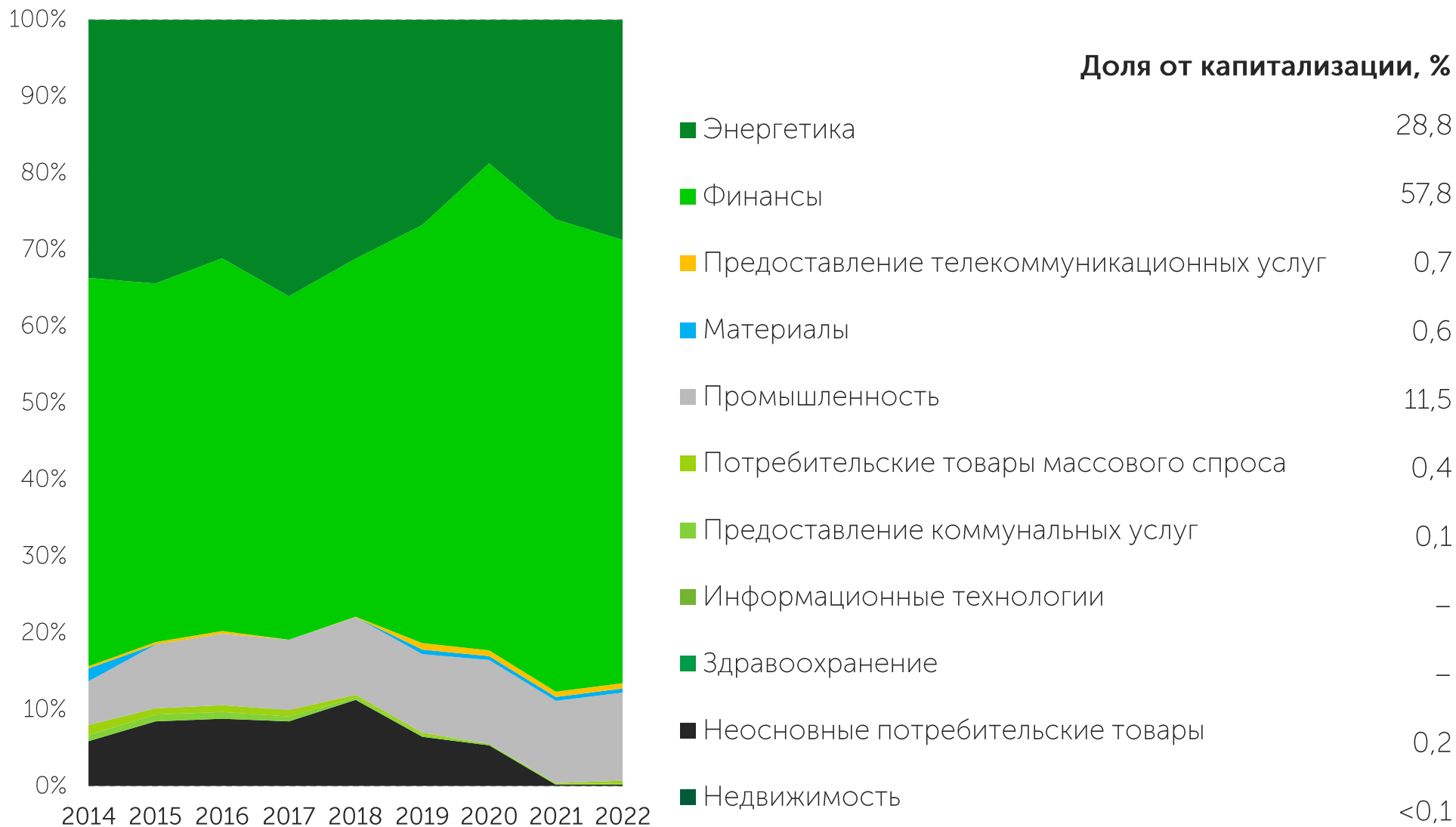
Новые листинги



Основные показатели за 9М 2022 года



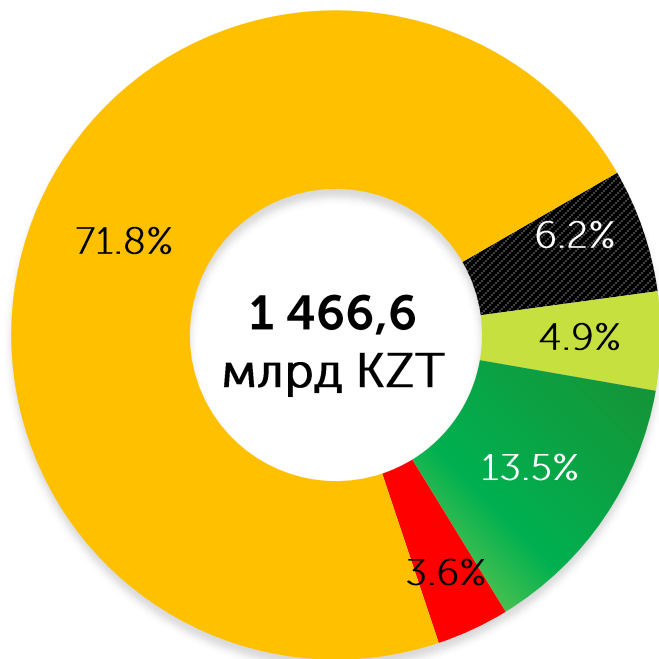
Отраслевая структура списков облигаций KASE



В качестве классификатора используется "Global Industry Classification Standard (GICS)®"

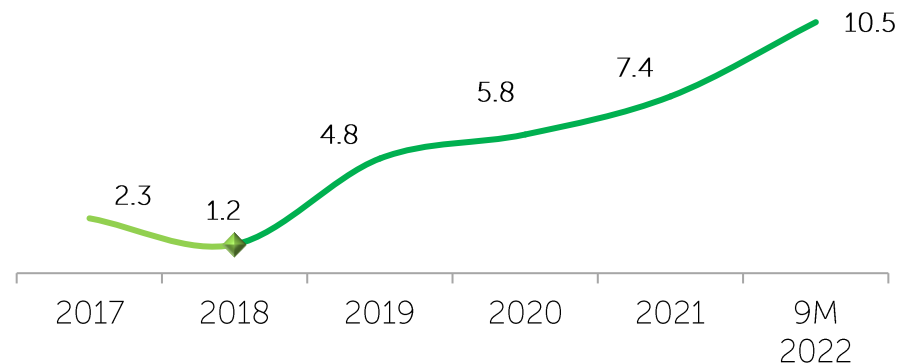
Инвесторская база рынка корпоративных облигаций KASE

Доли основных категорий инвесторов на вторичном рынке за 9М 2022 года*

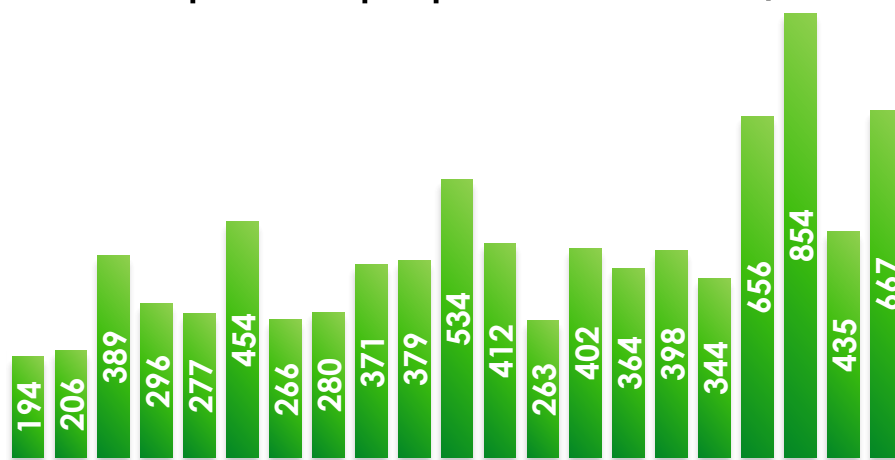


- Банки
- Брокеры-дилеры
- Др. институциональные инвесторы
- Физические лица
- Прочие юридические лица

Доля нерезидентов в брутто-обороте, %



Динамика активных счетов на рынке корпоративных облигаций

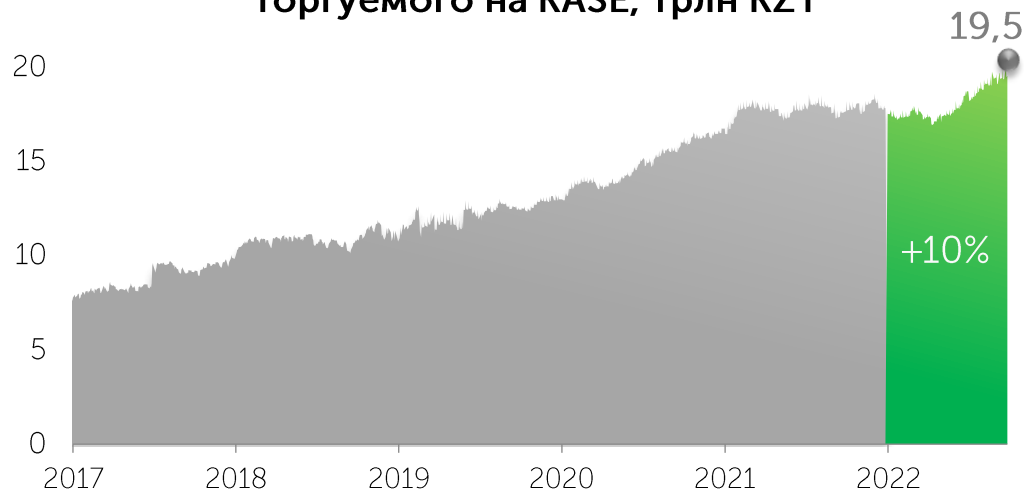


* от общего брутто-оборота торгов корпоративными облигациями на вторичном рынке

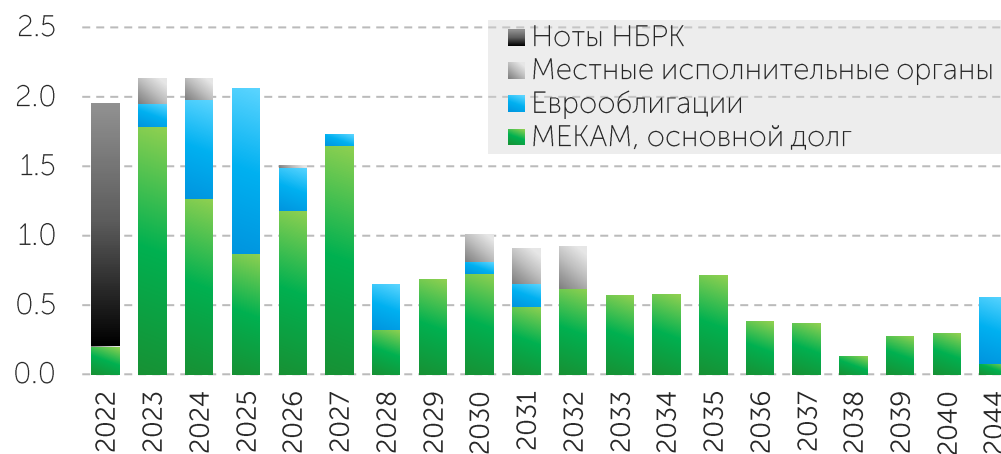
Динамика объема торгов, млрд KZT



Сумма государственного долга (по номиналу), торгуемого на KASE, трлн KZT

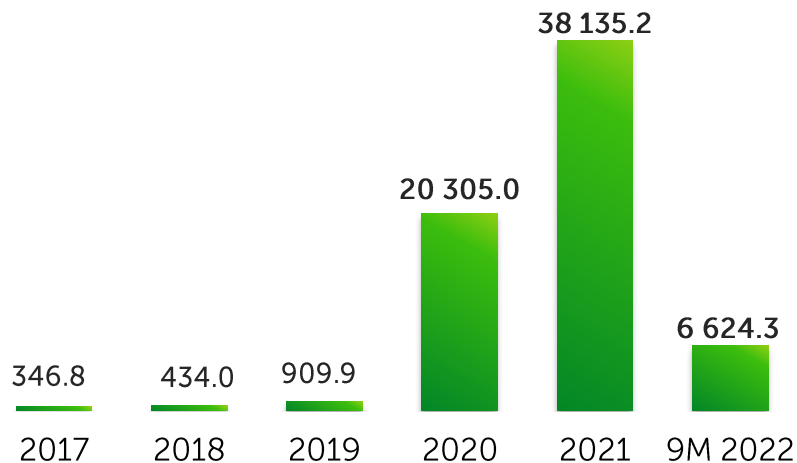


Динамика выплат по госдолгу, трлн KZT

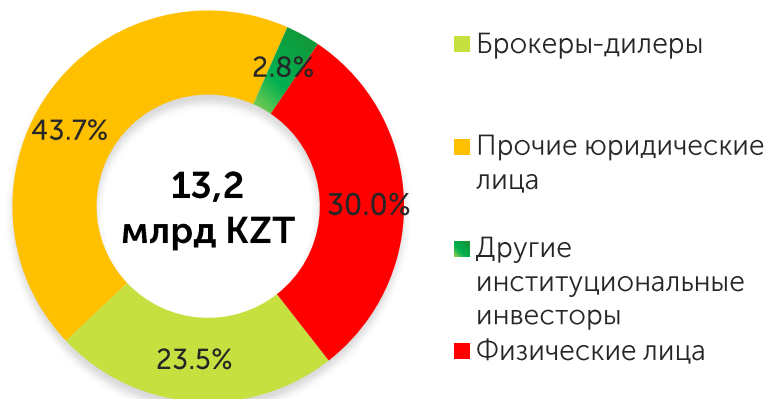


Источник: KASE

Объем сделок, млн KZT



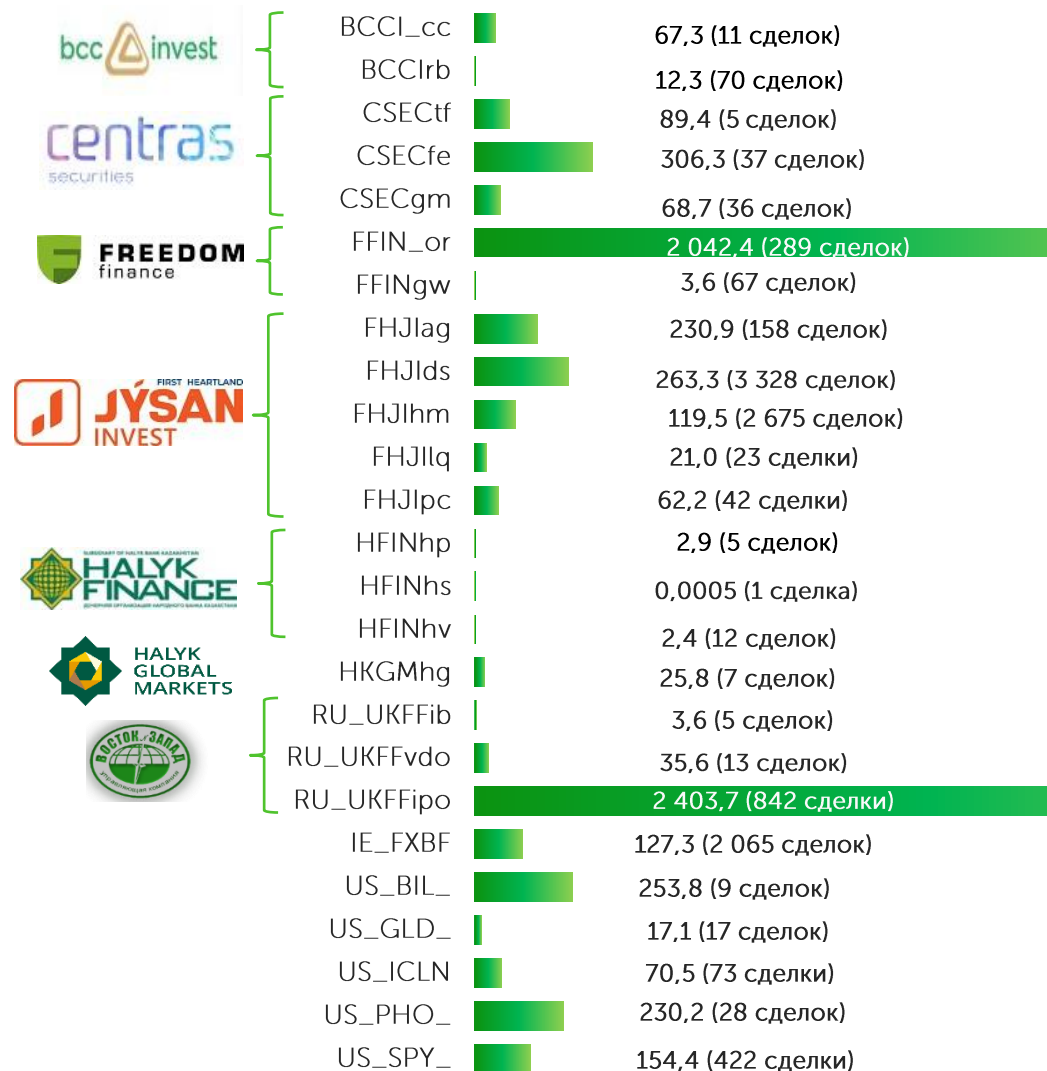
Доли основных категорий инвесторов за 9M 2022 года*



* от общего брутто-оборота торгов ценными бумагами инвестиционных фондов

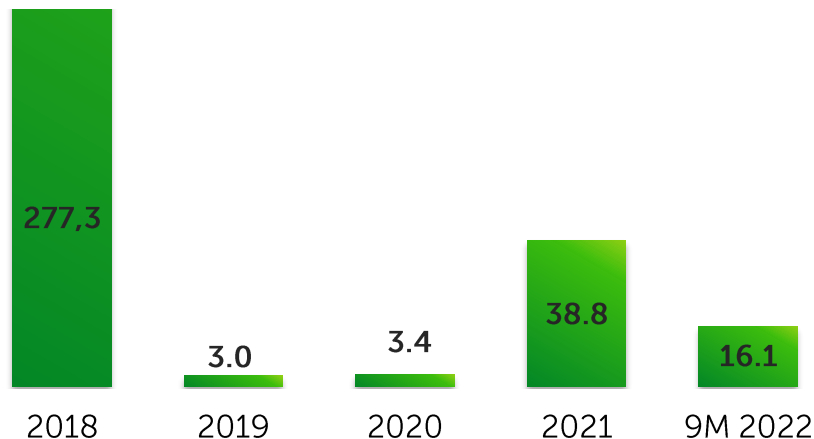
Источник: KASE

Объем торгов в разбивке по инструментам за 9M 2022 года, млн KZT

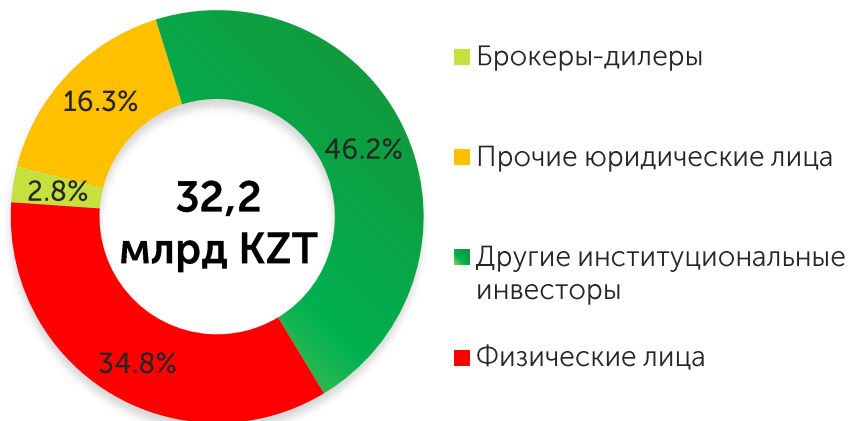


Производные ценные бумаги

Объем сделок, млрд KZT



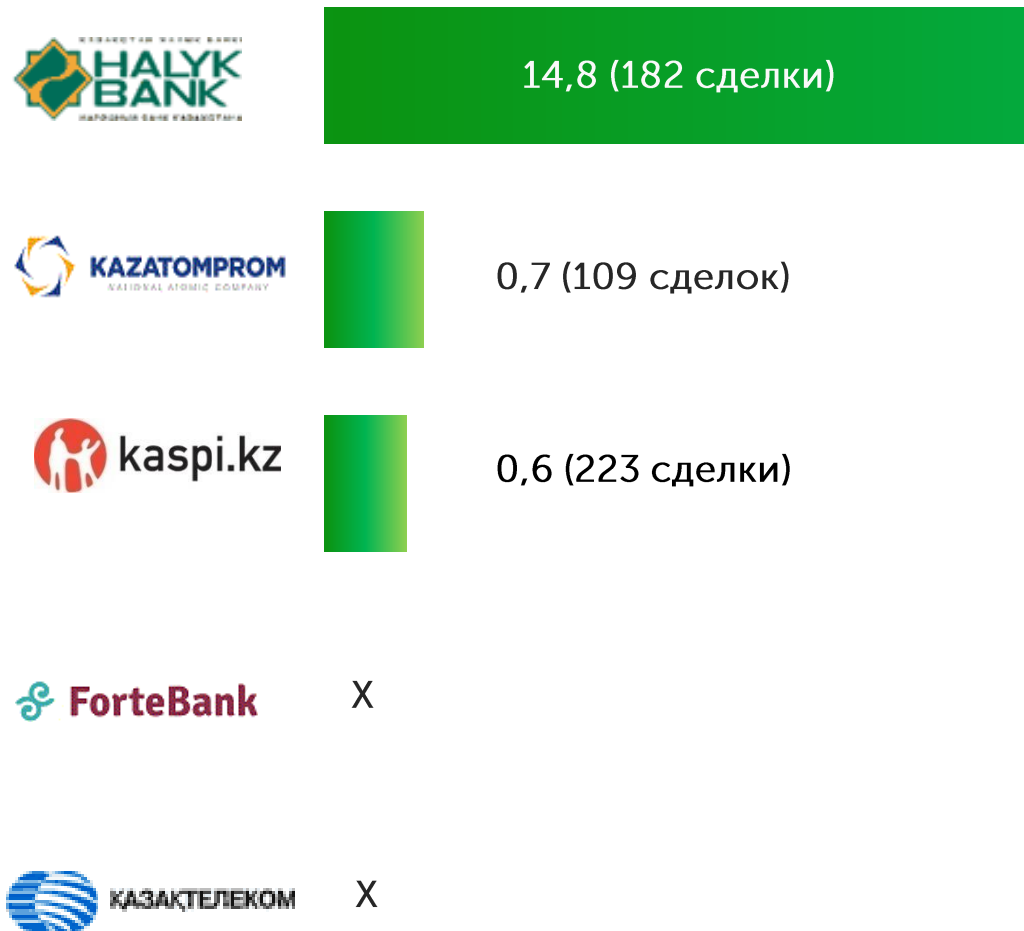
Доли основных категорий инвесторов за 9M 2022 года*



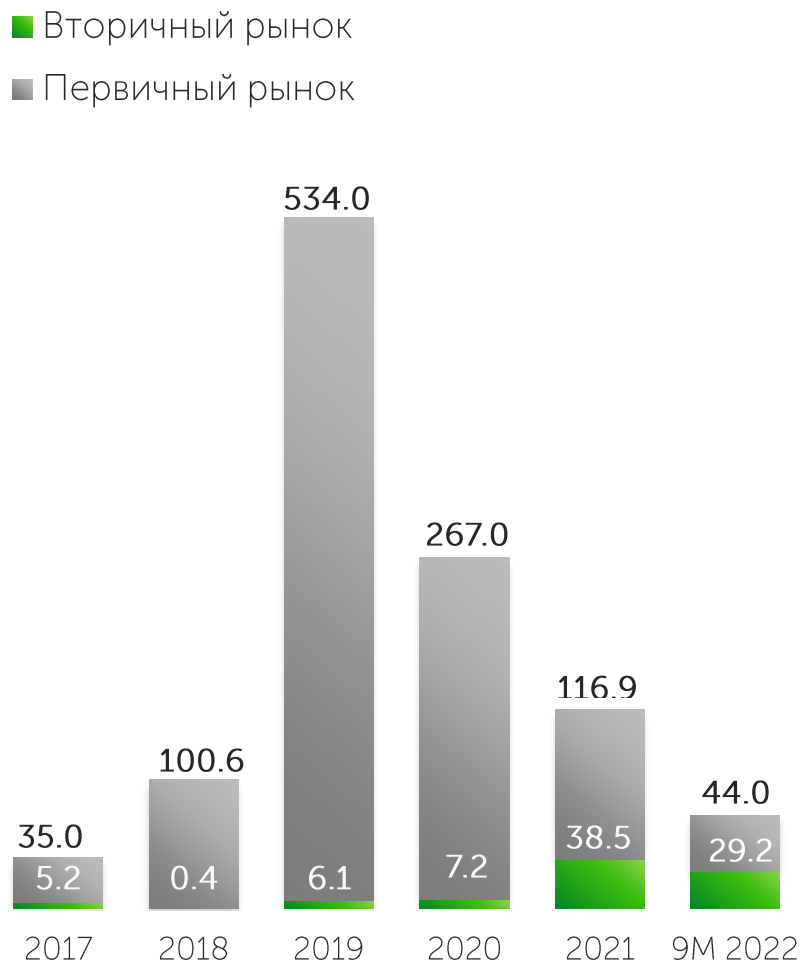
* от общего брутто-оборота торгов производными ценными бумагами

Источник: KASE

Объем торгов в разбивке по инструментам за 9M 2022 года, млрд KZT



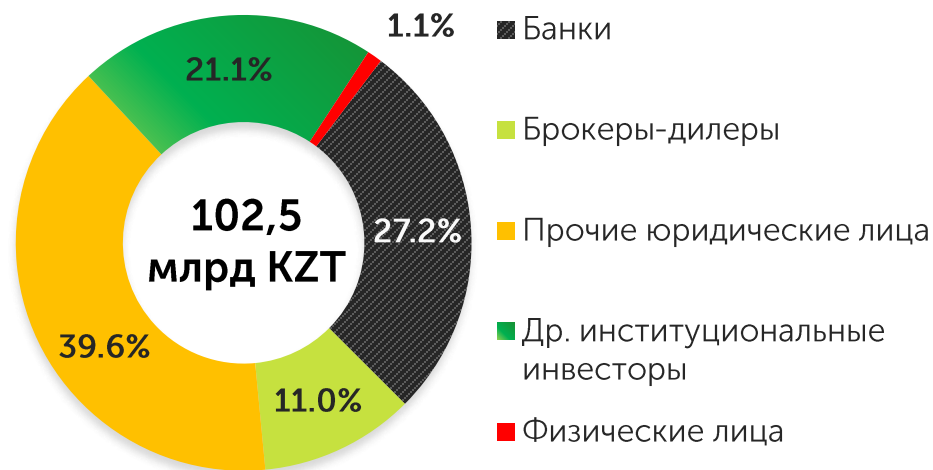
Объемы торгов, млрд KZT



На 01 октября 2022 года в официальном списке KASE находятся **39 выпуск облигаций 4 организаций:**

- 17 выпусков Евразийского банка развития
- 11 выпусков Европейского банка реконструкции и развития
- 2 выпуска Международной финансовой корпорации
- 9 выпусков Азиатского банка развития

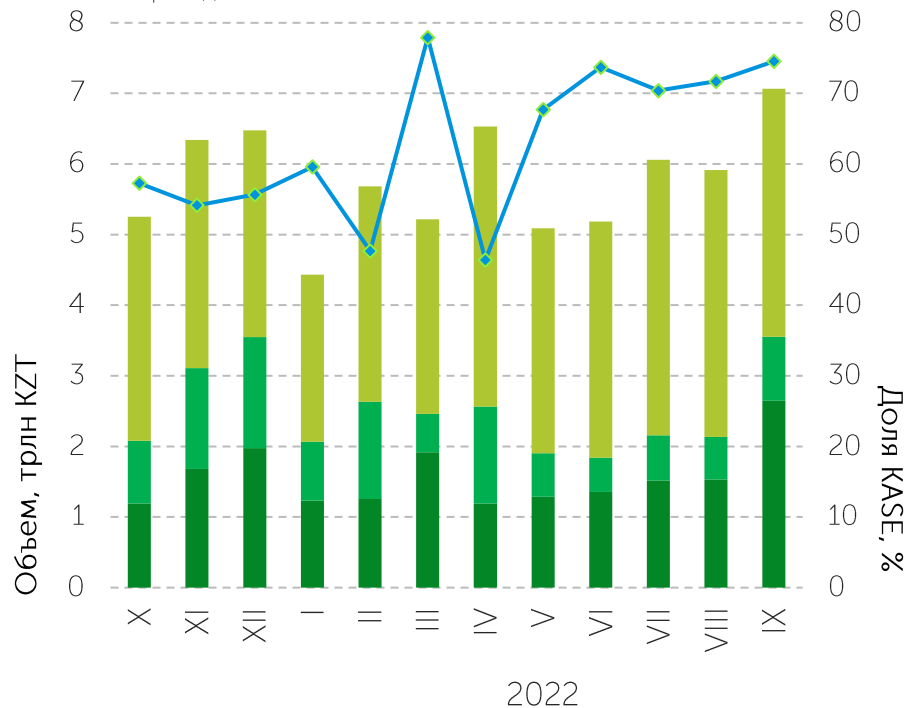
Доли основных категорий инвесторов за 9М 2022 года*



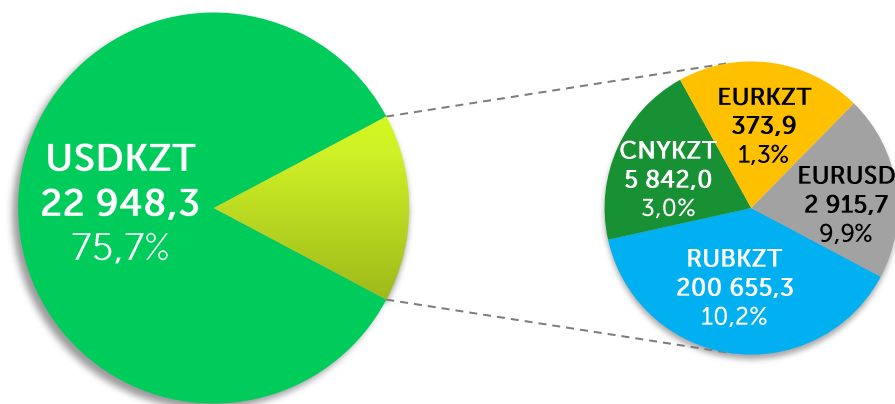
* от общего брутто-оборота торгов облигациями МФО, из расчета исключена позиция инициатора специализированных торгов

Соотношение биржевых и внебиржевых валютных операций

- Внебиржевые операции между банками-резидентами РК и банками-нерезидентами РК
- Внебиржевые операции между банками-резидентами РК
- Операции на спот-рынке KASE
- ◆ Доля операций на спот-рынке KASE в общем объеме валютных операций по покупке между банками-резидентами РК

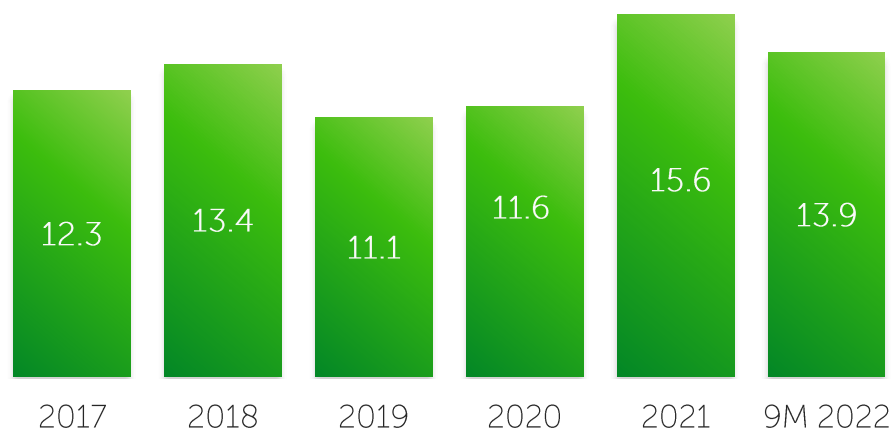


Структура биржевого рынка за 9М 2022 года в объеме торгов. Объем в млн единиц валюты



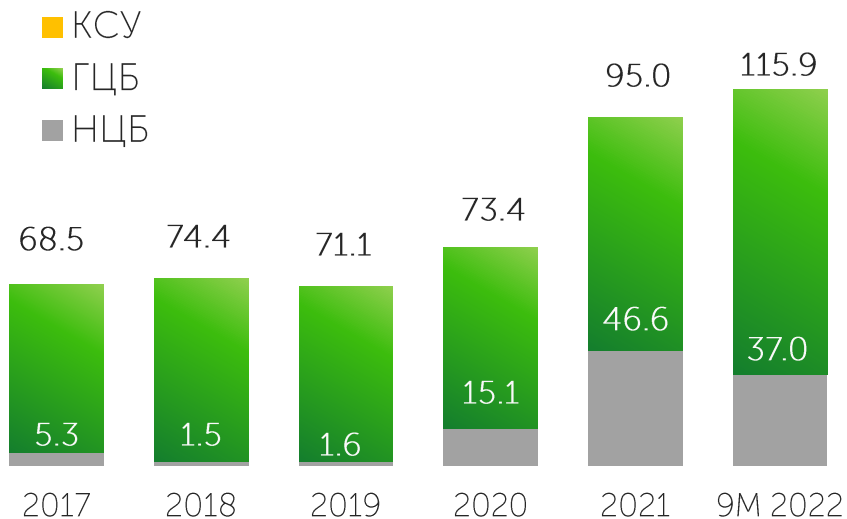
Примечание: доли рассчитаны от объема торгов в KZT

Объем торгов на спот-рынке, трлн KZT

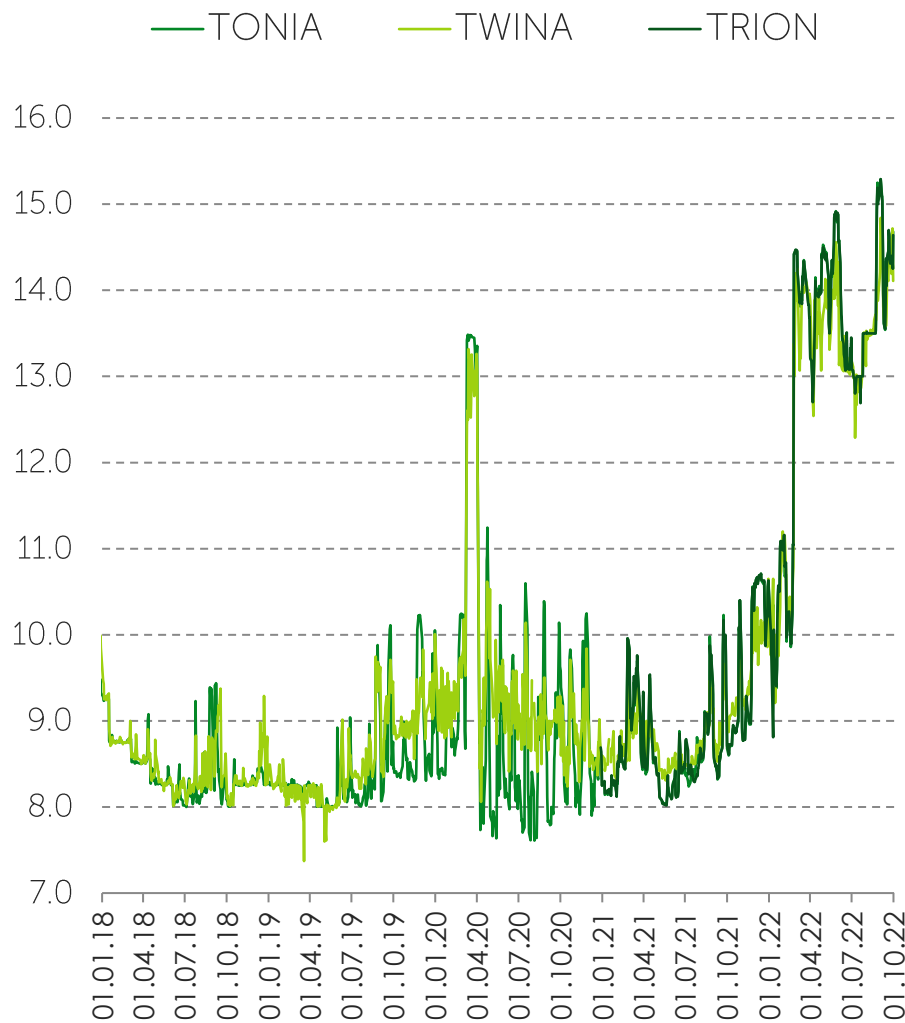


Рынок операций репо

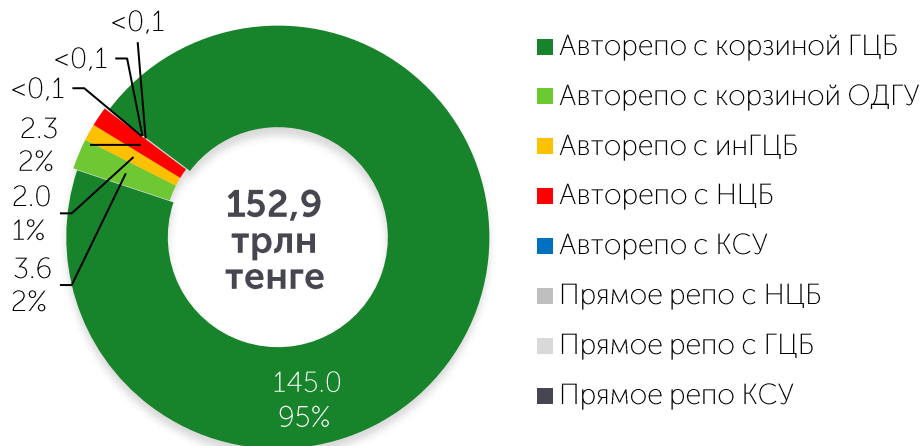
Объем торгов, трлн KZT



Индикаторы репо, % годовых

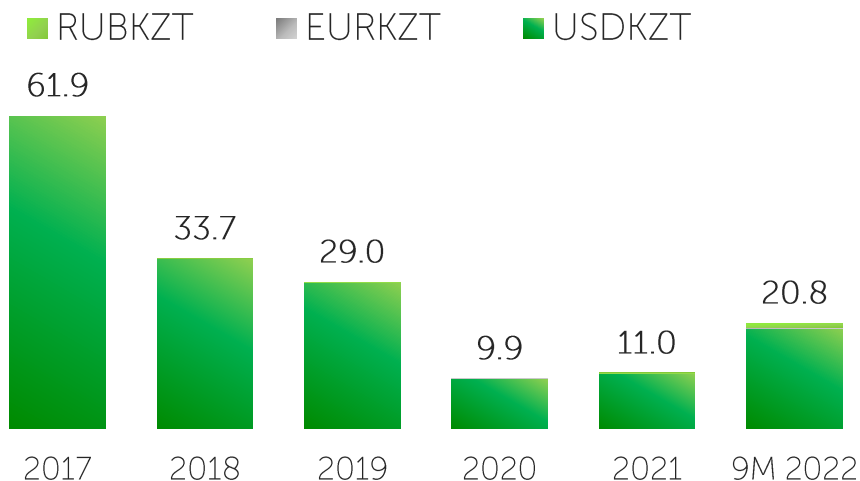


Инструменты рынка репо, трлн KZT

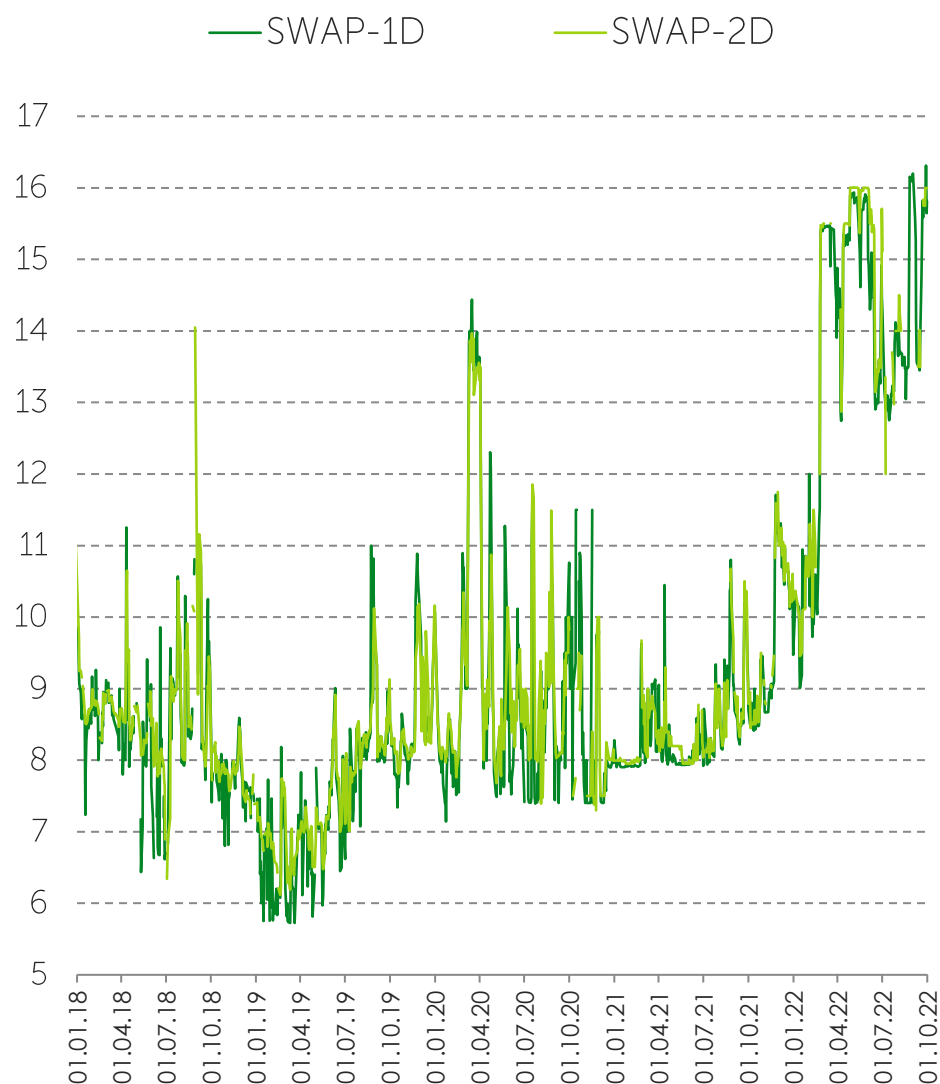


Рынок операций валютного свопа

Объем торгов, трлн KZT








Индикаторы своп-рынка, % годовых



Инструменты рынка операций валютного свопа (объем за 9М 2022/ доля):

- **USDKZT_0_001** (16 002,7 млрд KZT / 76,9 %)
- USDKZT_0_002 (3 758,1 млрд KZT / 18,0 %)
- USDKZT_0_01W (32,0 млрд KZT / 0,2 %)
- USDKZT_0_01M (194,2 млрд KZT / 0,9 %)
- RUBKZT_0_001 (147,2 млрд KZT / 0,7 %)
- RUBKZT_0_002 (517,9 млрд KZT / 2,5 %)
- RUBKZT_1_001 (11,2 млрд KZT / 0,1 %)
- EURKZT_0_001 (127,8 млрд KZT / 0,6 %)
- EURKZT_1_001 (30,8 млрд KZT / 0,1 %)

Спасибо за внимание!

-  Kazakhstan Stock Exchange
-  Kazakhstan.stock.exchange
-  Казахстанская фондовая биржа KASE
-  kase.kz
-  KASEInfobot

Республика Казахстан, 050040
г, Алматы, ул, Байзакова, 280
Северная башня
Многофункционального комплекса
"Almaty Towers", 8-й этаж
Тел.: +7 (727) 237 5300
www.kase.kz