

ОБЗОР РЕЗУЛЬТАТОВ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ ЗА I КВАРТАЛ 2021 ГОДА

14 апреля 2021 г., г. Алматы



Қазақстан қор биржасы
Казахстанская фондовая биржа
Kazakhstan Stock Exchange

Содержание

- ▶ **01** | Краткий обзор результатов
- 02** | Ключевые проекты KASE
и мероприятия

Ключевые тренды

IQ'2021 к IQ'2020

+42% **+83%** **+11%** **>17 тыс.**

объем торгов
на РЦБ

объем торгов
на рынке акций

объем торгов
на рынке ГЦБ

новых счетов,
открытых
физическими лицами

x28

объем торгов
на рынке ПИФ

+38% **+16%** **+12%**

объем рынка
привлечений

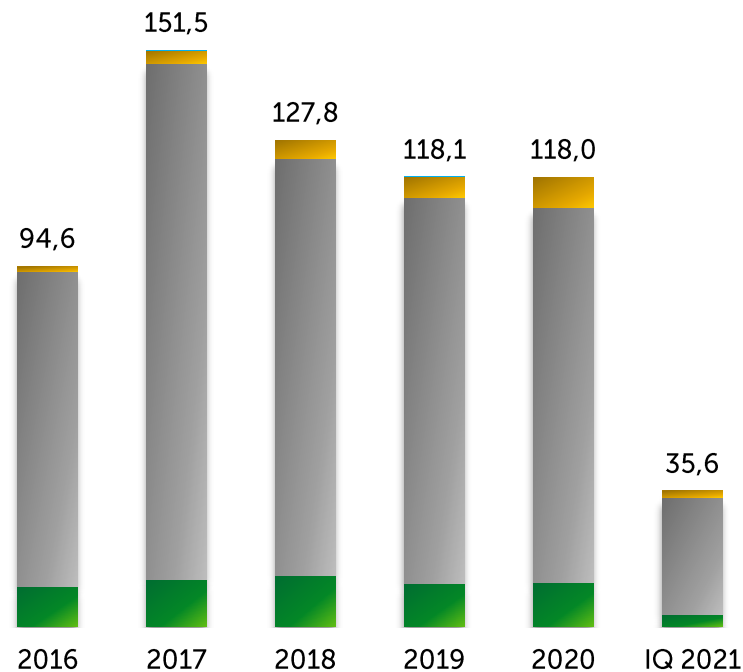
прирост
Индекса KASE

капитализация
рынка акций

+11 % объем торгов IQ'2021 к IQ'2020



Динамика объема торгов по секторам, трлн тенге



IQ'2021 к IQ'2020



Источник: KASE

Члены Биржи

Категория
"фондовая"



Категория
"деривативы"

Категория
"валютная"

- 51** Общее количество, в том числе:
- 25** банков второго уровня (из 25)
резиденты РК
- 21** брокерская компания (из 21)
резиденты РК
- 47** локальных участников
- 4** иностранных участников
- 13** участников, предоставляющих услуги прямого доступа (DMA)

Источник: АРРФР, ЕНПФ, KASE



принято в члены KASE
по категории "валютная"



компании, заключившие договора
о доверительном управлении

Структура торговых списков на 01 апреля 2021 года

1 114 инструментов, в том числе 777 выпусков ценных бумаг

Фондовый рынок			Рынок денег	Валютный рынок	Деривативы
Акции	Облигации	Иные ЦБ	Своп-операции	Спот	Фьючерсы
IPO / Аукционы	Аукционы	Вторичный рынок	RUBKZT	RUBKZT	KASE Index
Выкуп	Вторичный рынок	ЦБ инвестиционных фондов	USDKZT	USDKZT	USDKZT
Вторичный рынок	ГЦБ МФ РК	ETF	CNYKZT	CNYKZT	
Крупные компании	Муниципальные облигации		EURKZT	EURKZT	
МСБ	Ноты НБ РК		Авторепо	EURUSD	
Двойной листинг	ГЦБ иностр. гос-в		Акции		
GDR	Корпоративные облигации		Облигации		
	Облигации МФО*		Корзина ГЦБ		
143	617	17	315	16	6
Расчеты					
T+2	T+2	T+0	от T+1 до T+1Y	T+0	T+1W
T+0 - неликвидные ЦБ	T+0 – неликвидные ЦБ		от T+0 до T+90	T+1	T+1M
				T+2	T+3M
					T+6M

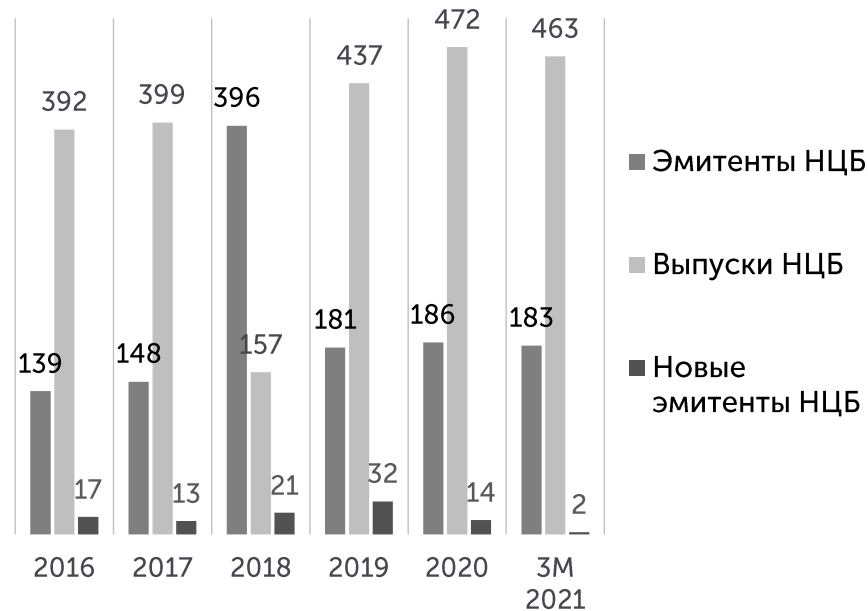
*облигации международных финансовых организаций
Источник: KASE

Структура официального списка KASE

Структура официального списка в разрезе секторов экономики



- институты развития
- реальный частный
- реальный квазигос
- финансы частный
- финансы квазигос

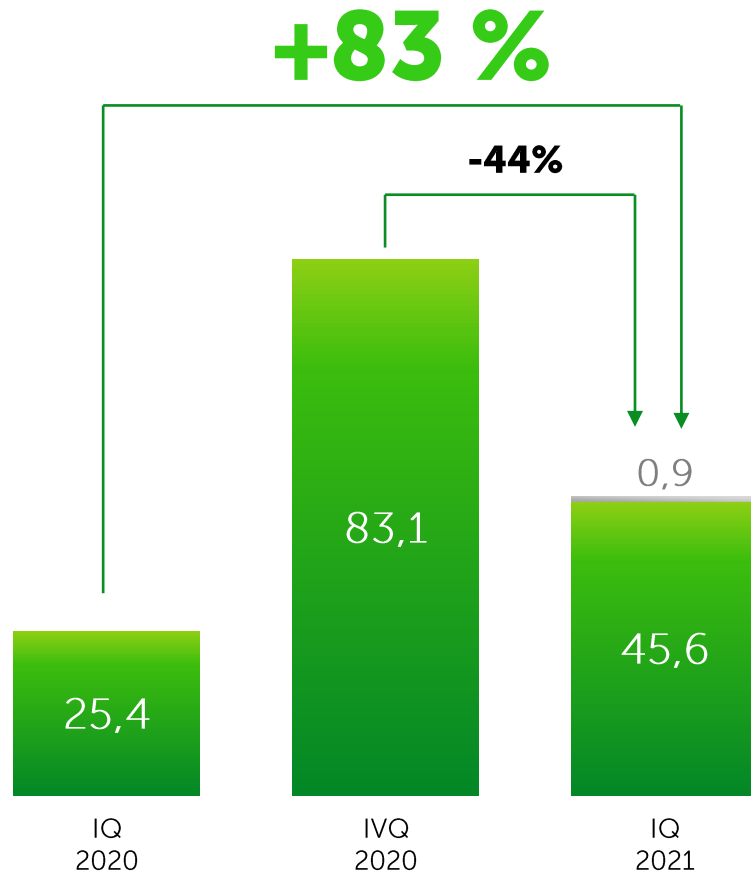


В 2021 году были включены в официальный список **15 инструментов** **10 эмитентов**, в том числе 2 инструмента 2 новых эмитентов:

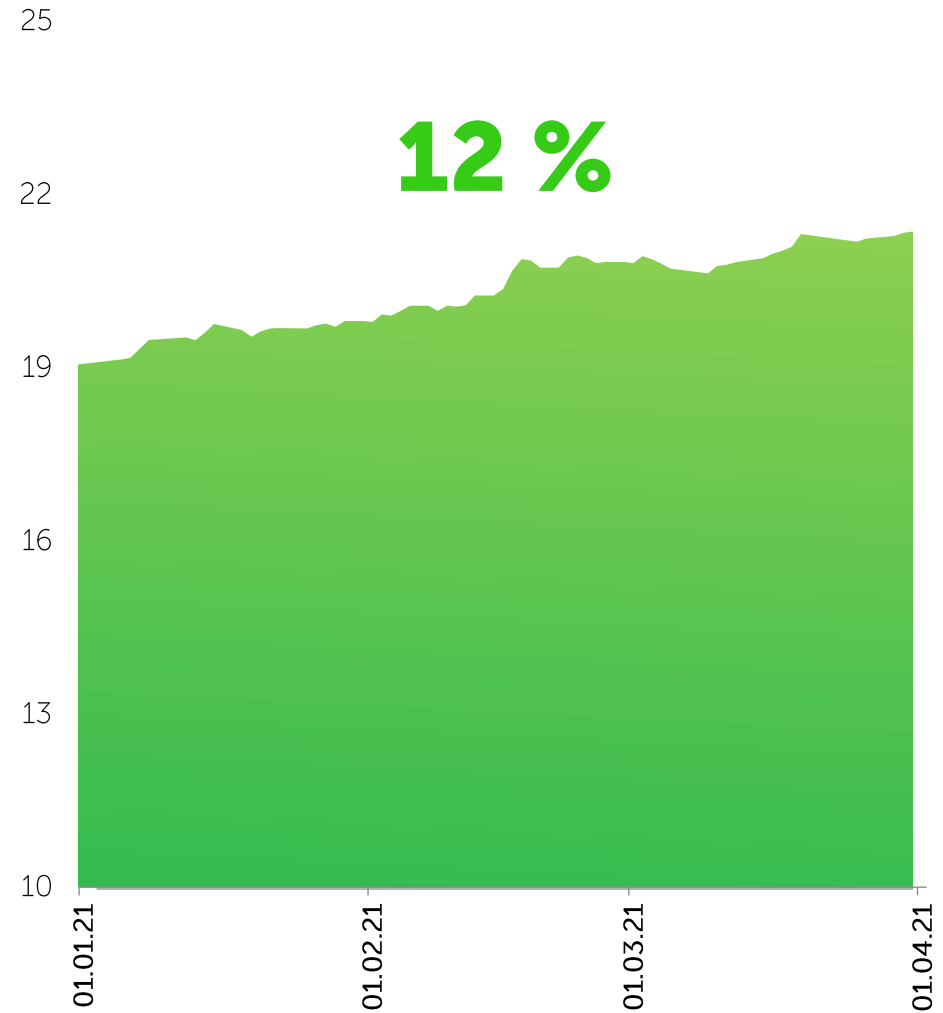
- АО "Жалтырбулак" (реальный)
- ТОО "Микрофинансовая организация аФинанс" (финансы)
- АО "Казахстанский фонд устойчивости" (квазигос)
- АО "BCC Invest" (финансы)
- Азиатский банк развития (финансы)
- АО "НУХ "Байтерек" (квазигос)
- АО "Фонд развития промышленности" (квазигос)
- АО "НК "Продовольственная контрактная корпорация" (квазигос)
- ТОО "ТехноЛизинг" (финансы)
- АО "Казахтелеком" (квазигос)

Объем сделок на рынке акций, млрд тенге

■ Вторичный рынок ■ Первичный рынок

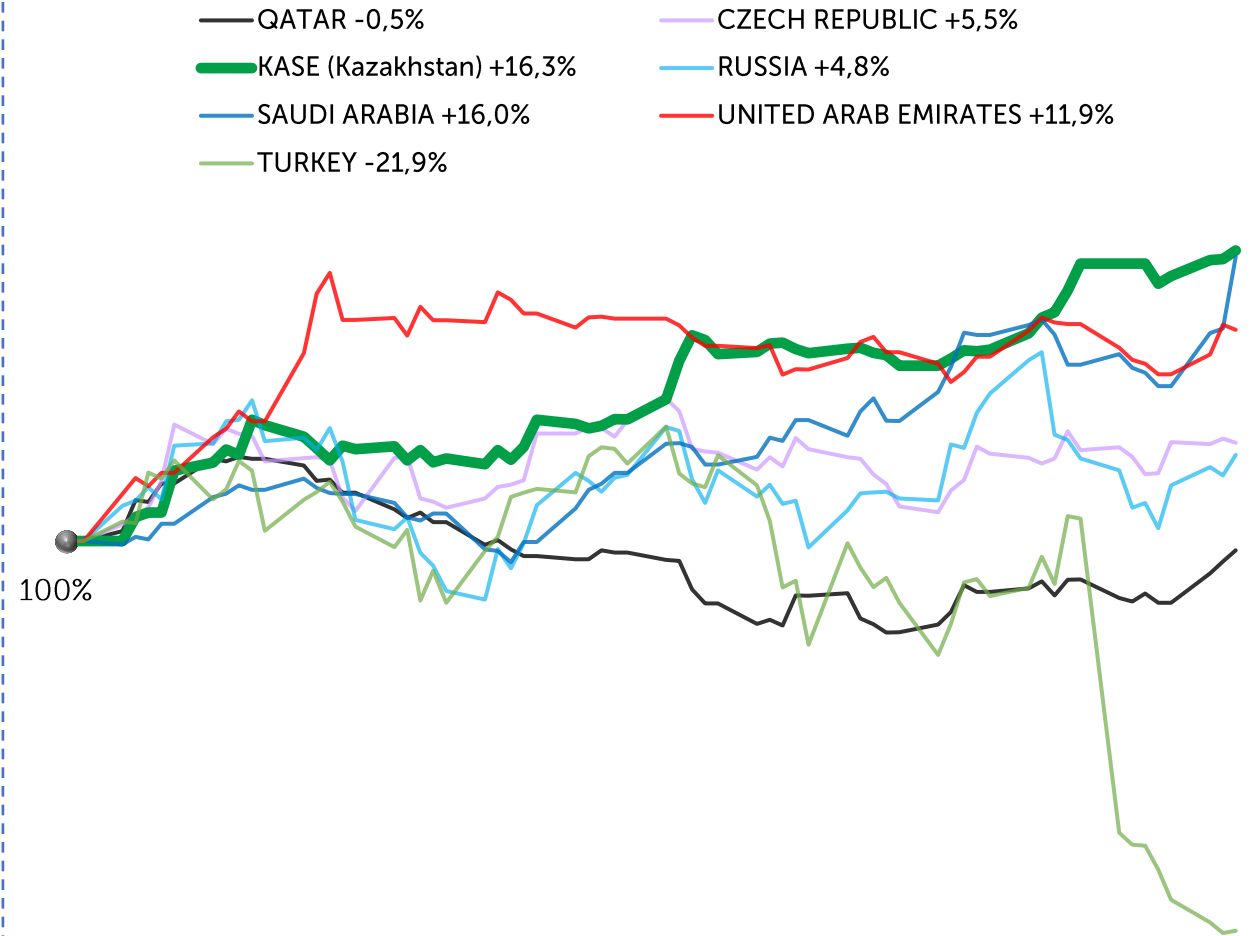
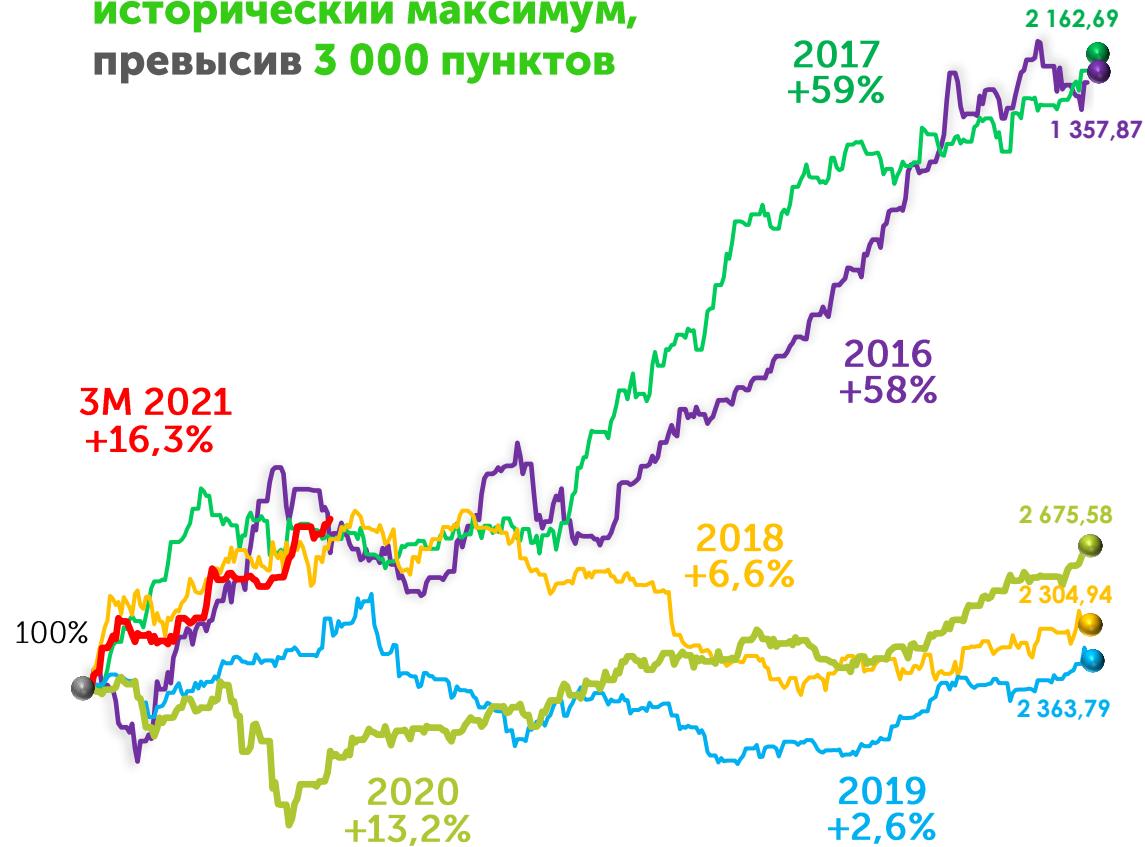


Капитализация рынка акций, трлн KZT

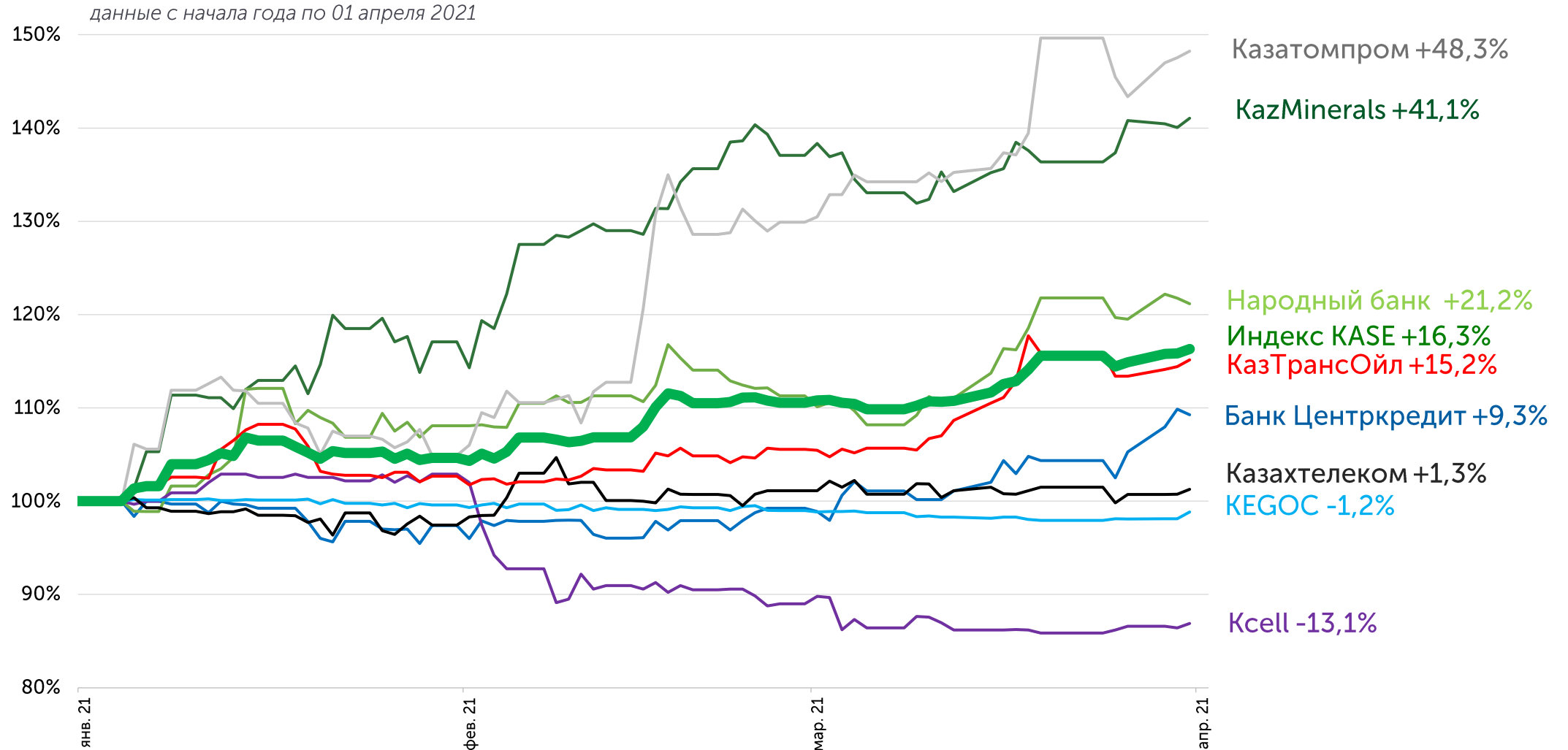


Индекс KASE и мировые фондовые индексы

Индекс KASE обновил
исторический максимум,
превысив 3 000 пунктов



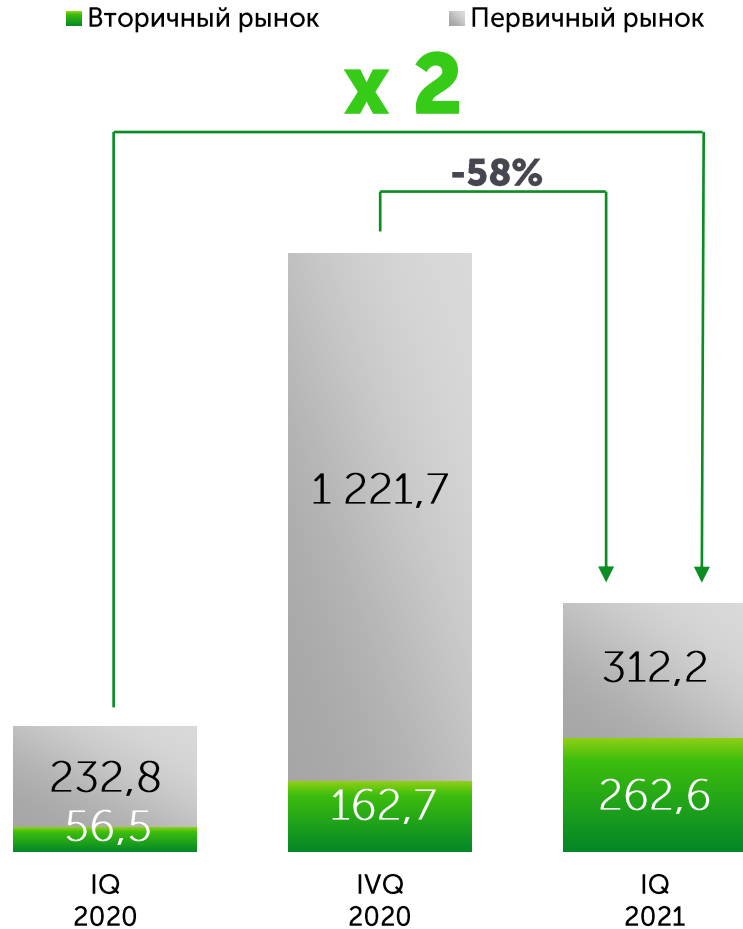
Динамика последних цен акций Индексной корзины с начала года



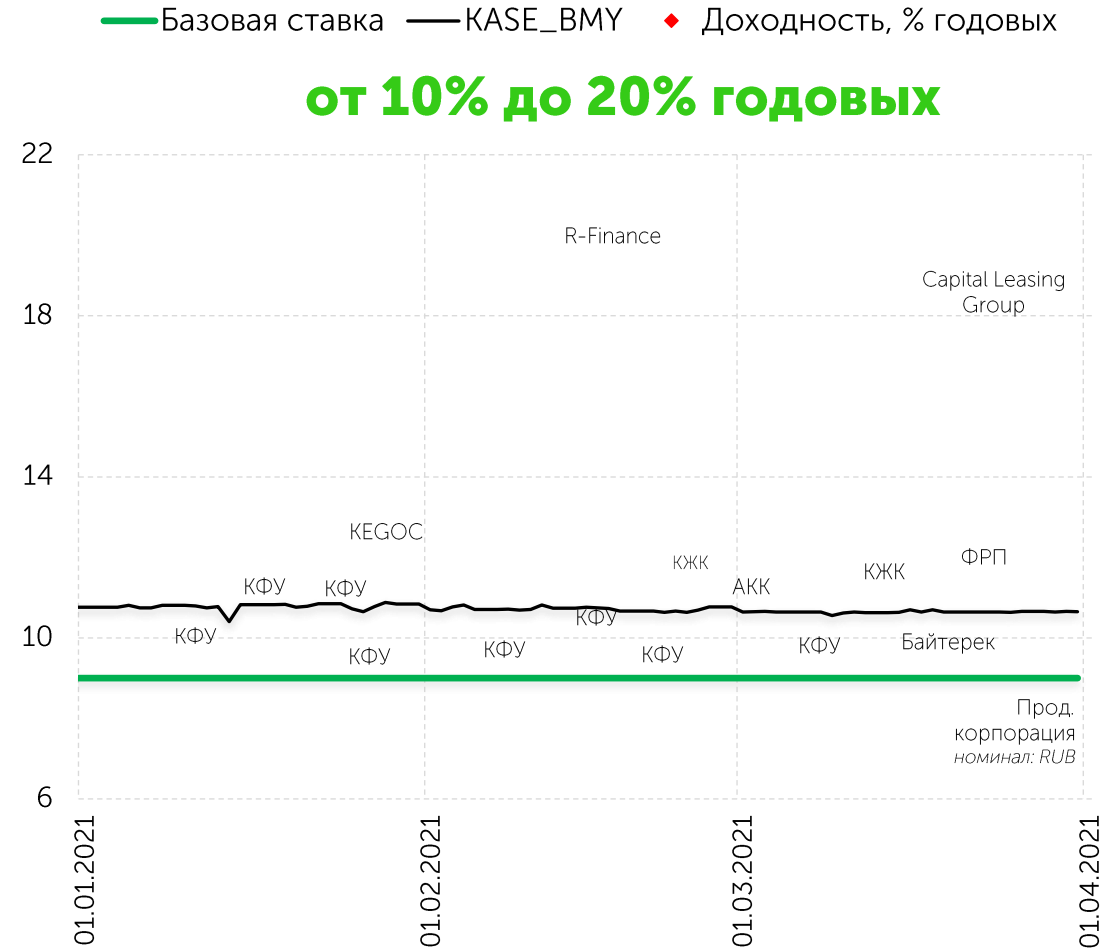
*тренд рассчитан по итогам первого квартала 2021 года
Источник: Bloomberg

Рынок корпоративных облигаций

Объем сделок на рынке корпоративных облигаций, млрд тенге



Рыночные размещения в IQ 2021 года



Инвесторы на рынке корпоративных облигаций

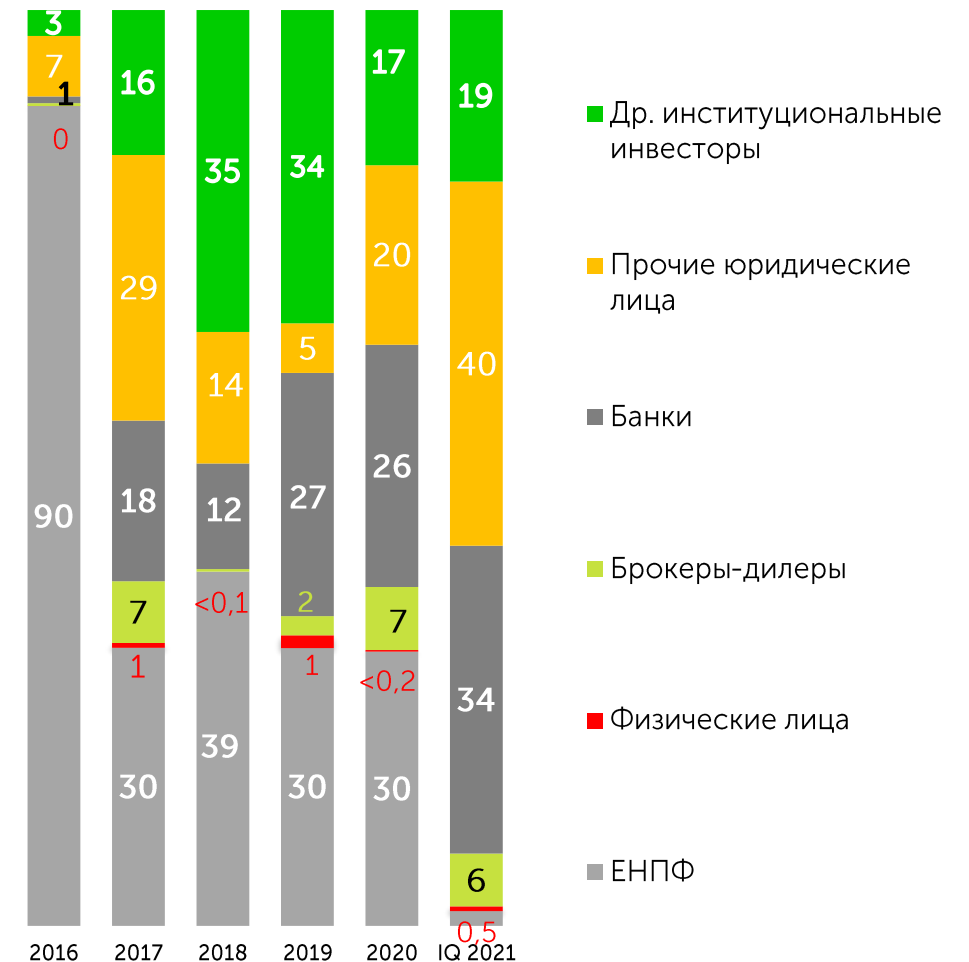
	2016	2017*	2018*	2019*	2020*	IQ 2021**
Количество эмитентов	12	14	23	27	14	9
ИЗ НИХ:						
квазигосударственные компании и институты развития	7	8	10	13	9	7
частные нефинансовые компании	5	1	2	3	2	0
частные финансовые компании	–	5	11	11	3	2
Привлечение, млрд. KZT	424,4	269,5	1 824,5	1 349,7	1 348,1	312,2
ИЗ НИХ:						
квазигосударственные компании и институты развития	417,5	234,7	1 418,4	1 140,0	1 308,9	310,5
частные нефинансовые компании	6,9	0,9	5,4	37,8	9,0	0
частные финансовые компании	–	33,9	400,7	171,9	30,2	1,7

* без учета Программы финансовой поддержки банковского сектора и размещений нерыночного характера

** рыночные размещения

Источник: KASE

Доли основных категорий инвесторов, %*



Размещения корпоративных облигаций в IQ 2021 года



Микрофинансовые организации



ОнлайнКазФинанс

Дата начала обращения:
20.08.2020
Срок обращения:
2 года
Объем выпуска:
4 млрд KZT
Ставка:
19%



R-Finance

Дата начала обращения:
05.02.2021
Срок обращения:
3 года
Объем выпуска:
2 млрд KZT
Ставка:
20%



Кредит Time

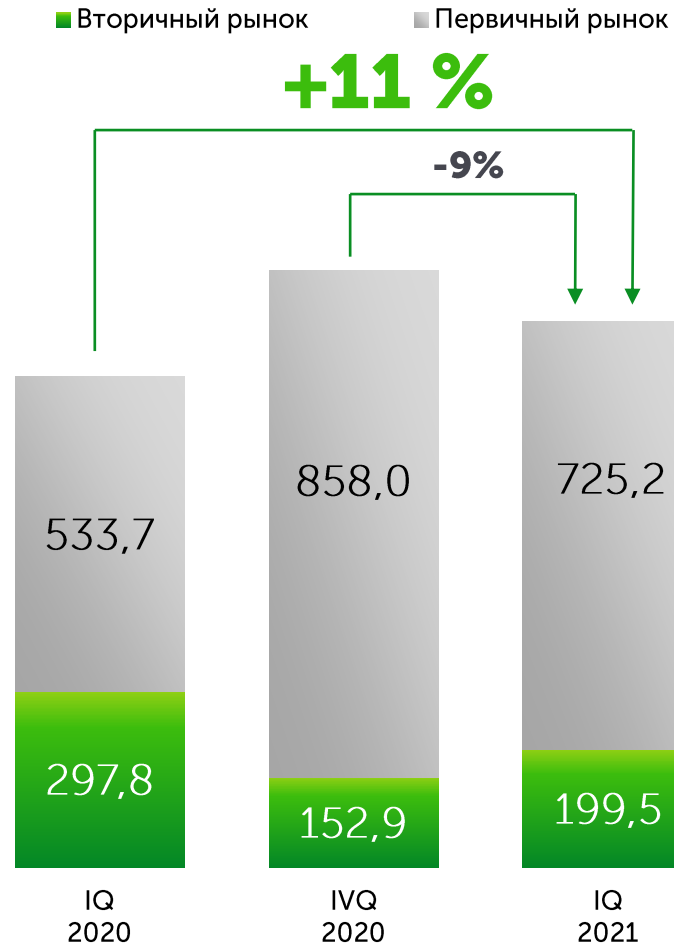
Дата начала обращения:
09.02.2021
Срок обращения:
2 года
Объем выпуска:
500 млн KZT
Ставка:
20%



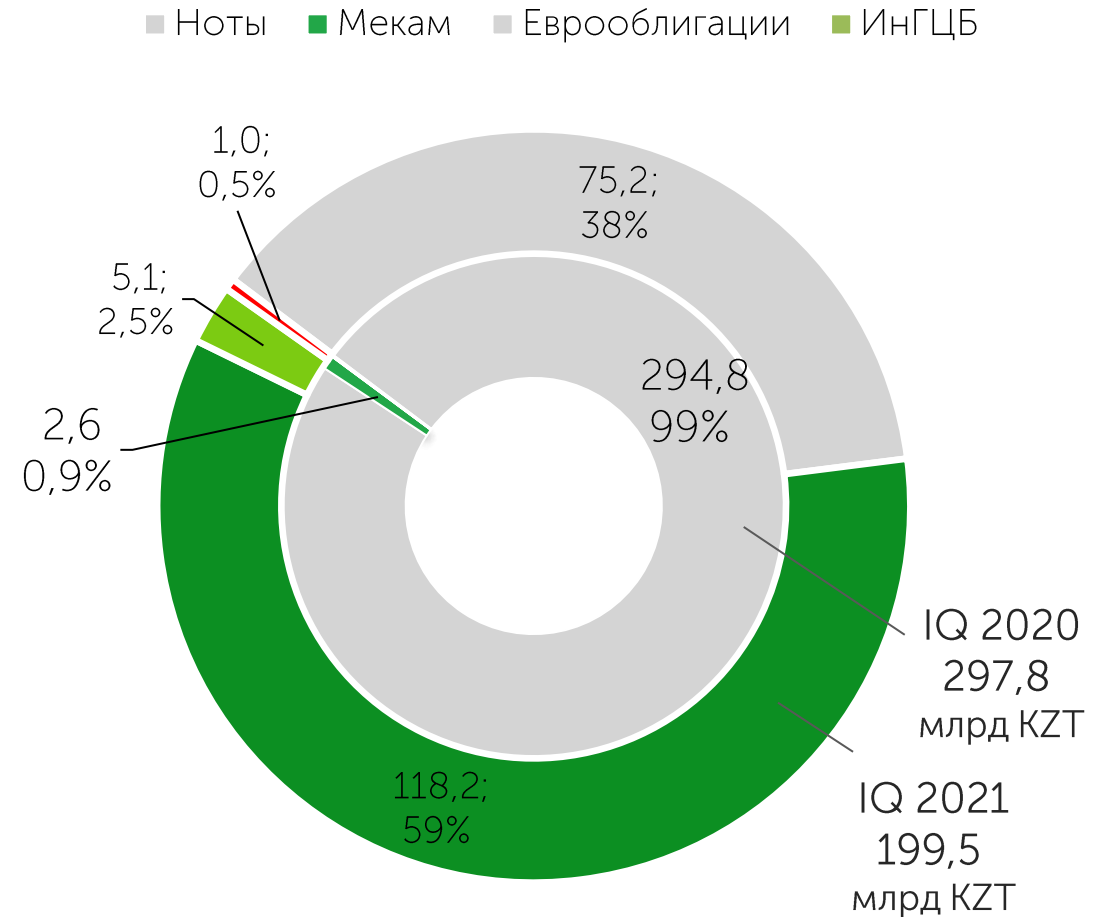
аФинанс

Дата начала обращения:
–
Срок обращения:
2 года
Объем выпуска:
750 млн KZT
Ставка:
20%

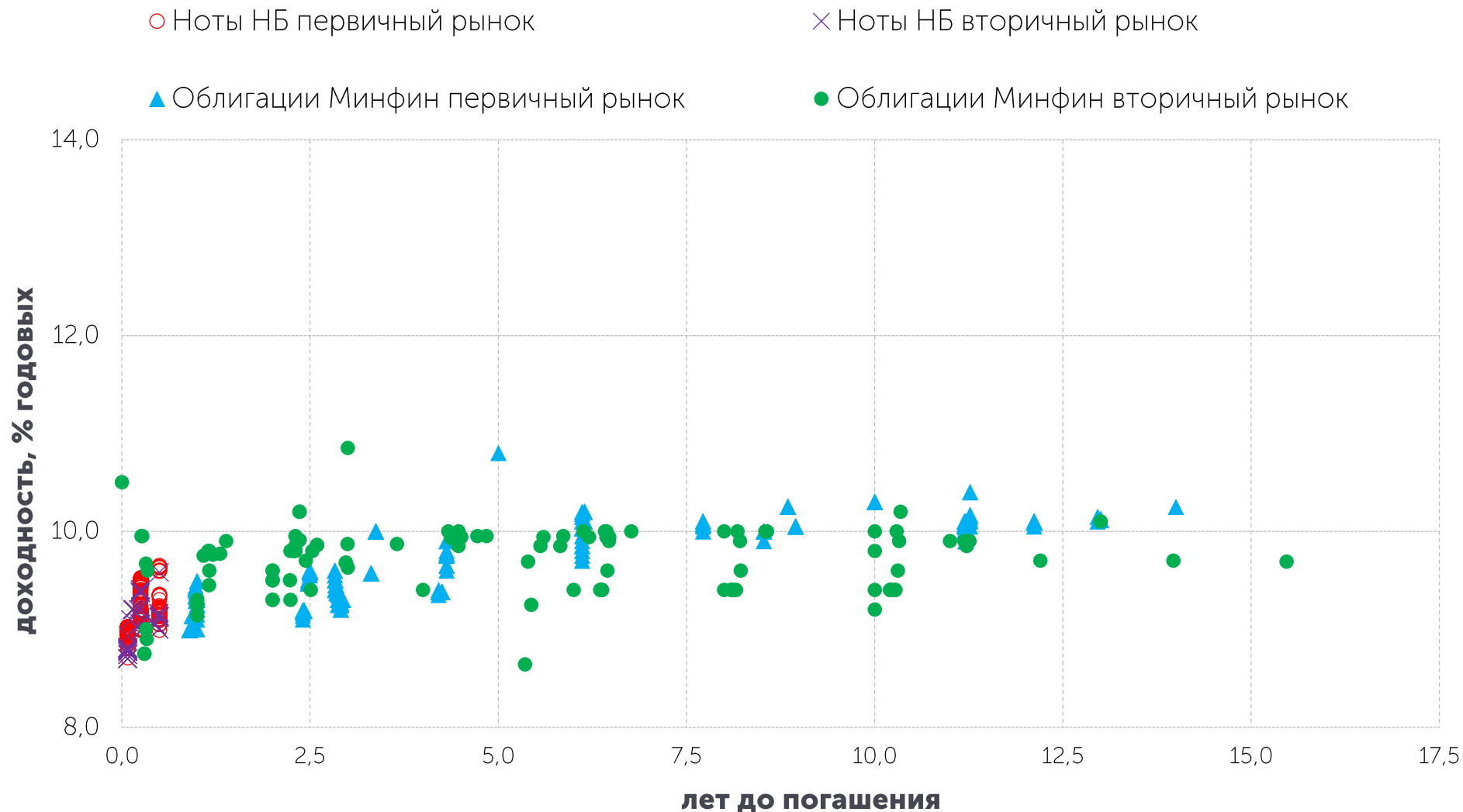
Объем сделок на рынке ГЦБ,
млрд тенге



Инструментальная структура вторичного
рынка ГЦБ на KASE



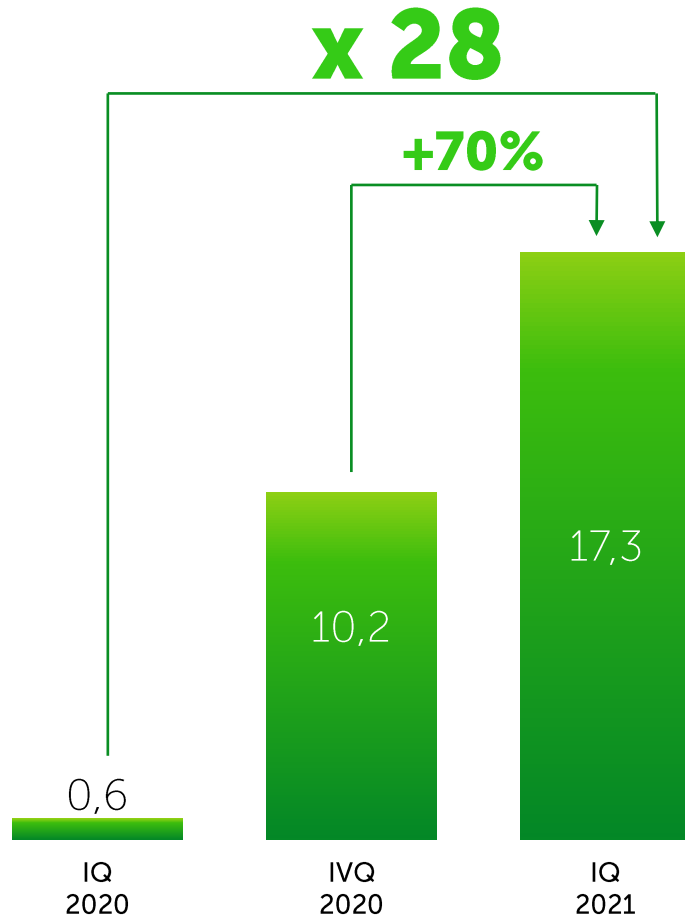
Доходность сделок на рынке ГЦБ в 2021 году



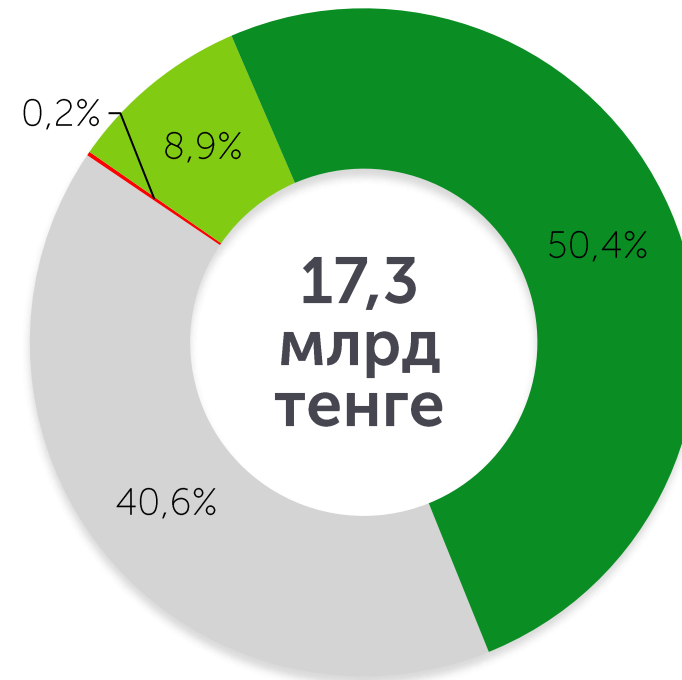
Ценные бумаги инвестиционных фондов

Объем сделок ЦБ
инвестиционных фондов, млрд тенге

■ Вторичный рынок



Структура инвесторов в IQ 2021 года*

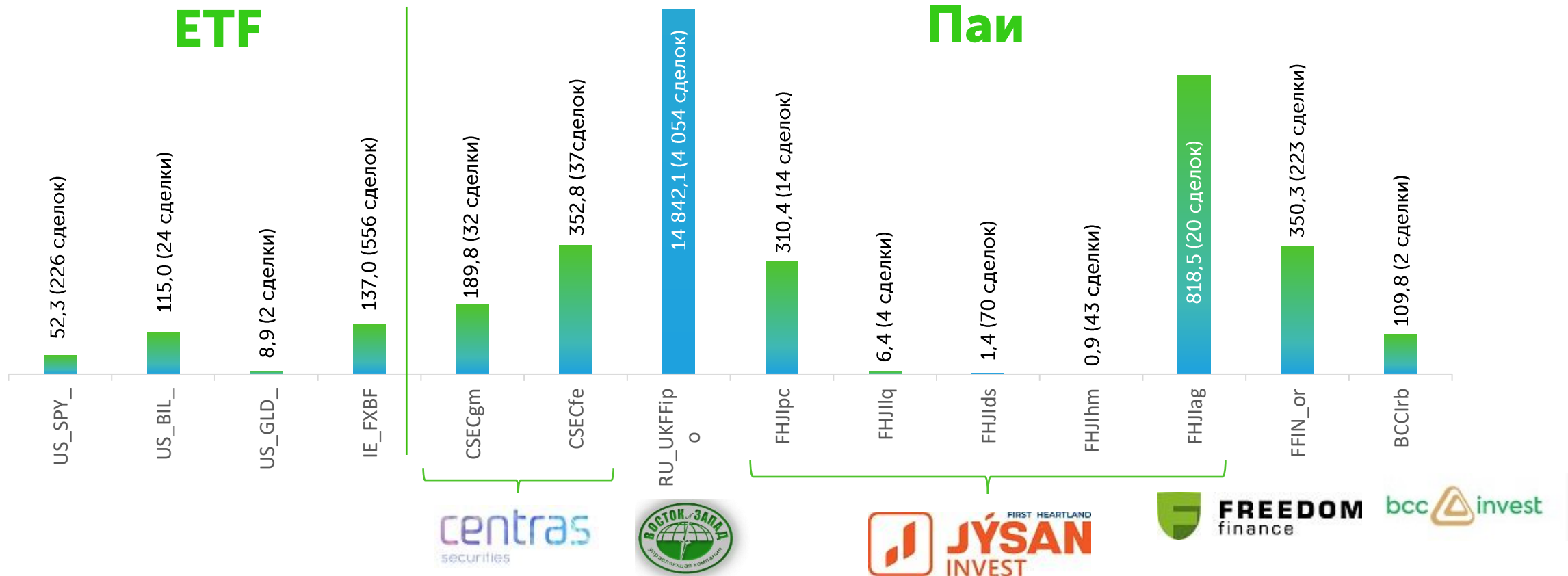


- Брокеры-дилеры
- Прочие институциональные инвесторы
- Другие юридические лица
- Физические лица

* от общего брутто-оборота торгов инвестиционными фондами

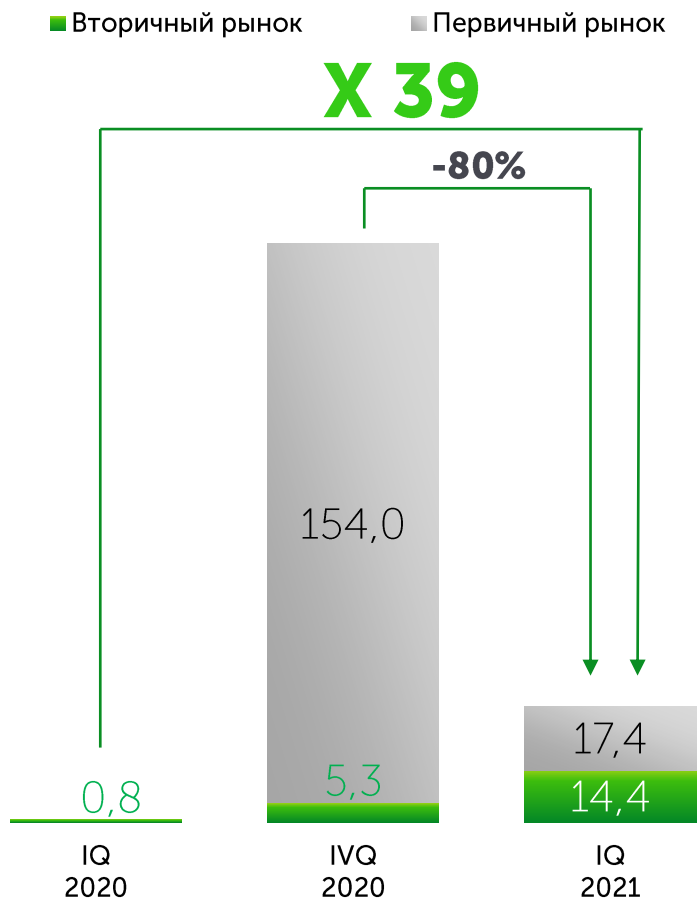
Ценные бумаги инвестиционных фондов

Объем торгов в IQ 2021 года в разбивке по инструментам, млн KZT



Облигации международных финансовых организаций (МФО)

Объем сделок на рынке ЦБ международных финансовых организаций, млрд тенге

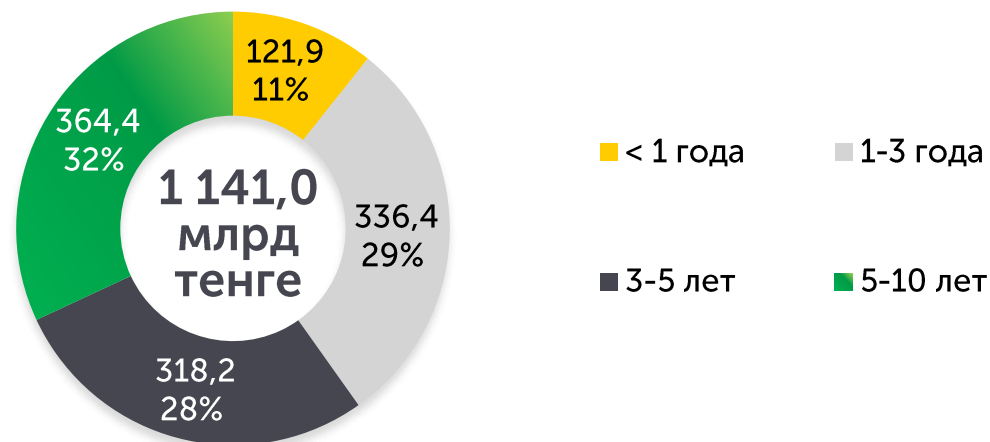


Asian Development Bank
два новых выпуска

Цель:

инвестирование проектов, нацеленных на снижение гендерного неравенства

Структура долга облигаций МФО в обращении по срокам до погашения



данные представлены на 01 апреля 2021 года по номинальной стоимости

Рост числа розничных инвесторов

Количество торговых счетов физических лиц в ЦД



+17 319

прирост счетов за IQ 2021 года

≈1,7 %

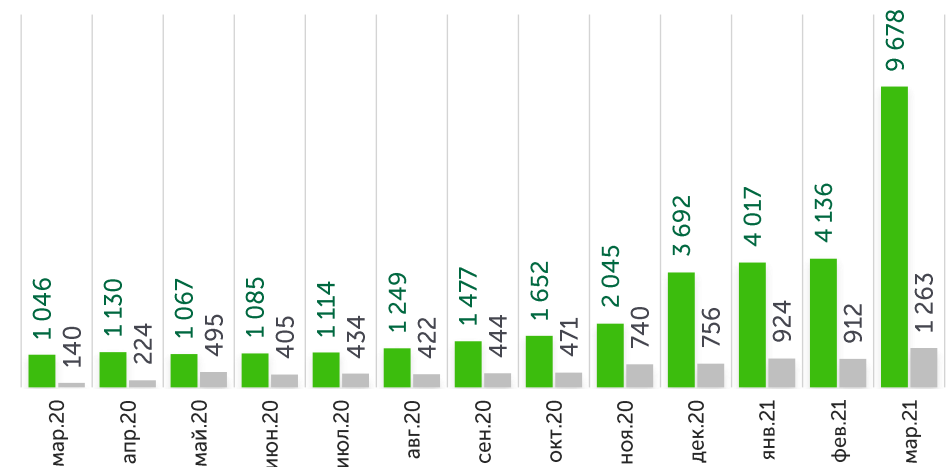
занятого населения Казахстана розничные инвесторы

Топ-5 наиболее популярных активов к покупке среди новых розничных инвесторов по итогам IQ 2021 года



Счета, совершившие как минимум одну сделку после открытия

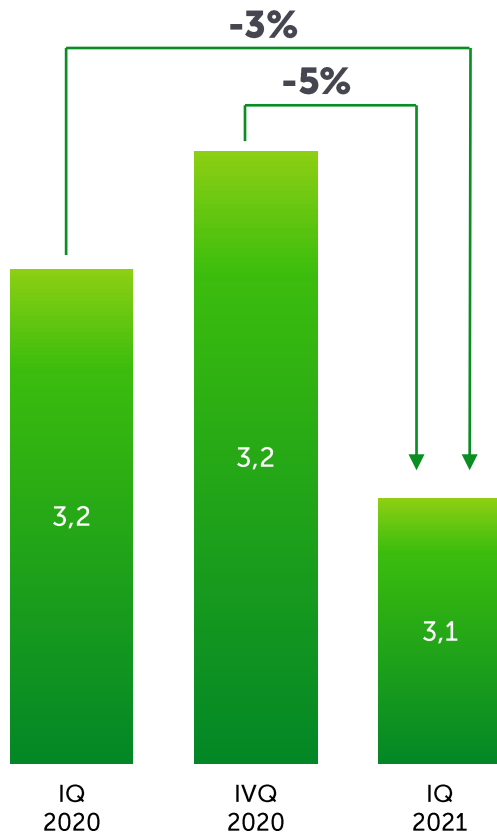
- Количество, открытых счетов
- Количество счетов физ.лиц, совершивших сделку в месяце открытия счета



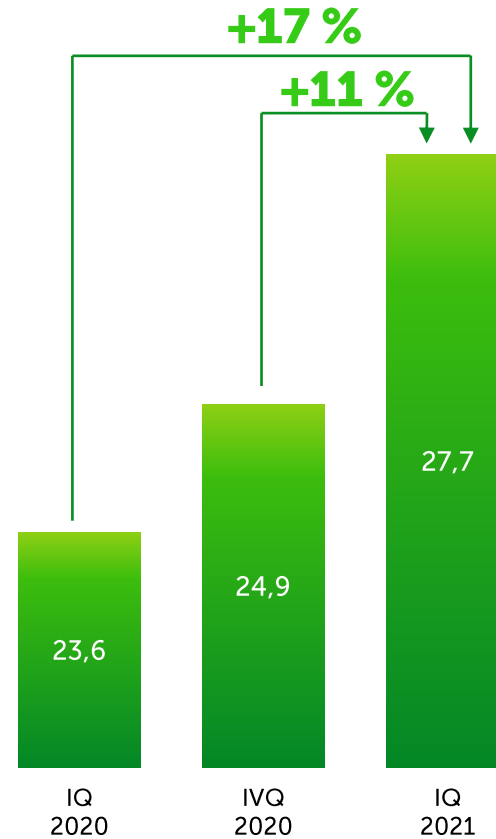
Источник: KASE, Центральный депозитарий ценных бумаг Казахстана, Комитет по статистике МНЭ РК

Тренды рынков денег и иностранных валют

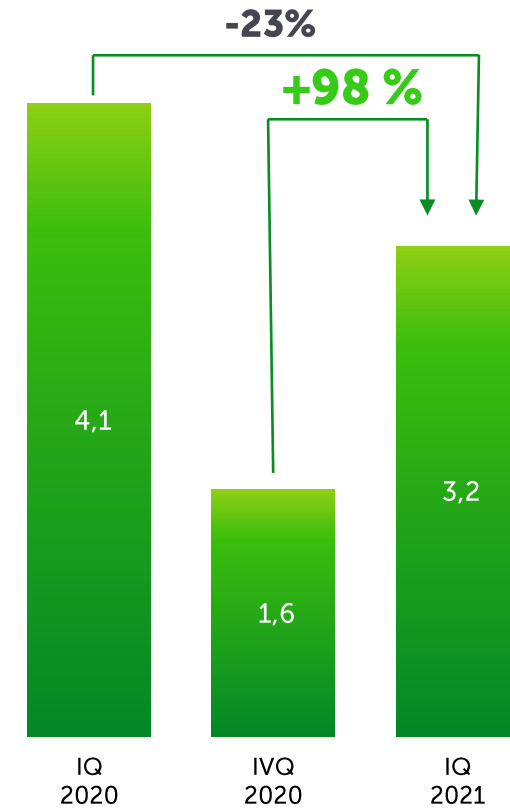
Объем сделок на рынке иностранных валют, трлн тенге



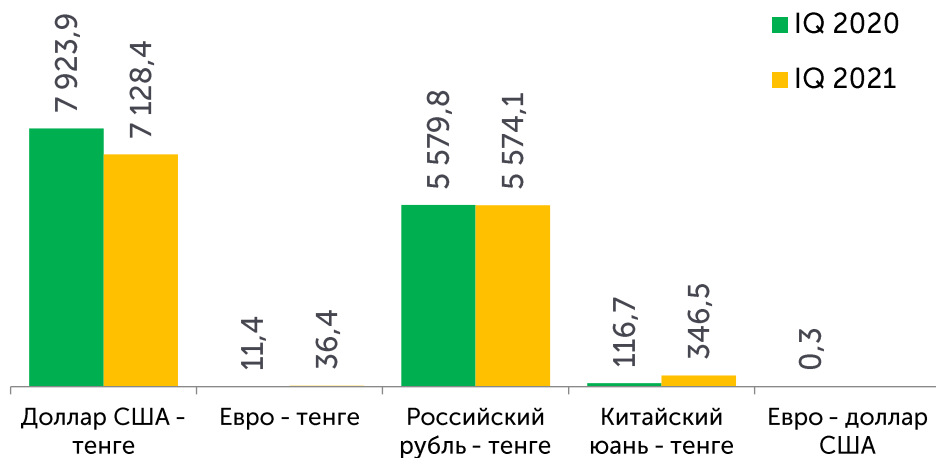
Объем сделок на рынке операций репо, трлн тенге



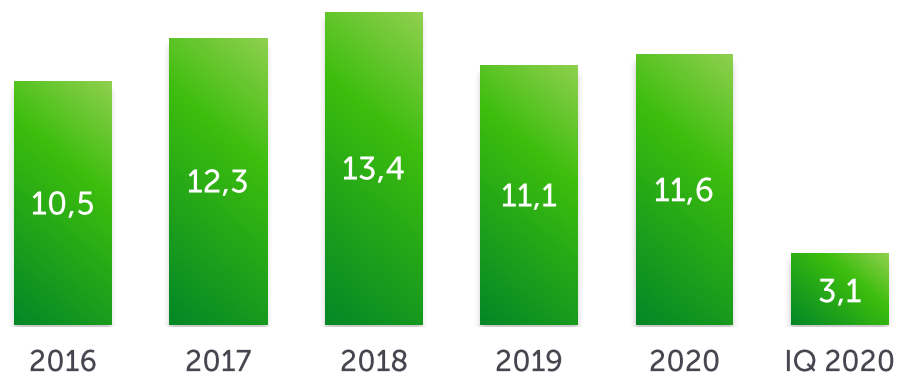
Объем сделок операций валютного свопа, трлн тенге



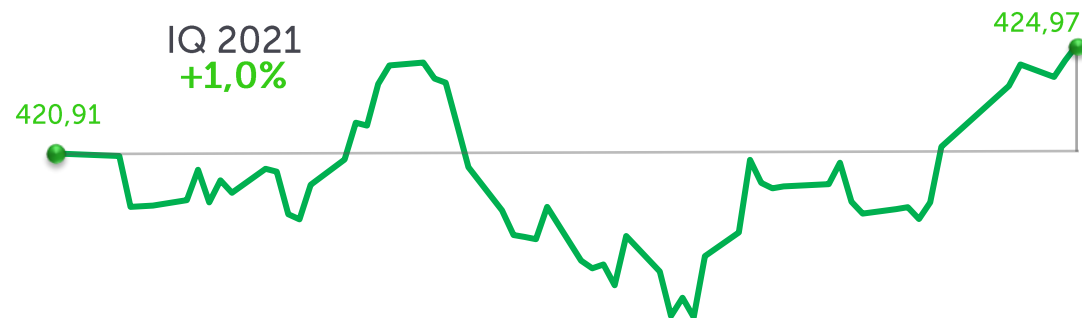
Структура биржевого рынка в объеме торгов, в млн ед. валюты



Объем торгов на спот-рынке, трлн тенге

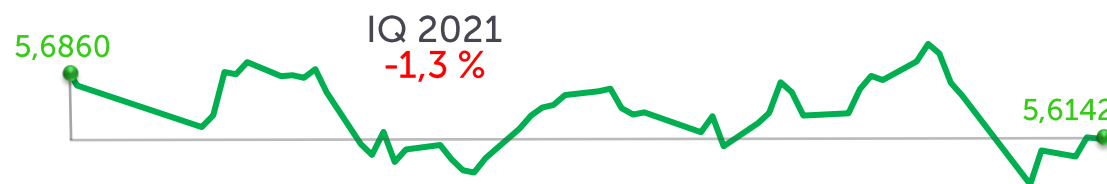


Динамика курса USD/KZT, KZT за ед. валюты



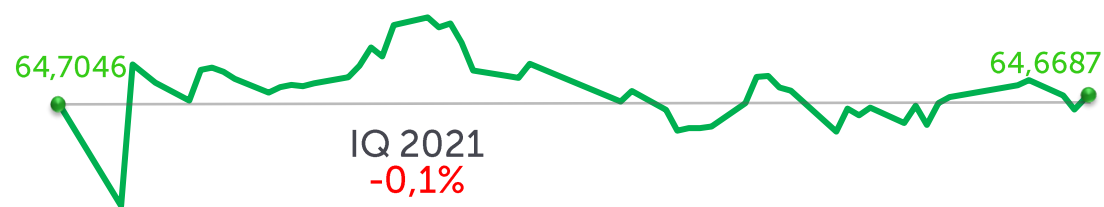
Примечание: динамика курса USD/KZT на основе средневзвешенного курса по итогам торгового дня

Динамика курса RUB/KZT, KZT за ед. валюты



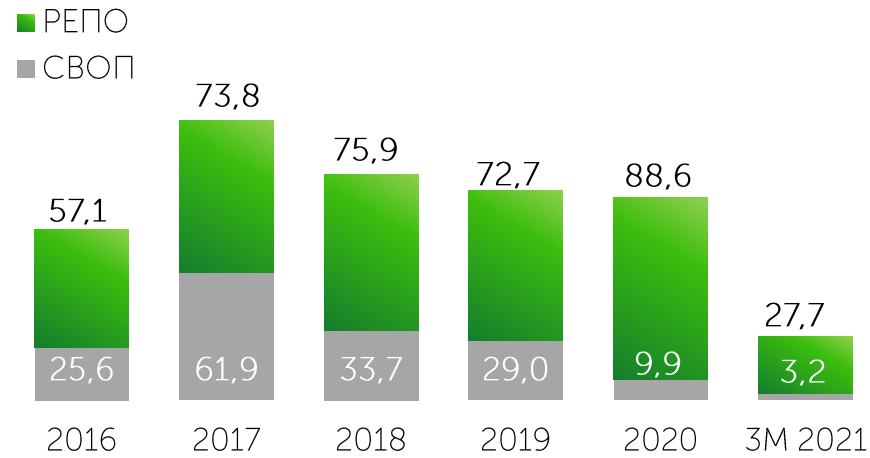
Примечание: динамика курса RUB/KZT на основе средневзвешенного курса по итогам торгового дня

Динамика курса CNY/KZT, KZT за ед. валюты

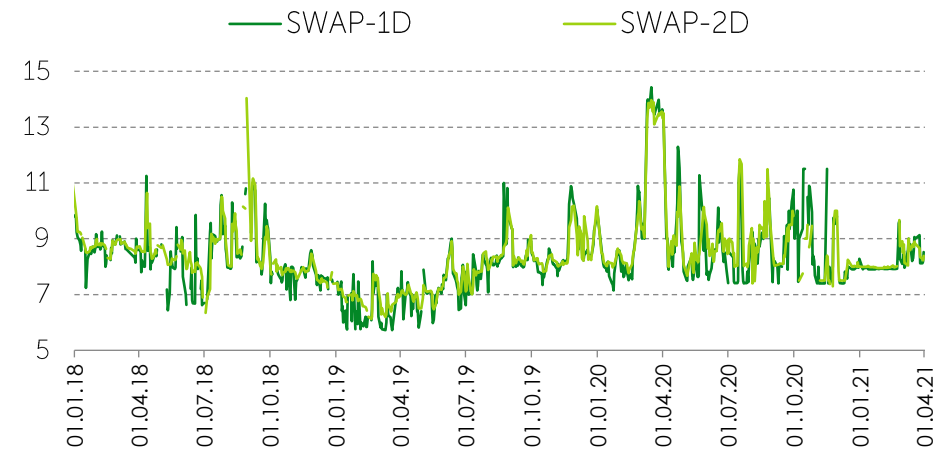


Примечание: динамика курса CNY/KZT на основе средневзвешенного курса по итогам торгового дня

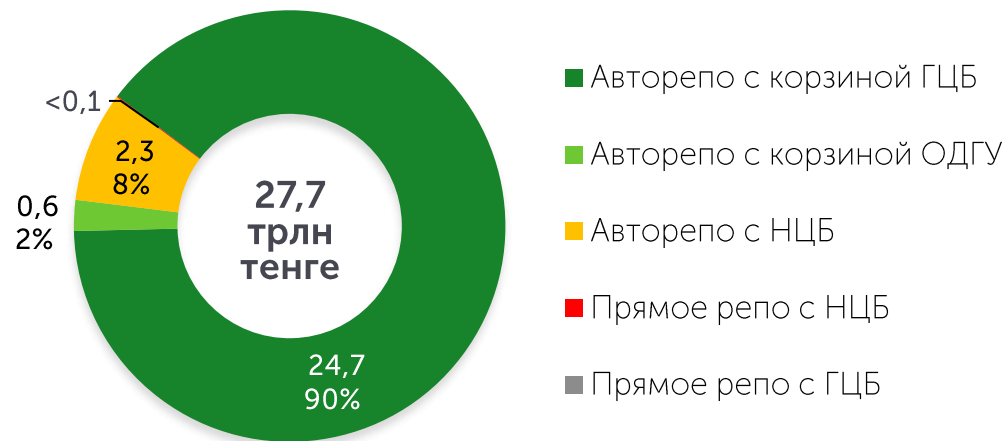
Объем торгов, трлн KZT



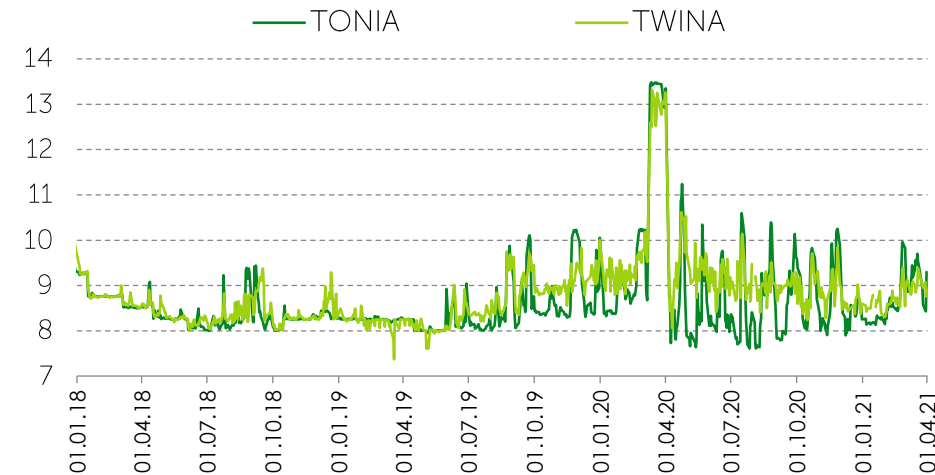
Индикаторы своп-рынка, % годовых



Инструменты рынка репо, трлн KZT



Индикаторы репо, % годовых



Содержание

01 | Краткий обзор результатов

▶ **02** | **Ключевые проекты KASE
и мероприятия**

IT модернизация

Реализовано

Внедрение новых торгово-клиринговых систем на фондовом, денежном и валютном рынках

Внедрение новых центров обработки данных

Обеспечение информационной безопасности и отказоустойчивости систем

Автоматизация процесса листинга

Запуск услуг ЦК

Внедрение центрального контрагента на всех рынках

Неттинг на фондовом рынке и репо

Мультиинструментальное обеспечение сделок

Расчетный цикл от T+0 до T+2

Предторговый контроль обеспечения

Привлечение провайдеров ликвидности

Увеличение срока операций репо, осуществляемых «автоматическим» способом

Ликвидность и глубина биржевого рынка

Привлечение региональных финансовых организаций в члены KASE

Внедрение программ для маркет-мейкеров

Инклюзия биржевых услуг через прямые контакты с потенциальными эмитентами и инвесторами

Внедрение принципов устойчивого развития

Повышение прозрачности KASE

Внедрение стандартов экологичности ведения бизнеса

Повышение социальной ответственности

В работе

Запуск SPECTRA на рынке деривативов / второе полугодие 2021

Реализация браузерной версии информационного терминала (Web-терминала IRIS) / первое полугодие 2021

Реинжиниринг внутренних систем / 2021 год

Внедрение клиринговых сертификатов участников (КСУ) / второе полугодие 2021

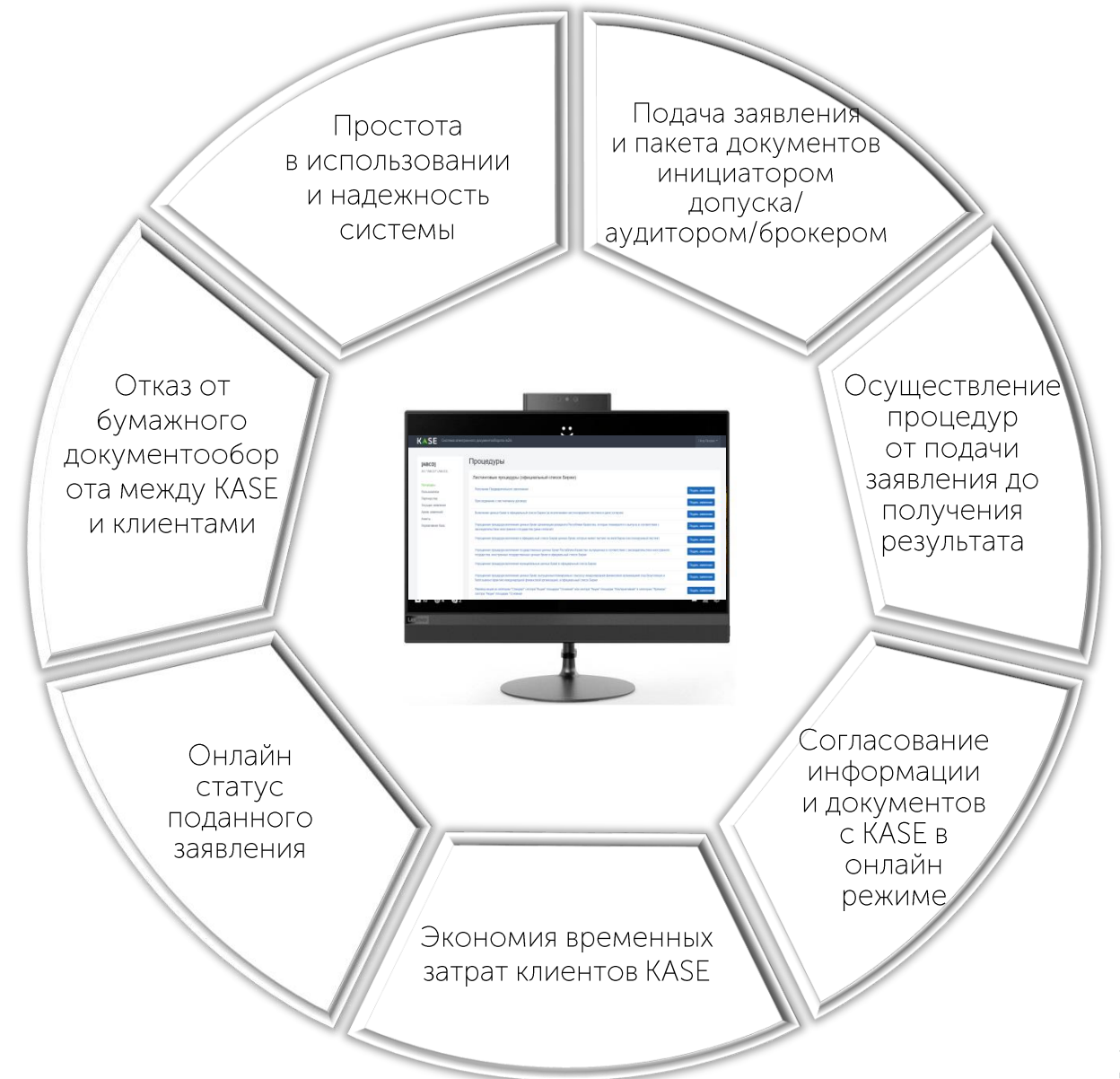
Запуск торгов по омнибус счетам / второе полугодие 2021

Открытие торгово-клирингового линка KZT/RUB / второе полугодие 2021

Реализация политики устойчивого развития Биржи / 2021 год

Автоматизация процедур листинга, принятия в члены Биржи и аккредитации аудиторских организаций

В марте 2020 года Биржа запустила в эксплуатацию новый модуль системы is2in, позволяющий осуществлять листинговые процедуры, формирование перечня признаваемых Биржей аудиторских организаций и прием в члены Биржи в электронном формате



Увеличение срока операций авторепо

ЦЕЛЬ

Расширение линейки инструментов биржевого рынка и обеспечение инфраструктуры для эффективного управления ликвидностью субъектов финансового рынка

ПРОЕКТ

С 09 марта 2021 года появилась возможность осуществления операций репо с ЦК с ценными бумагами, включенными в корзины ГЦБ и ОДГУ со сроком до 90 дней

Срок операций автоматического репо	1D, 2D, 3D, 7D, 14D, 30D по отдельным ЦБ и операции репо без ЦК в тенге
	1D, 2D, 3D, 7D, 14D, 30D, 90D с какой-либо корзиной ГЦБ и ОДГУ с ЦК в тенге
	1D, 7D репо с ЦК в долларах США
	1 D с корзиной ГЦБ с ЦК на доп. сессии
Срок операций прямого репо	до 30D с ЦК в тенге
	до 90D без ЦК в тенге
	до 7D с ЦК в долларах США
Предмет операций автоматического репо с ЦК	ценные бумаги, входящие в Список Т+, корзина ГЦБ, корзина ОДГУ, корзина НБРК
Предмет операций прямого репо с ЦК	ценные бумаги, входящие в Список Т+
Предмет операций автоматического репо без ЦК	акции, входящие в Список Т+, корзина ГЦБ
Предмет операций прямого репо без ЦК	определяются участниками данных операций самостоятельно из числа ценных бумаг, допущенных к обращению на Бирже

Образовательный проект "Биржевой симулятор"



Период проведения

с 01 апреля по 31 мая 2021 года

с 01 октября по 30 ноября 2021 года



БИРЖЕВОЙ СИМУЛЯТОР

Инструменты

В рамках проекта участникам торгов будут доступны новые инструменты, в т.ч. акции первого класса ликвидности, акции известных брендов, таких как Yandex, Exxon Mobil, Coca-Cola и др, а также ЦБ инвестиционных фондов

Участие

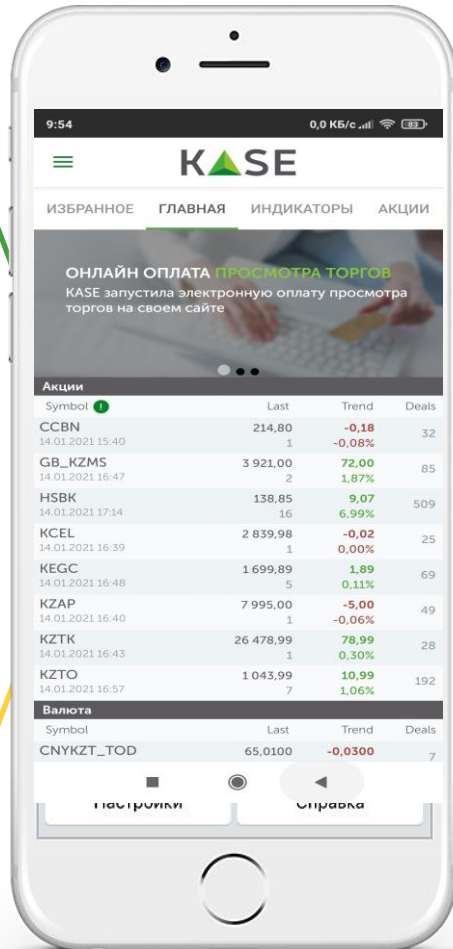
Принять участие можно скачав мобильное приложение KASE Mobile в [Google Play](#) и [App Store](#)

Цель проекта

повышение финансовой грамотности студентов финансово-экономических и других специальностей, желающих расширить свои профессиональные знания в рамках учебной программы, а также получение ими практических навыков работы на фондовом рынке

KASE MOBILE

Сервис предоставляется бесплатно и без авторизации на русском, казахском и английском языках
Приложение доступно на платформах Android и IOS



Оперативный доступ к биржевым новостям, котировкам, графикам

Структурированный доступ к информации по рынкам в один клик

Возможность просмотра индикаторов рынка KASE

Возможность создания пользователем избранного набора инструментов для отслеживания цен

МОБИЛЬНЫЕ ПРИЛОЖЕНИЯ БРОКЕРОВ

Из 39 брокерских организаций 7 брокерских организаций предоставляют мобильное приложение



Через банковское приложение

Через приложение брокера

Члены Биржи

Андеррайтер года

на рынке
корпоративных
облигаций



Лидер рынка

акций
корпоративных
облигаций
ГЦБ



иностранных валют



Маркет мейкер-года

на рынке акций



на рынке
корпоративных
облигаций



на рынке ГЦБ



За значительный вклад в
привлечении инвесторов



Лучший финансовый
консультант



За вклад в развитие сектора
"Международные финансовые организации"



Наибольший объем на
вторичном рынке акций



За вклад в развитие биржевого
рынка китайского юаня



За вклад в развитие биржевого
рынка российского рубля



Листинговые компании, демонстрирующие наилучшие примеры делового поведения на рынке ценных бумаг в части раскрытия информации о себе и своей деятельности



За активное освещение фондового рынка и KASE в печатных средствах массовой информации" дипломы присуждены:

Динаре Бекмаганбетовой (газета "Курсив") и Ирине Ледовских

В номинации "За активное освещение фондового рынка и KASE на интернет-ресурсах" наградными дипломами отмечены:

Елена Тумашова (ИА "Inbusiness.kz") и Милана Бейноева (ИА агентство "LS Aqparat")



Мероприятия Биржи (1/2)

Для эмитентов и инвесторов

05 февраля KASE совместно с руководством Азиатского Банка Развития в рамках проекта **"Road Show"** провели онлайн-встречу для инвесторов и профессиональных участников рынка ценных бумаг

06 апреля KASE совместно с руководством АО "Казахтелеком" в рамках проекта **"День эмитента"** провела онлайн-встречу для инвесторов, профессиональных участников рынка ценных бумаг и представителей СМИ, посвященную итогам деятельности компании за 2020 год

09 февраля KASE совместно с АО "Jýsan Invest" и руководством акимата г. Шымкент в рамках проекта **"День эмитента"** провела онлайн-встречу для инвесторов, профессиональных участников рынка ценных бумаг и представителей СМИ, посвященную планируемому выпуску облигаций г. Шымкент

11 февраля на KASE прошла онлайн встреча с инвесторами руководства **ТОО "1Fit"**. Компания получила допуск на площадку "KASE Startup" 01 февраля 2021 года



Мероприятия Биржи (2/2)

Обучающие мероприятия

01 февраля KASE провела **KASE Talks Online** с Председателем Правления АО "Jyſan Invest" Нурдаулетом Айдосовым. Участники обсудили изменение и цифровизацию брокерских услуг в Казахстане в последние годы, возможности локального рынка ценных бумаг

01 марта KASE провела **KASE Talks Online** с Председателем Правления АО "Фридом Финанс" Сергеем Лукьяновым. Участники обсудили тему возобновления программы "Народное IPO", передачу пенсионных активов в частное управление, а также обменялись взглядами на дальнейшее развитие фондового рынка

26 марта KASE провела **вебинар по основам фондового рынка** для участников образовательного проекта "Биржевой симулятор"

Международное сотрудничество

05 марта Биржа в рамках присоединения к инициативе ООН по устойчивому развитию и ежегодной церемонии открытия торгов **Ring the Bell for Gender Equality** провела совместно с Международной финансовой корпорацией (IFC) онлайн-мероприятие "Инклюзивное лидерство: новая реальность в бизнесе"

Глобальная акция Ring the Bell for Gender Equality призвана обратить внимание мирового сообщества на вопросы гендерного разнообразия и расширения влияния женщин в сферах политики, экономики и бизнеса.



Спасибо за внимание!

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

FAQ



KASE

Қазақстан қор биржасы
Казахстанская фондовая биржа
Kazakhstan Stock Exchange