



Қазақстан қор биржасы
Казахстанская фондовая биржа
Kazakhstan Stock Exchange

Типовая презентация

на 01 декабря 2020 года



АО "Казахстанская фондовая биржа"

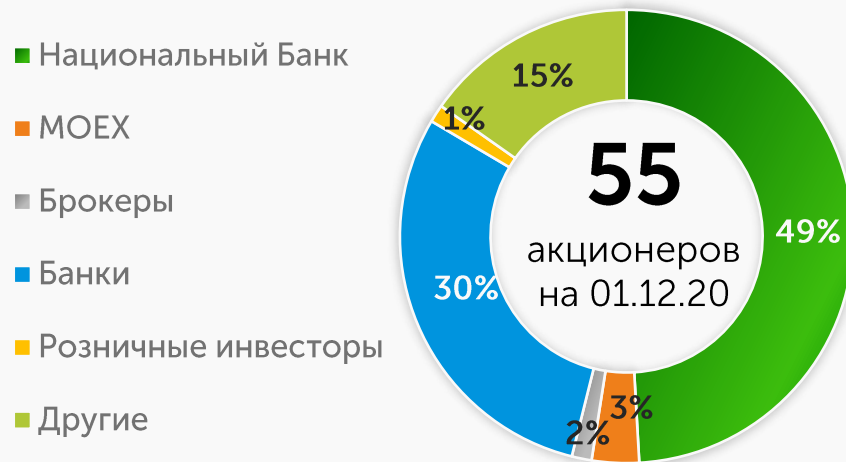
49,1% - НБРК

3,4% - МОЕХ

44,4% - 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



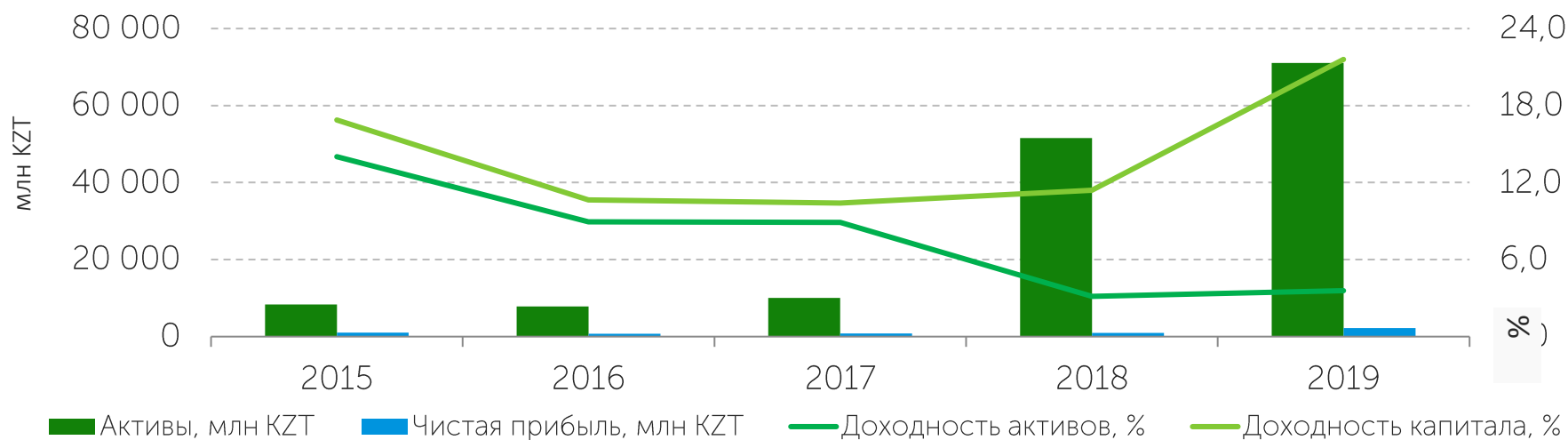
Акции и капитал KASE

На 01 октября 2020 года:

собственный капитал	13 376,5 млн KZT
оплаченный уставный капитал	2 661,8 млн KZT
количество объявленных акций	5 000 000
количество размещенных акций	974 373
количество выкупленных акций	13 329
балансовая стоимость акции	12 918,7 KZT

Показатели доходности KASE

	Активы, млн KZT	Чистая прибыль, млн KZT	Доходность активов, %	Доходность капитала, %
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
2016	7 809,0	721,8	8,9	10,7
2015	8 331,3	979,2	14,0	16,9



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

42

Фондовая

32

Валютная

24

Деривативы

51

всего участников рынка

25

банков второго уровня (из 27)
резиденты РК

20

брокерских компаний (из 20)
резиденты РК

49

локальных участников

2

иностранного участника
(ООО "УНИВЕР Капитал", ООО ИК "Фридом Финанс")

2

МФО (*Межгосударственный банк,
Евразийский банк развития*)

12

участников, предоставляющих
услуги прямого доступа (DMA)

Новые члены KASE:

2020

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

2019

- АО "CAIFC INVESTMENT GROUP" / валютная
- АО "Фридом Финанс" / валютная
- АО "Банк "Bank RBK" / деривативы
- АО "Шинхан Банк Казахстан" / валютная
- АО "Казпочта" / валютная

2018

- ООО ИК "Фридом Финанс" / фондовая
- АО "Цесна Капитал" / деривативы
- АО "Tengri Bank" / фондовая

2017

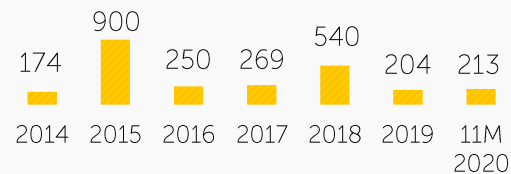
- ООО "УНИВЕР Капитал" / фондовая и деривативы
- АО "АТФБанк" / деривативы
- АО "Евразийский Капитал" / деривативы

Показатели биржевого рынка за одиннадцать месяцев 2020 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	6 951,1	16 588,6	796	30 757,3	38,6
Акции	213,2	513,1	760	943,4	1,2
Корпоративные долговые ЦБ	2 005,4	4 762,4	12	8 873,5	712,4
ГЦБ	4 500,6	10 766,8	8	19 914,1	2 555,7
Облигации МФО	212,6	500,5	1	940,5	1 756,6
ЦБ инвестиционных фондов	16,0	37,9	15	70,8	4,7
Производные ценные бумаги	3,4	8,0	<0,1	15,0	116,9
Рынок иностранных валют	10 484,0	25 421,6	397	46 389,2	116,7
Рынок денег	88 252,1	214 989,4	449	390 496,2	869,4
Операций репо	79 246,0	192 754,5	434	350 646,1	807,5
Операций валютного свопа	9 006,1	22 234,9	15	39 850,1	2 672,4
Деривативы	<0,1	<0,1	<0,1	<0,1	0,4
Итого	105 687,2	256 999,6	1 642	467 642,7	284,7

Объем и структура рынка

млрд KZT

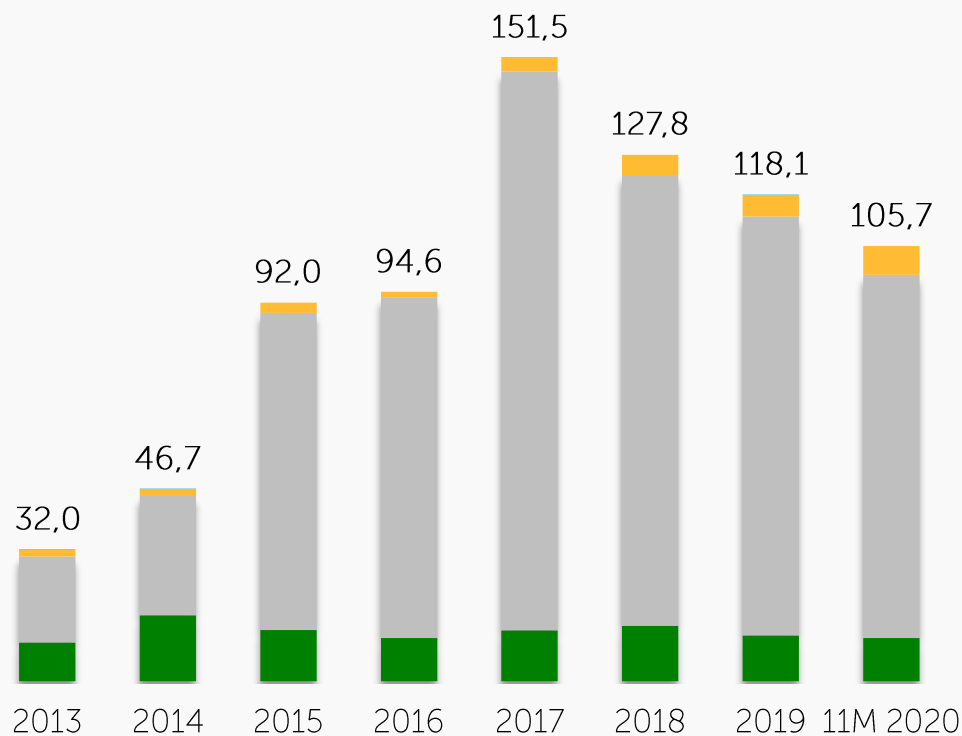


Рынок акций

2019	-62%
2018	x2
2017	+7,7%
2016	-72%
2015	x5
2014	+48%

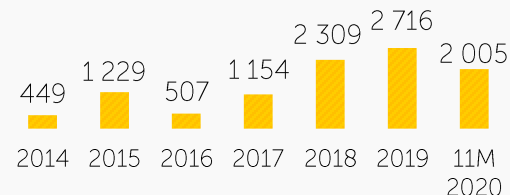


Динамика объема торгов по секторам, трлн KZT



Рынок корпоративных облигаций

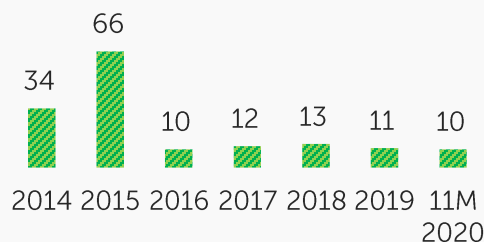
млрд KZT



2019	+18%
2018	x2
2017	+127%
2016	-59%
2015	x3
2014	+14%

Рынок иностранных валют

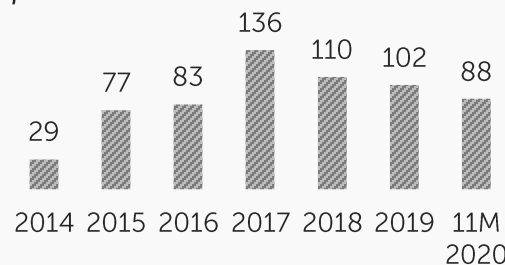
трлн KZT



2019	-17%
2018	+9%
2017	+18%
2016	-84%
2015	+96%
2014	+84%

Рынок денег

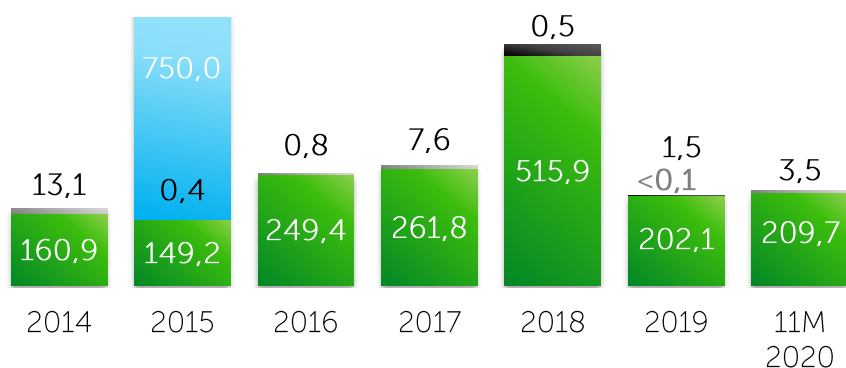
трлн KZT



2019	-7%
2018	-19%
2017	+64%
2016	+8%
2015	x 3
2014	+39%

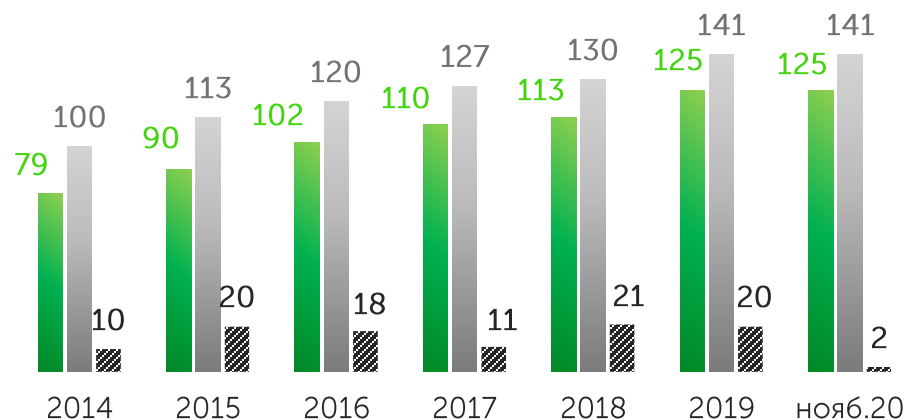
Объем сделок, млрд KZT

■ РД КазМунайГаз (выкуп) ■ КазМунайГаз
■ Первичный рынок ■ Вторичный рынок

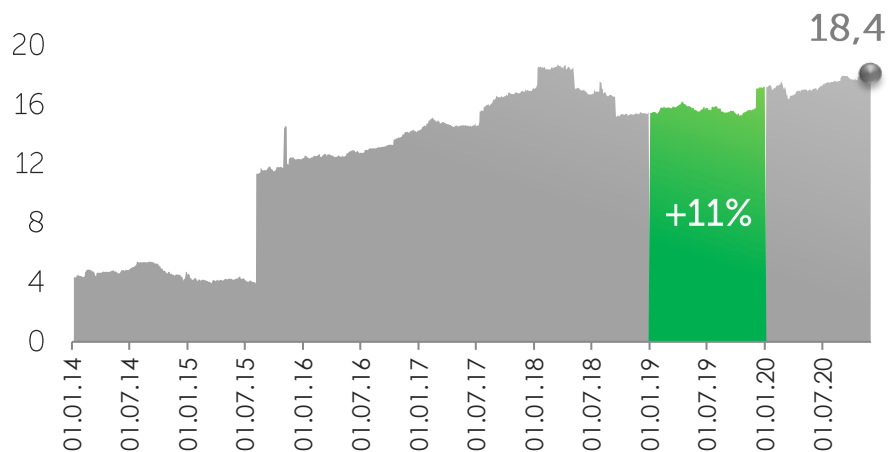


Новые листинги

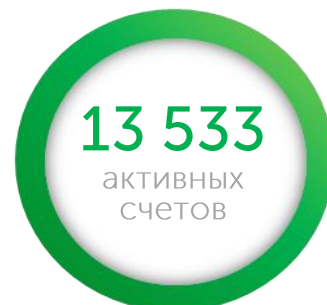
■ Эмитенты ■ Выпуски ■ Листинги



Капитализация рынка акций, трлн KZT



Основные показатели за 11М 2020 года



+13,0%
к 11М 2019 года



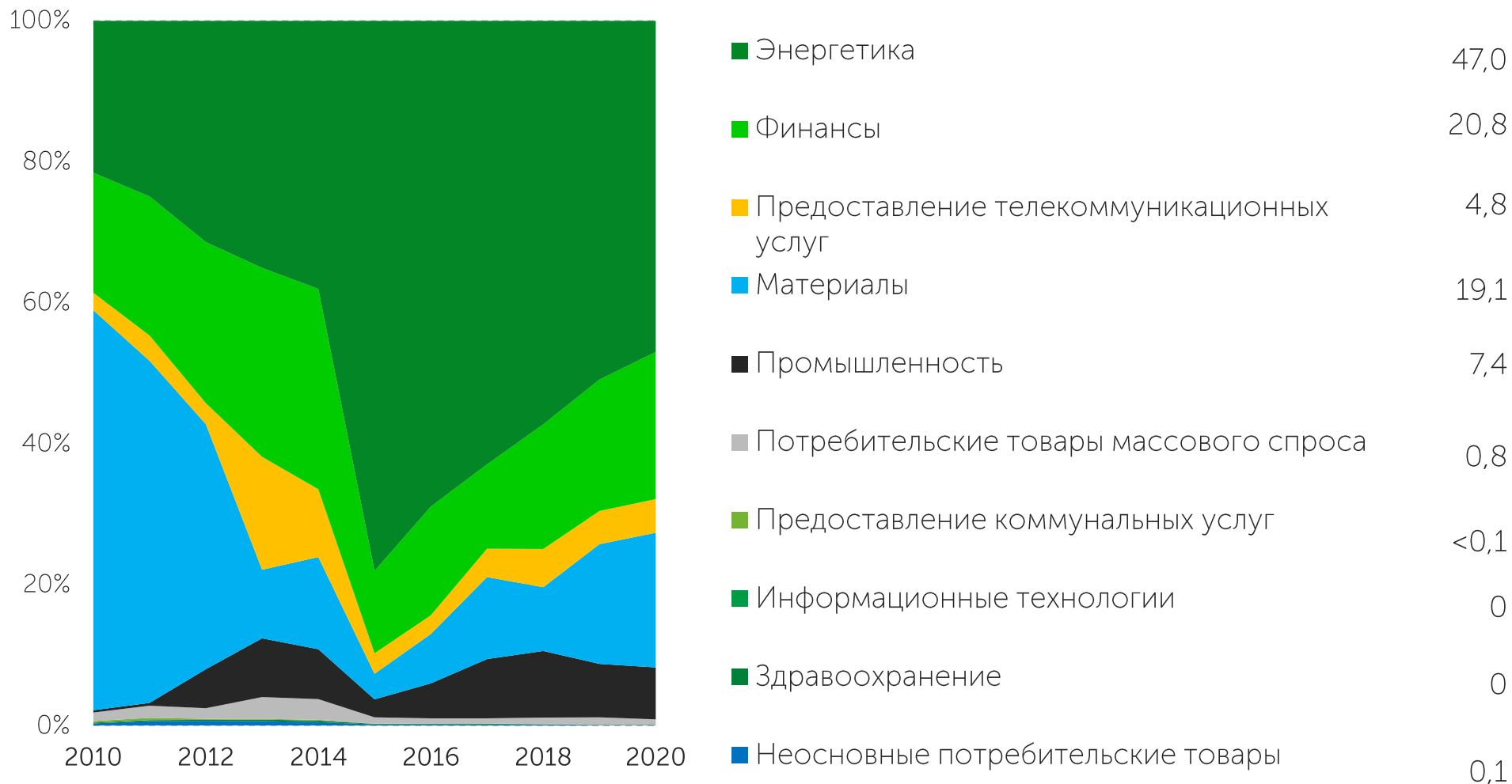
+13,3%
к 11М 2019 года



+79,2%
к 11М 2019 года

Отраслевая структура списков акций

Доля от капитализации, %

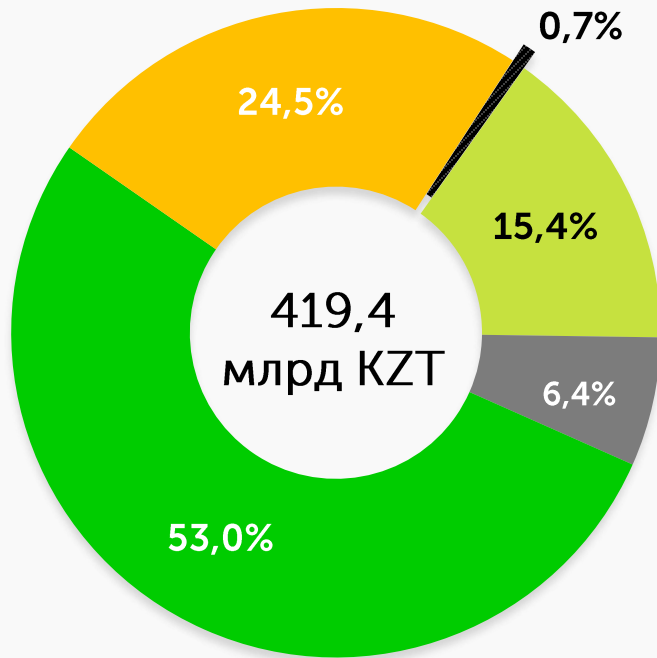


Примечание: в качестве классификатора используется "Global Industry Classification Standard (GICS)®"

Источник: KASE

Рынок акций: инвесторская база

Доли основных категорий инвесторов на вторичном рынке за 11М 2020 год*

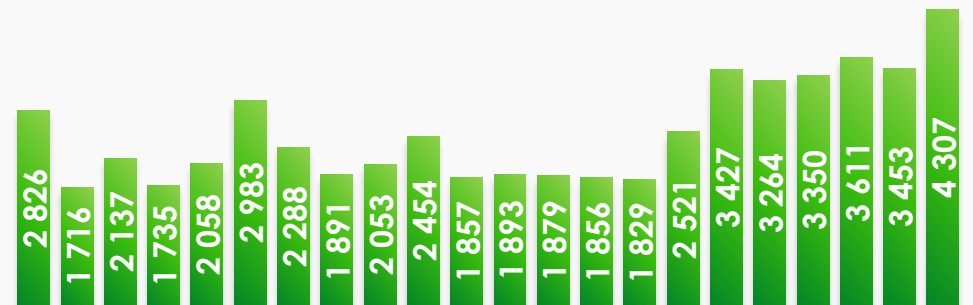


- Банки
- Брокеры-дилеры
- Др. институциональные инвесторы
- Физические лица
- Прочие юридические лица

Доля нерезидентов в брутто-обороте, %



Динамика активных счетов розничных инвесторов на рынке акций



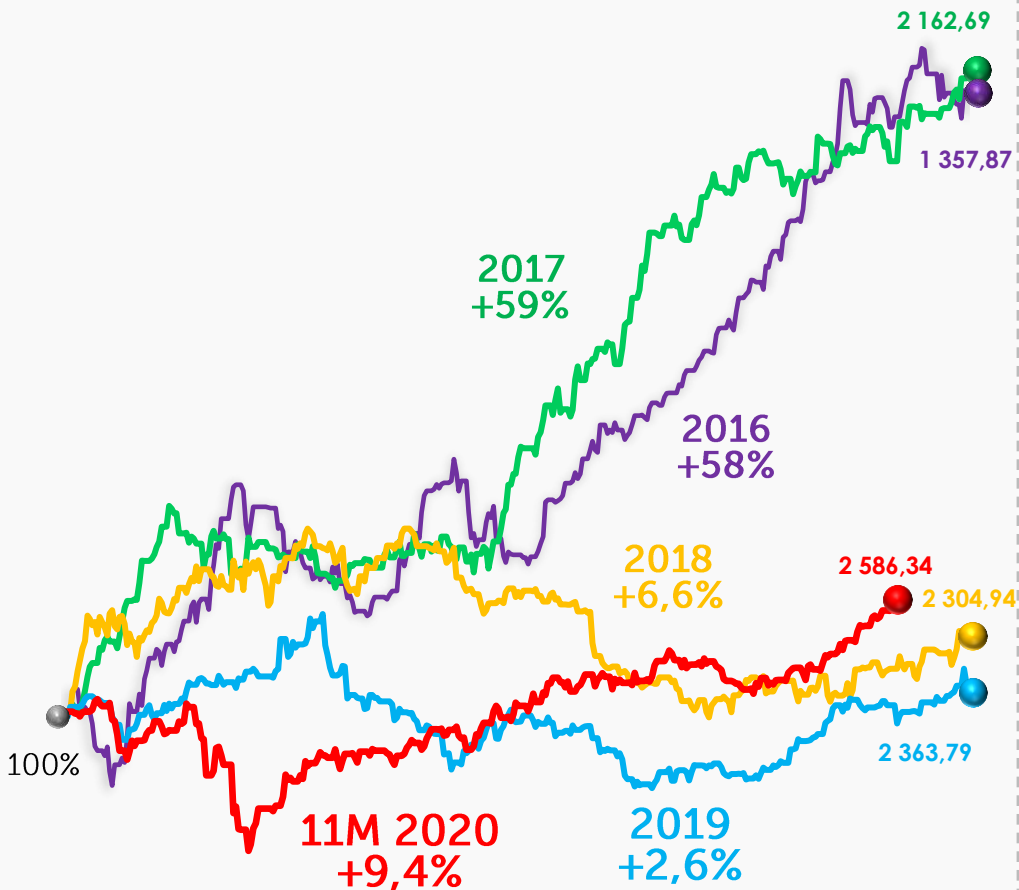
фев. мар. апр. май. июн. июл. авг. сен. окт. ноя. дек. январь. фев. мар. апр. май. июн. июл. авг. сен. окт. ноя. 2019 2019 2019 2019 2019 2019 2019 2019 2019 2019 2019 2020 2020 2020 2020 2020 2020 2020 2020 2020 2020 2020

* от общего брутто-оборота торгов акциями на вторичном рынке

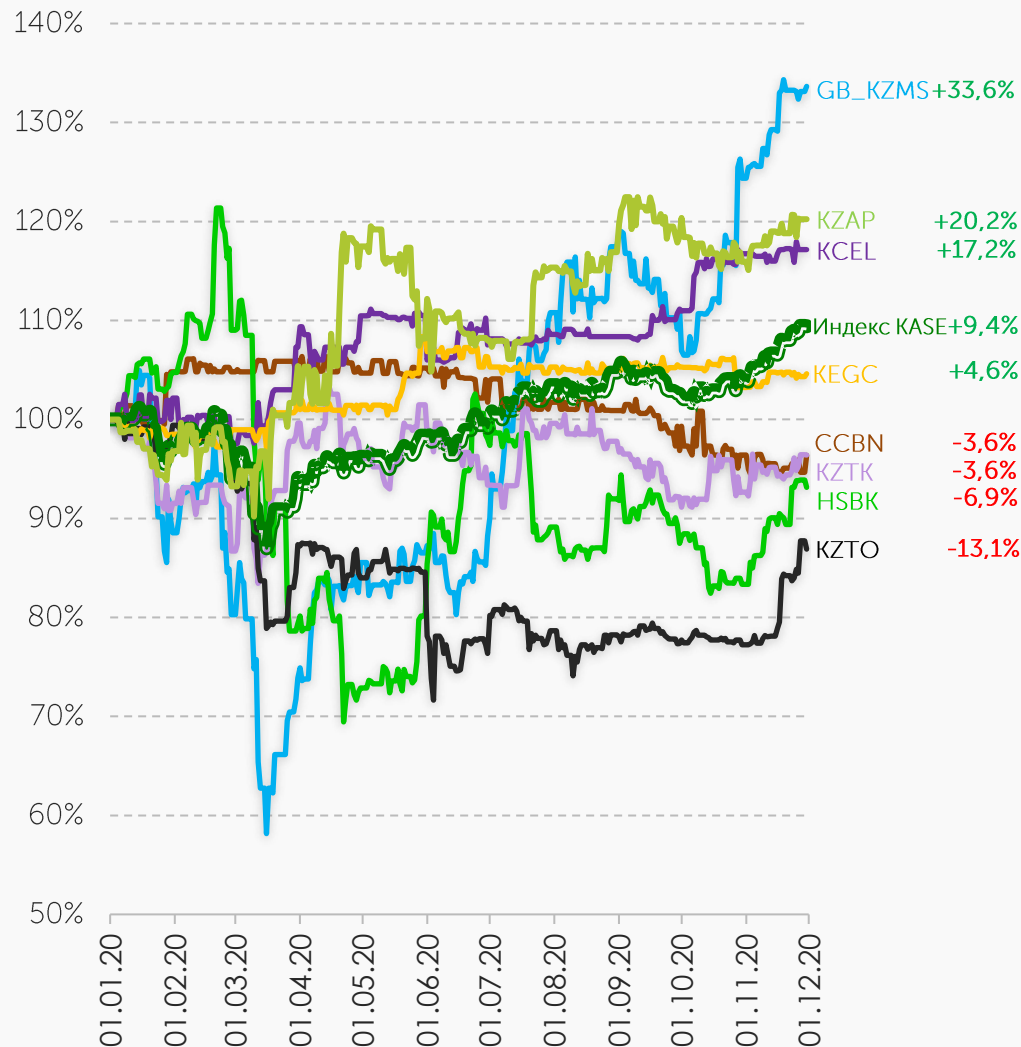
Источник: KASE

Динамика Индекса KASE

Индекс KASE в 2016 – 11М 2020

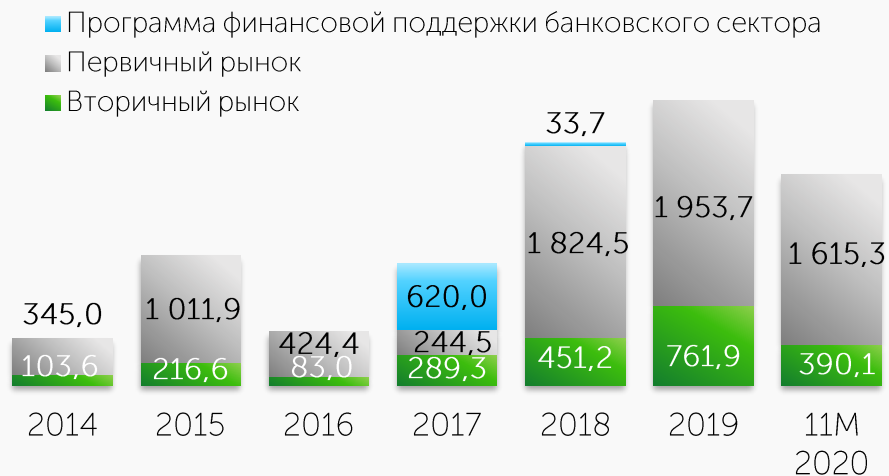


Динамика составляющих Индекса KASE

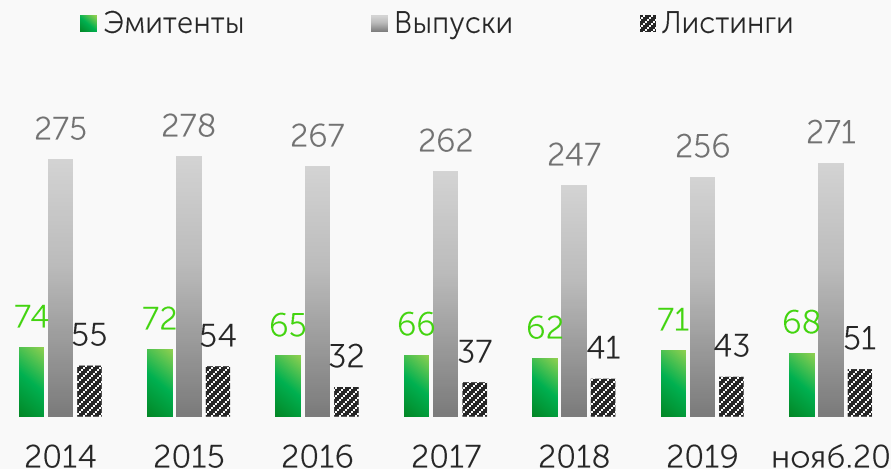


Рынок корпоративных облигаций

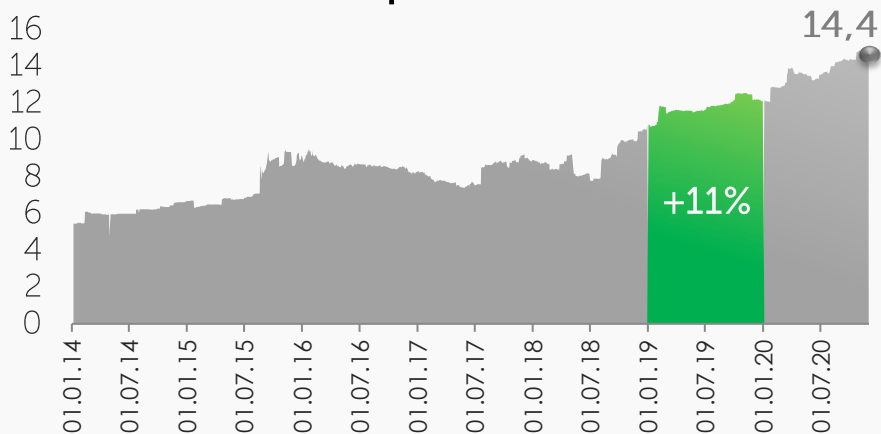
Объем сделок, млрд KZT



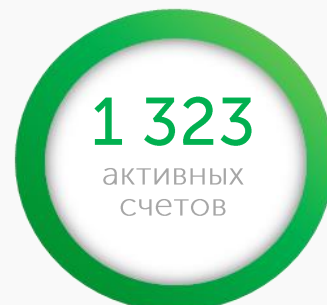
Новые листинги



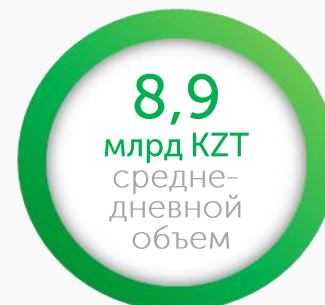
Объем корпоративного долга в обращении, трлн KZT



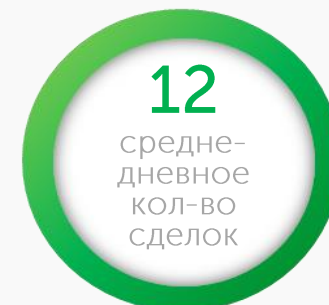
Основные показатели за 11М 2020 года



+63,5%
к 11М 2019 года

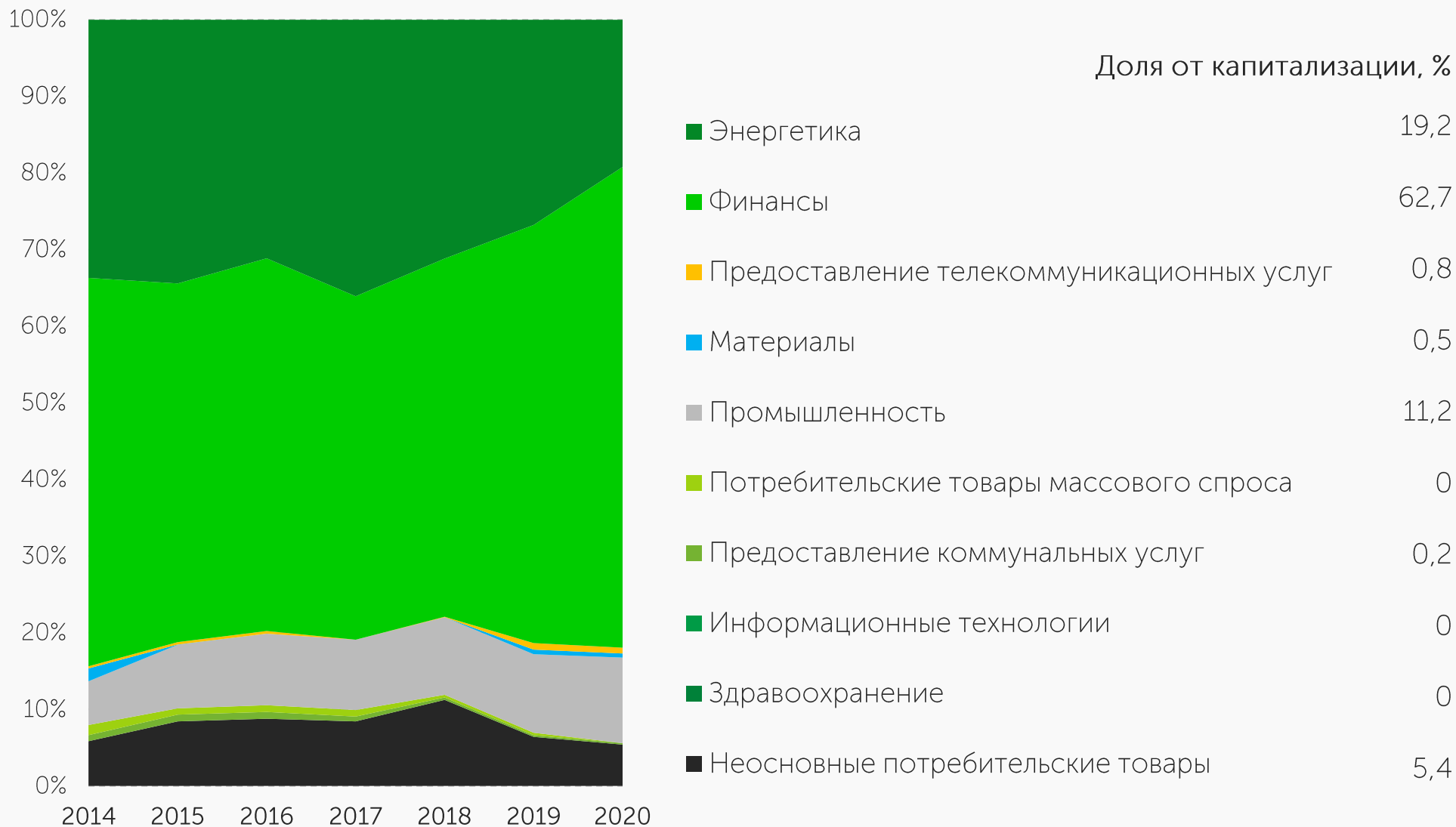


-22,8%
к 11М 2019 года



+13,9%
к 11М 2019 года

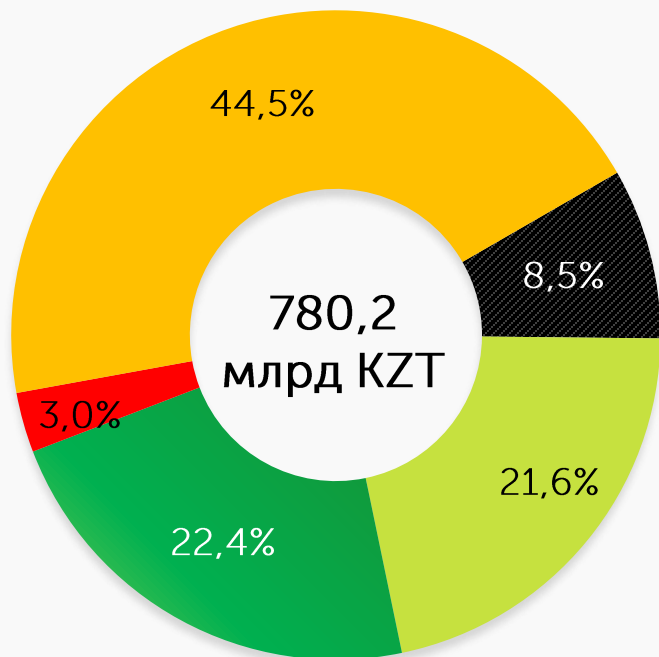
Отраслевая структура списков облигаций KASE



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

Инвесторская база рынка корпоративных облигаций KASE

Доли основных категорий инвесторов на вторичном рынке за 11М 2020 год*



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

Доля нерезидентов в брутто-обороте, %

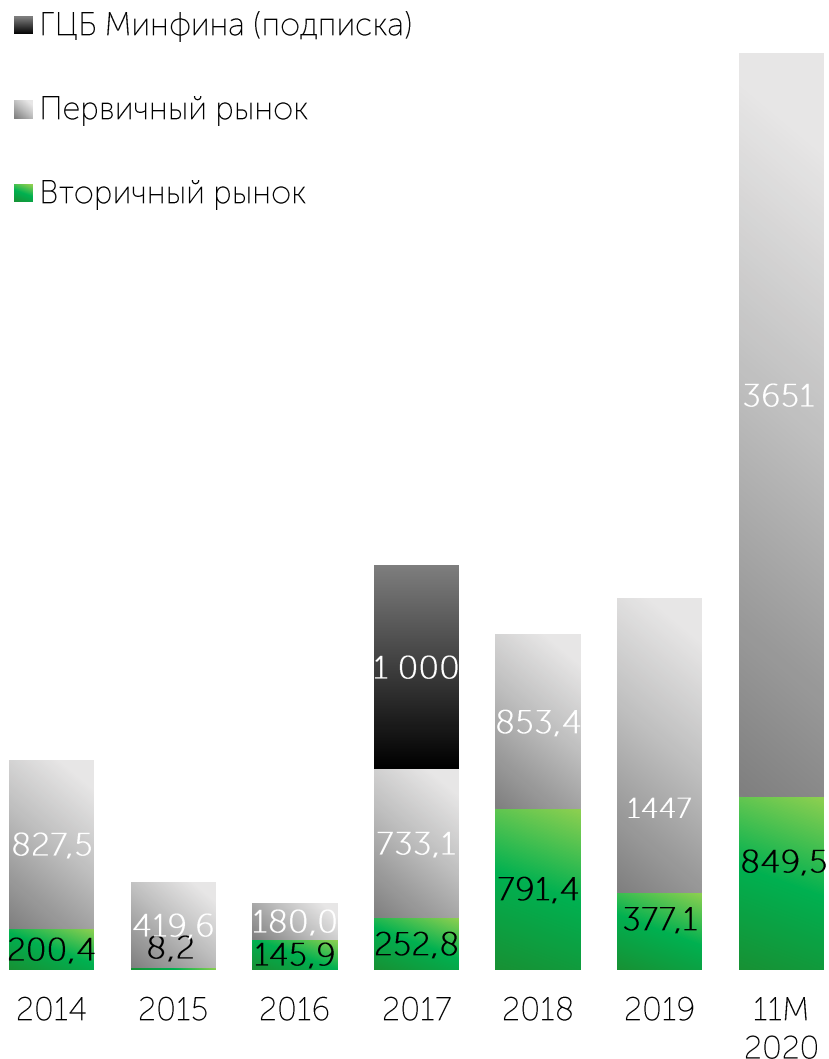


Динамика активных счетов на рынке корпоративных облигаций

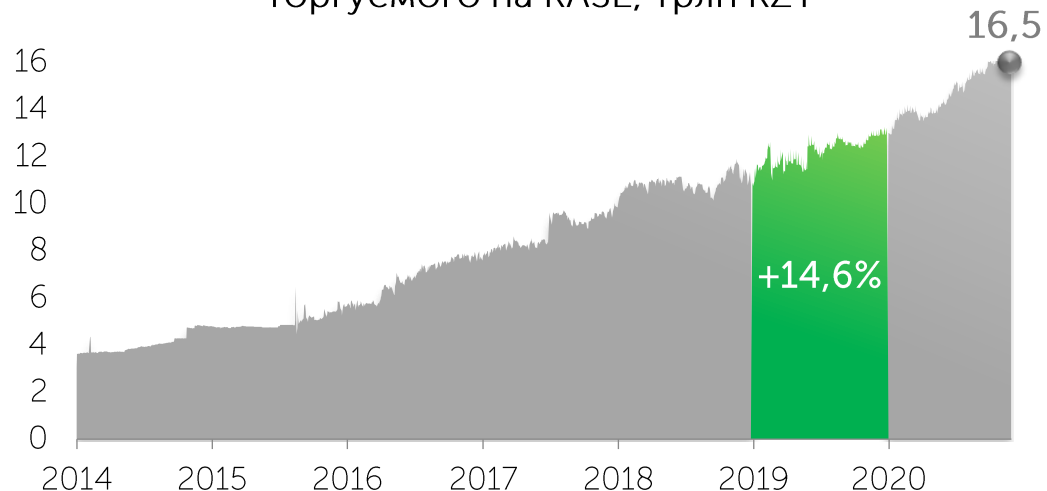


* от общего брутто-оборота торгов корпоративными облигациями на вторичном рынке

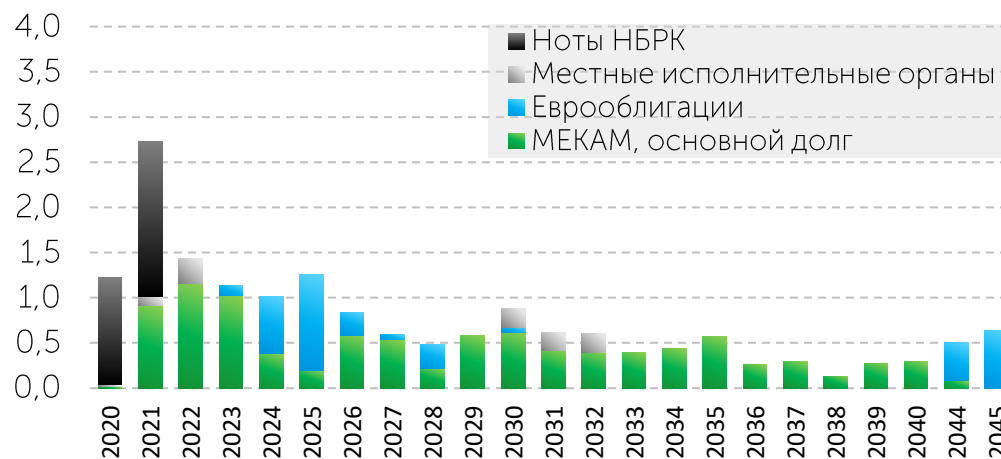
Динамика объема торгов, млрд KZT



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

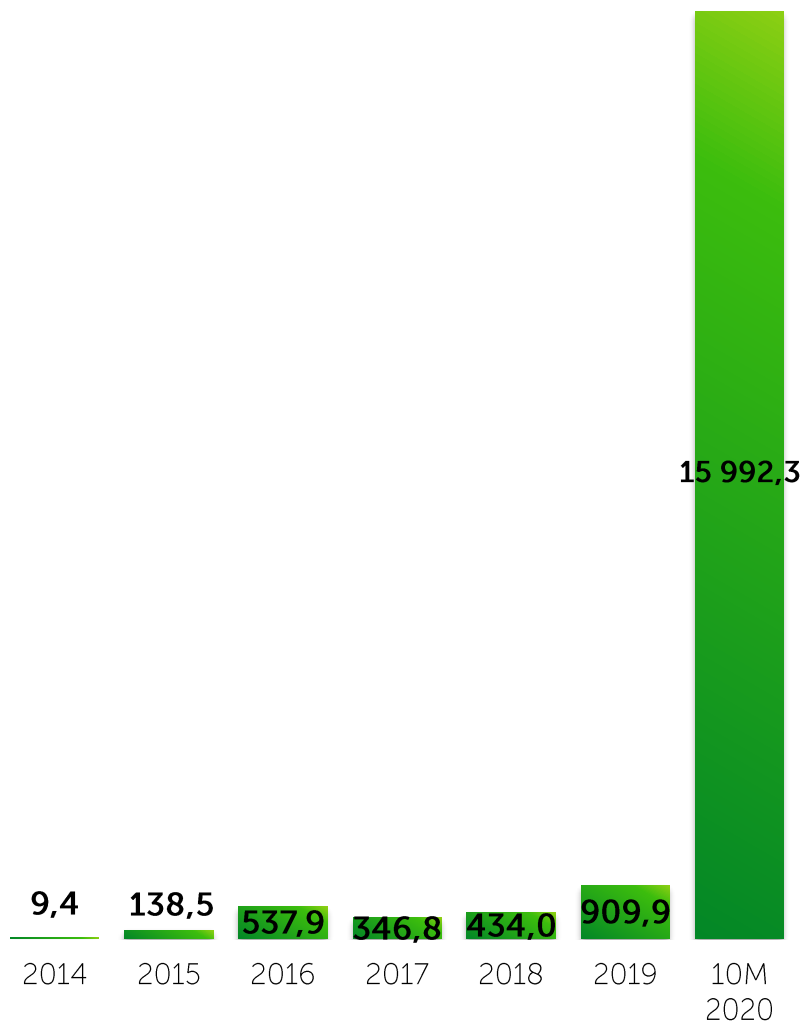


Динамика выплат по госдолгу, трлн KZT



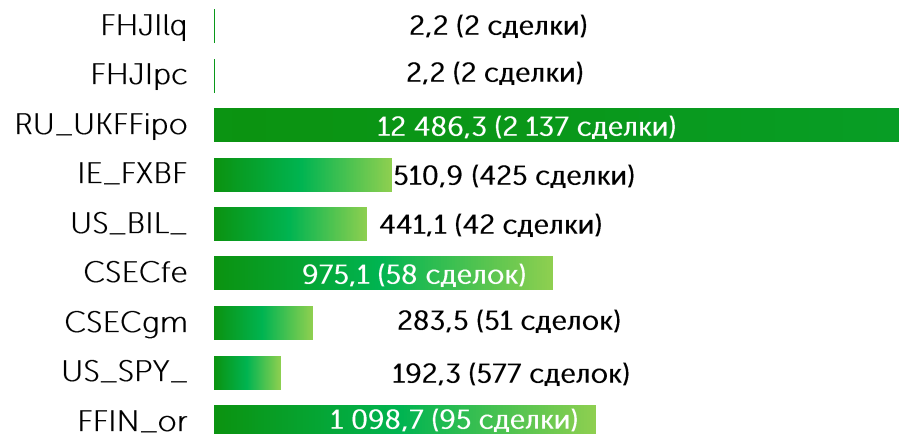
Источник: KASE

Объем сделок, млн KZT

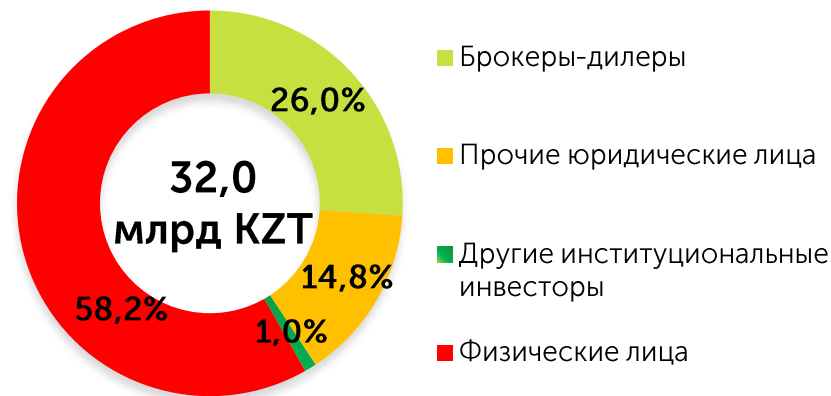


Источник: KASE

Объем торгов в разбивке по инструментам за 11М 2020 года, млн KZT



Доли основных категорий инвесторов за 11М 2020 год*



* от общего брутто-оборота торгов ценными бумагами инвестиционных фондов

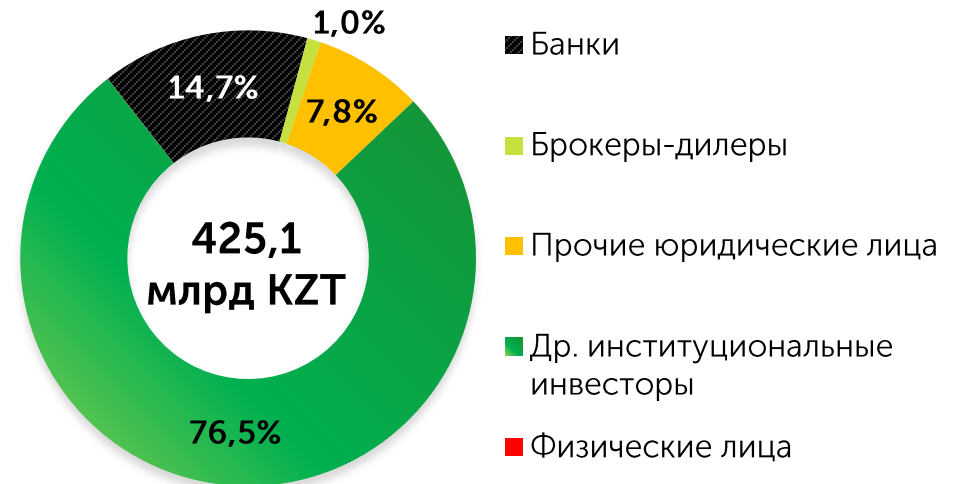
Объемы торгов, млрд KZT



На 01 декабря 2020 года в официальном списке KASE находятся **32 выпуска облигаций 4 организаций**:

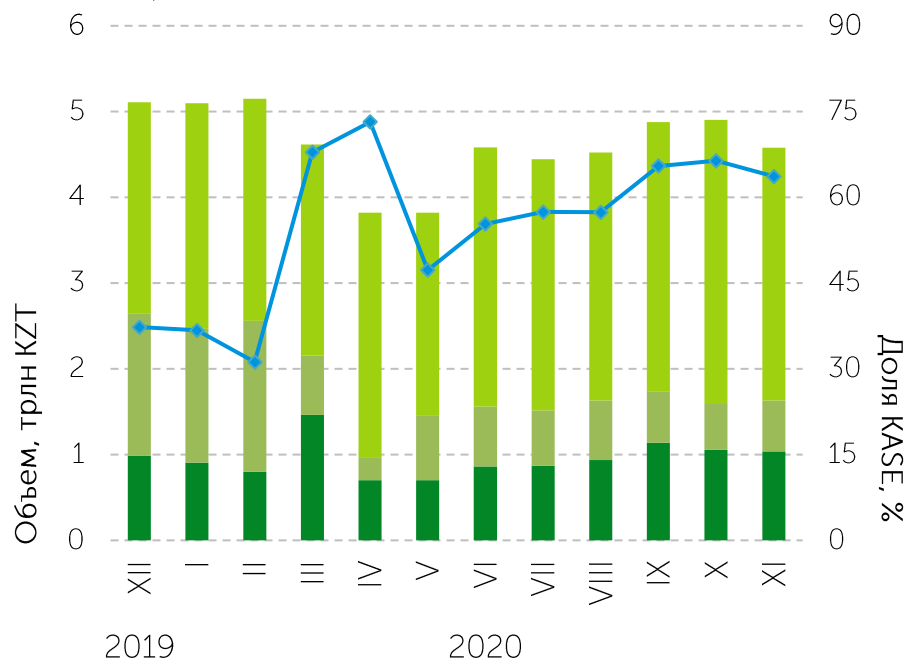
- 11 выпусков Евразийского банка развития
- 11 выпусков Европейского банка реконструкции и развития
- 5 выпусков Международной финансовой корпорации
- 5 выпуска Азиатского банка развития

Доли основных категорий инвесторов за 11М 2020 года*

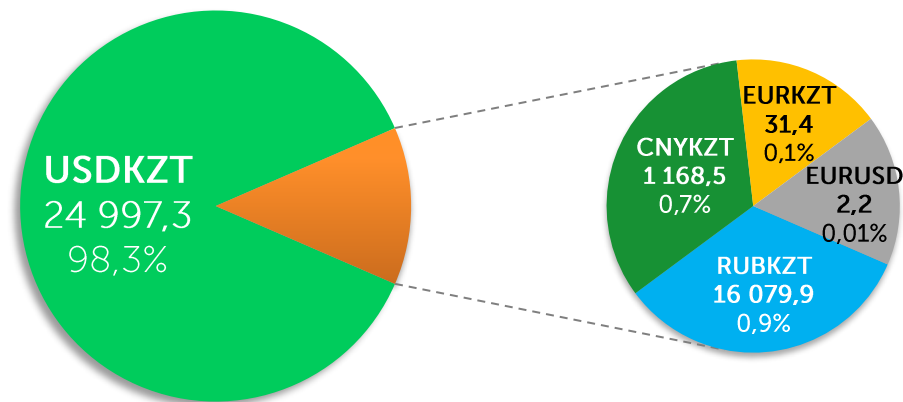


Соотношение биржевых и внебиржевых валютных операций

- 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

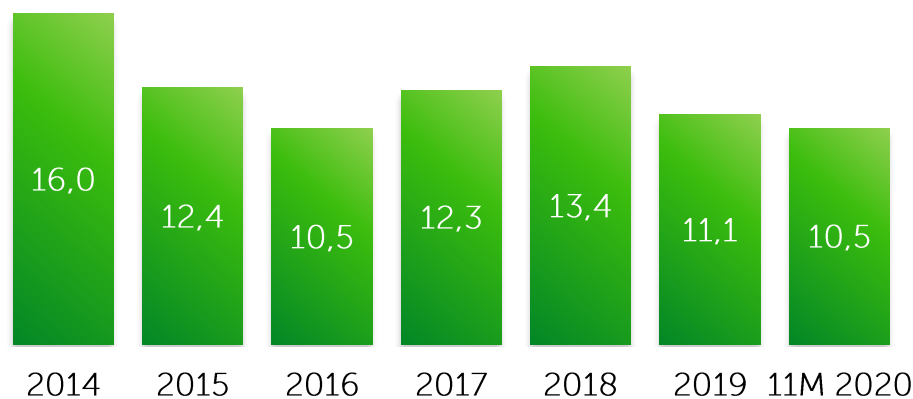


Структура биржевого рынка за 11М 2020 года в объеме торгов. Объем в млн единиц валюты



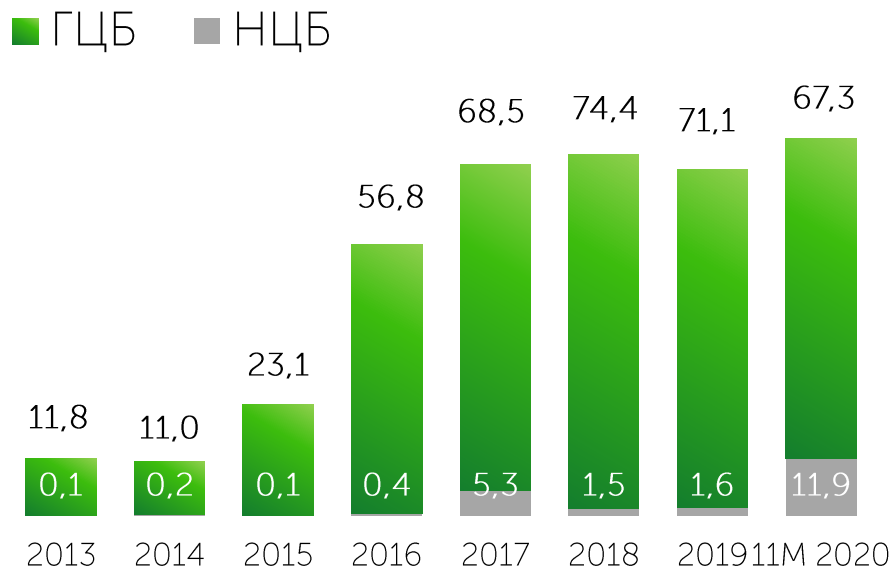
Примечание: доли рассчитаны от объема торгов в KZT

Объем торгов на спот-рынке, трлн KZT



Рынок операций репо

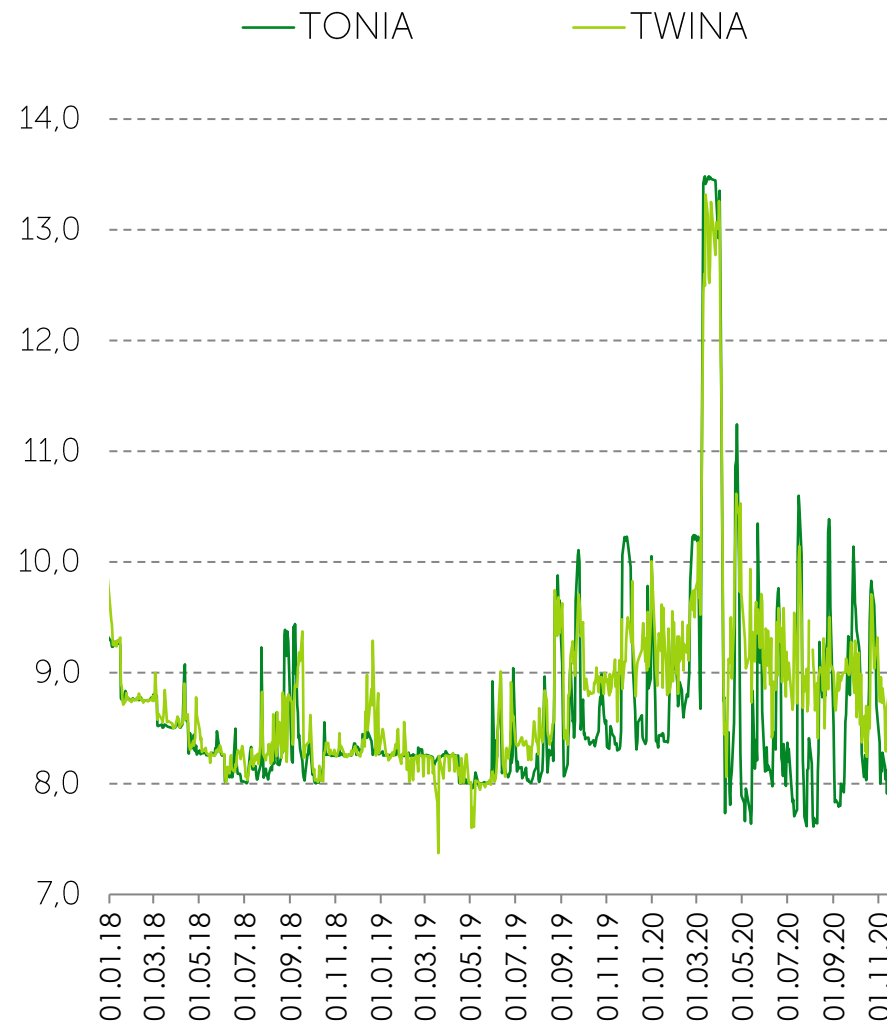
Объем торгов, трлн KZT



Инструменты рынка репо (объем за 11М 2020 / доля):

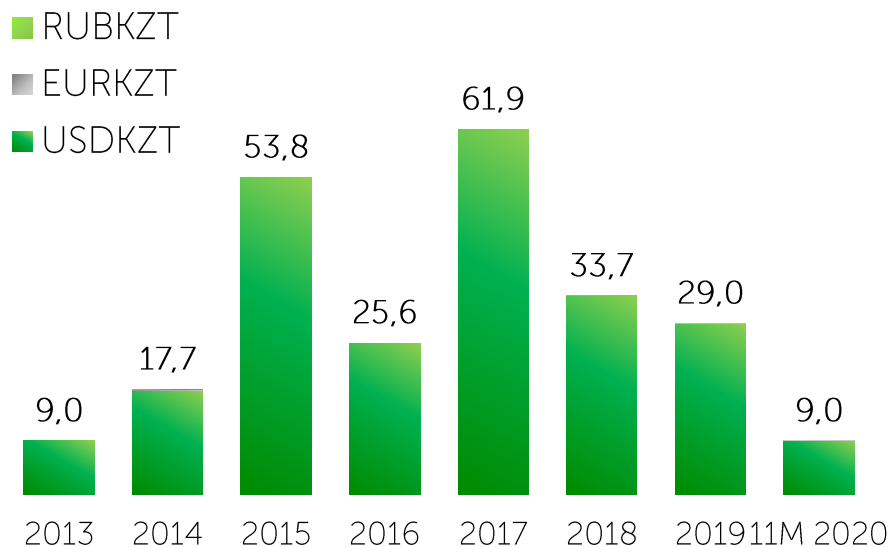
- Авторепо с корзиной ГЦБ (74 926,5 млрд KZT / 94,55 %)
- Авторепо с корзиной НЦБ (24,5 млрд KZT / 0,03 %)
- Авторепо с корзиной ОДГУ (1 785,8 млрд KZT / 2,25 %)
- Авторепо с НЦБ (2 446,9 млрд KZT / 3,09 %)
- Прямое репо с НЦБ (62,3 млрд KZT / 0,08 %)

Индикаторы репо, % годовых



Рынок операций валютного свопа

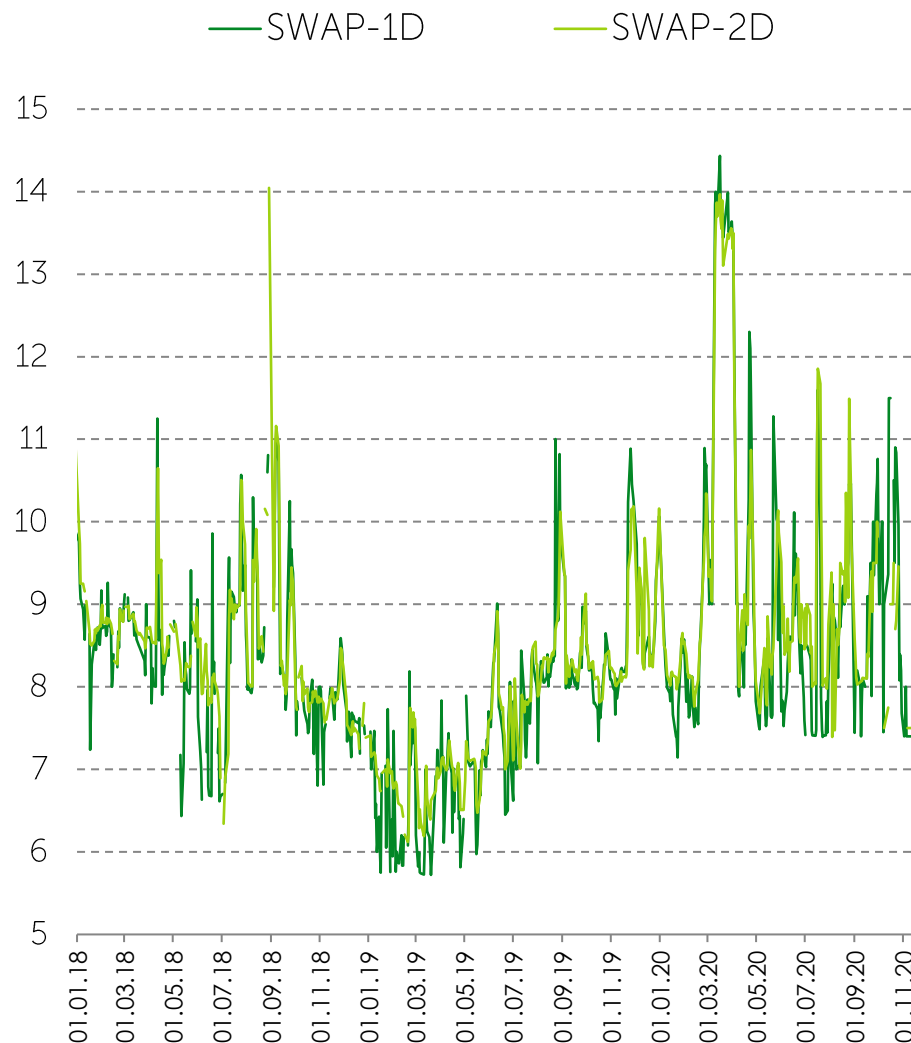
Объем торгов, трлн KZT



Инструменты рынка операций валютного свопа (объем за 11М 2020 / доля):

- USDKZT_0_001 (4 082,5 млрд KZT / 45,3 %)
- **USDKZT_0_002 (4 690,2 млрд KZT / 52,1 %)**
- USDKZT_0_01W (20,3 млрд KZT / 0,2 %)
- USDKZT_0_01M (213,0 млрд KZT / 2,4 %)
- EURKZT_0_001 (0,1 млрд KZT / <0,1 %)

Индикаторы своп-рынка, % годовых



Спасибо за внимание!

-  Kazakhstan Stock Exchange
-  kase_kz
-  Kazakhstan.stock.exchange
-  Казахстанская фондовая биржа KASE

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