



Қазақстан қор биржасы
Казахстанская фондовая биржа
Kazakhstan Stock Exchange

Типовая презентация

на 01 сентября 2021 года



АО "Казахстанская фондовая биржа"

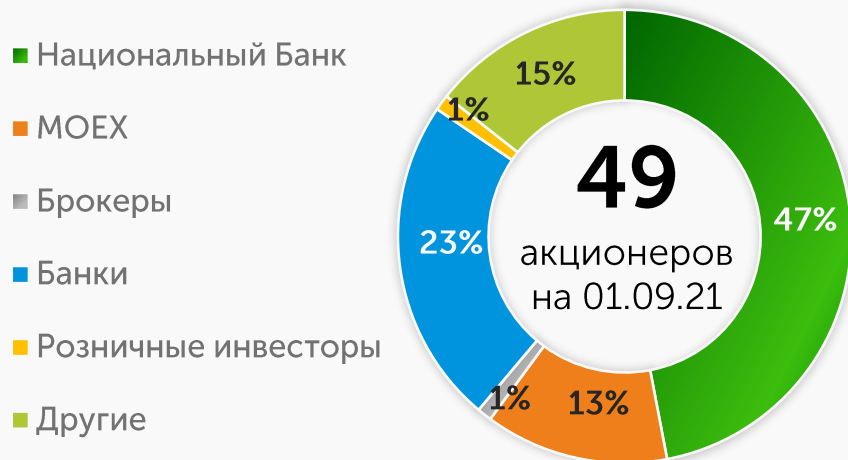
47,0% - НБРК

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



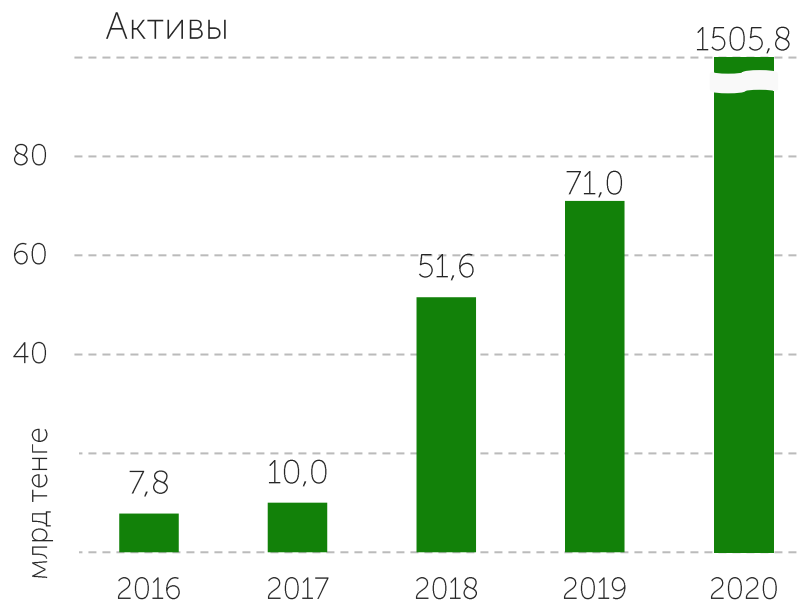
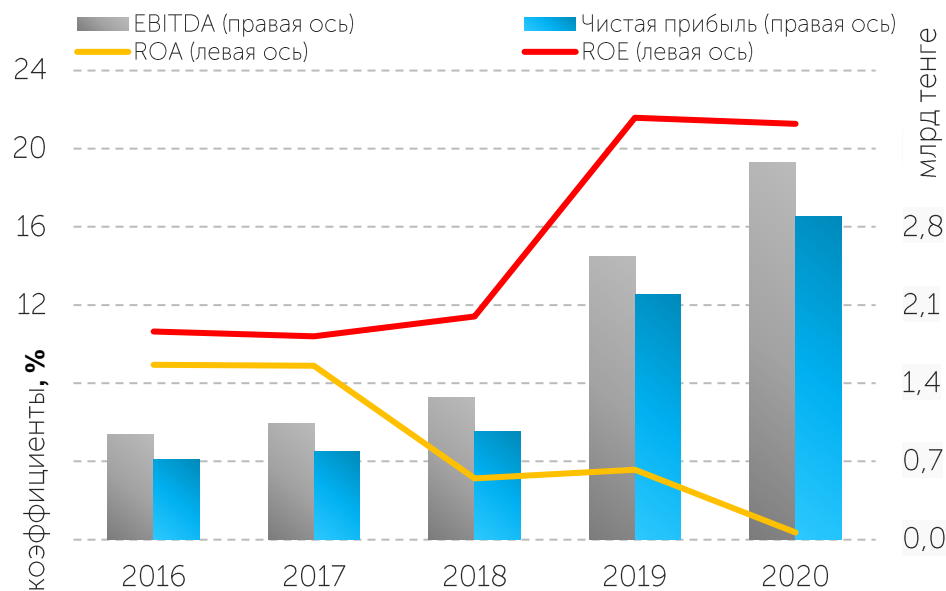
Акции и капитал KASE

На 01 июля 2021 года:

| | |
|------------------------------|------------------|
| собственный капитал | 17 711,3 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 | 16 472,1 KZT |

Показатели доходности KASE

| | Активы, млн KZT | Чистая прибыль, млн KZT | Доходность активов, % | Доходность капитала, % |
|------|--------------------|----------------------------|--------------------------|---------------------------|
| 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 |
| 2016 | 7 809,0 | 721,8 | 8,9 | 10,7 |



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

41

Фондовая

31

Валютная

24

Деривативы

50

всего участников рынка

23

банков второго уровня (из 23)
резиденты РК

20

брокерских компаний (из 20)
резиденты РК

45

локальных участников

3

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

2

МФО (Межгосударственный банк,
Евразийский банк развития)

12

участников, предоставляющих
услуги прямого доступа (DMA)

Новые члены KASE:

2021

- АО "Райффайзенбанк" / валютная
- АО "First Heartland Securities" / деривативы

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

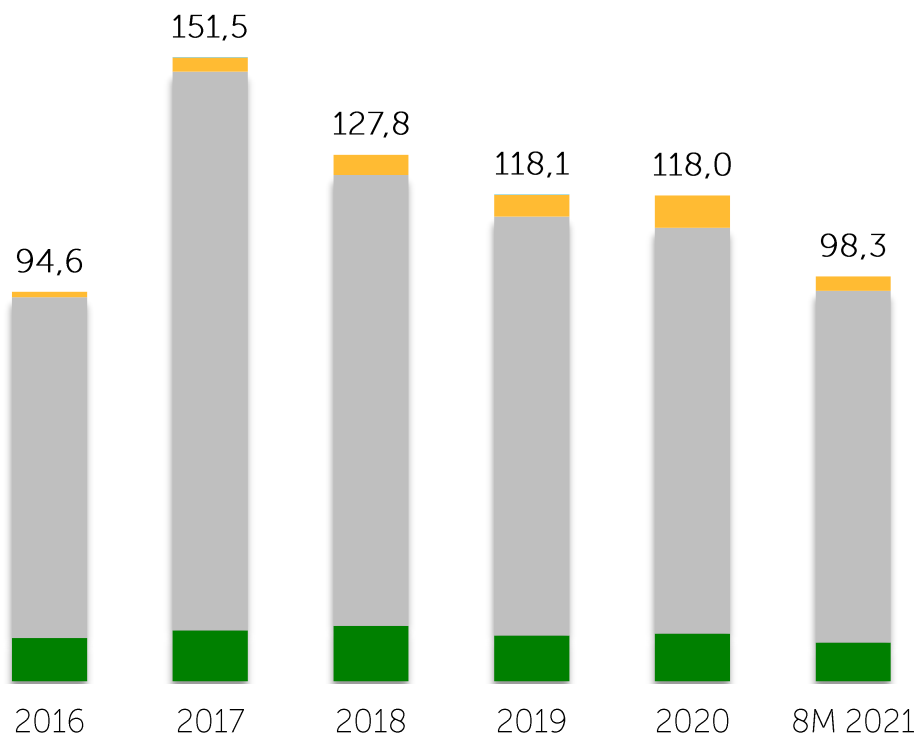
Показатели биржевого рынка за восемь месяцев 2021 года

| 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 | 3 562,9 | 8 407,6 | 1 739 | 22 268,3 | 12,8 |
| Акции | 100,3 | 236,4 | 1 609 | 626,6 | 0,4 |
| Корпоративные долговые ЦБ | 1 105,7 | 2 615,2 | 27 | 6 910,7 | 251,5 |
| ГЦБ | 2 220,0 | 5 231,6 | 9 | 13 875,0 | 1 498,0 |
| Облигации МФО | 70,5 | 166,6 | <1 | 440,4 | 1 067,7 |
| ЦБ инвестиционных фондов | 29,8 | 70,5 | 92 | 186,2 | 2,0 |
| Производные ценные бумаги | 36,7 | 87,3 | 1 | 229,2 | 356,1 |
| Рынок иностранных валют | 9 442,5 | 22 225,8 | 406 | 59 015,7 | 145,5 |
| Рынок денег | 85 335,6 | 201 086,0 | 498 | 533 347,7 | 1 072,0 |
| Операций репо | 78 445,8 | 184 825,2 | 486 | 490 286,2 | 1 008,3 |
| Операций валютного свопа | 6 889,8 | 16 260,8 | 11 | 43 061,5 | 3 825,6 |
| Деривативы | <0,1 | <0,1 | <1 | <0,1 | 0,2 |
| Итого | 98 341,1 | 231 719,3 | 2 642 | 614 631,7 | 232,6 |

Объем и структура рынка

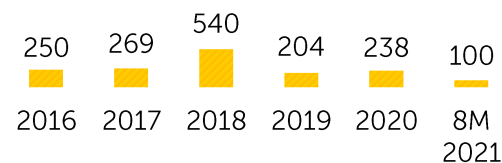


Динамика объема торгов по секторам, трлн KZT



Рынок акций

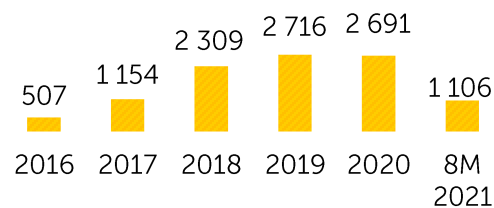
млрд KZT



| | |
|------|--------|
| 2020 | +17,0% |
| 2019 | -62% |
| 2018 | x2 |
| 2017 | +7,7% |
| 2016 | -72% |

Рынок корпоративных облигаций

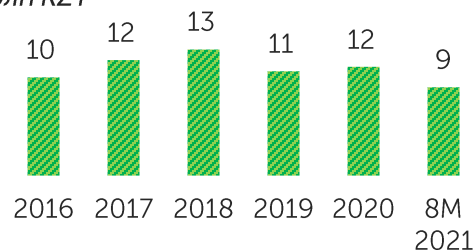
млрд KZT



| | |
|------|-------|
| 2020 | -1% |
| 2019 | +18% |
| 2018 | x2 |
| 2017 | +127% |
| 2016 | -59% |

Рынок иностранных валют

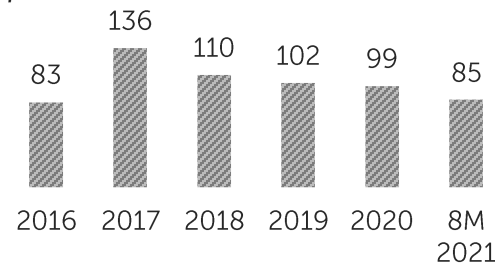
трлн KZT



| | |
|------|------|
| 2020 | +4% |
| 2019 | -17% |
| 2018 | +9% |
| 2017 | +18% |
| 2016 | -84% |

Рынок денег

трлн KZT

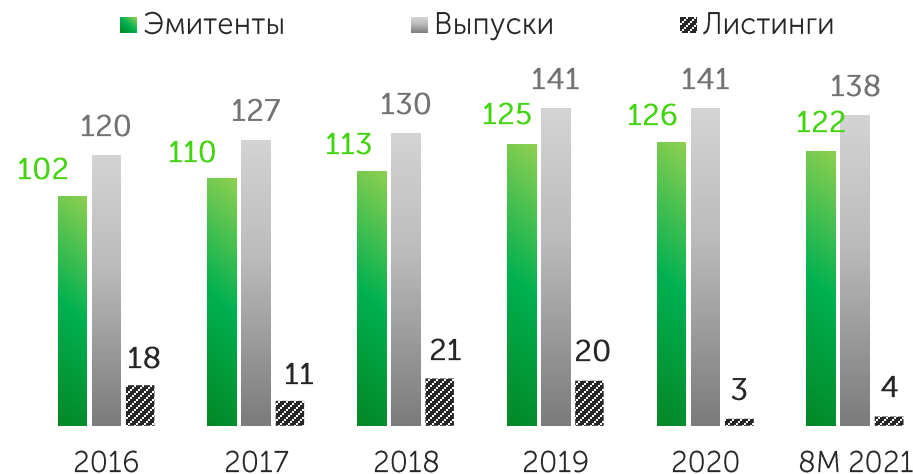


| | |
|------|------|
| 2020 | +3% |
| 2019 | -7% |
| 2018 | -19% |
| 2017 | +64% |
| 2016 | +8% |

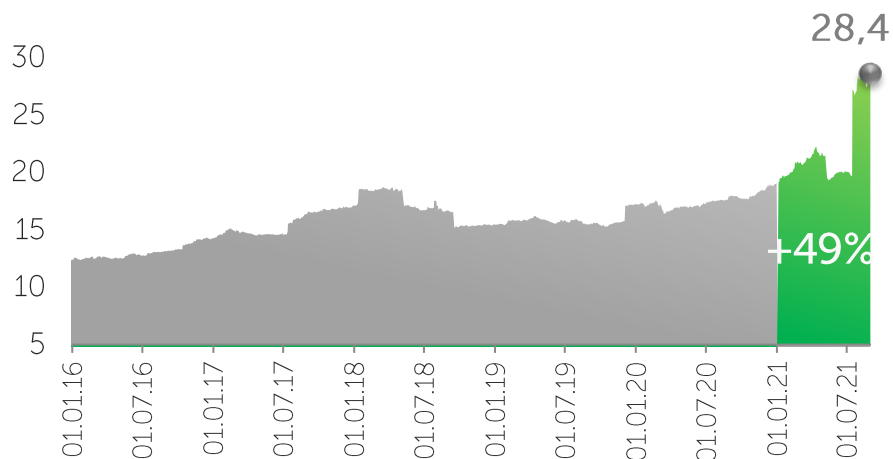
Объем сделок, млрд KZT



Новые листинги



Капитализация рынка акций, трлн KZT

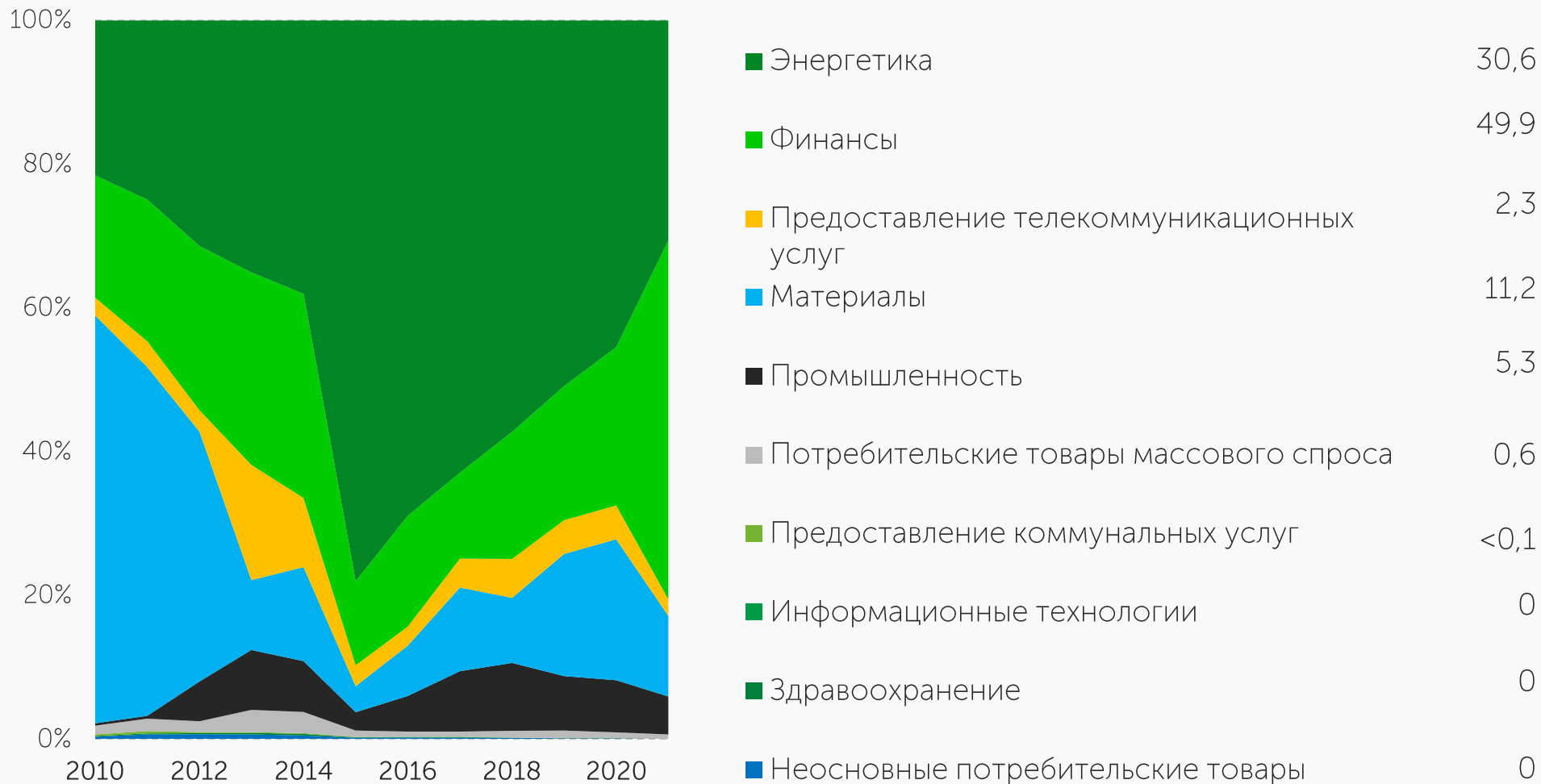


Основные показатели за 8М 2021 года



Отраслевая структура списков акций

Доля от капитализации, %

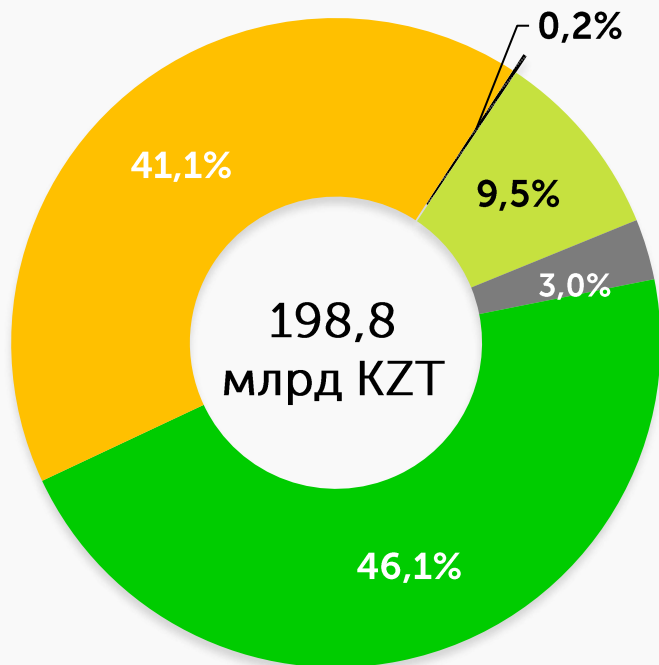


Примечание: в качестве классификатора используется "Global Industry Classification Standard (GICS)®"

Источник: KASE

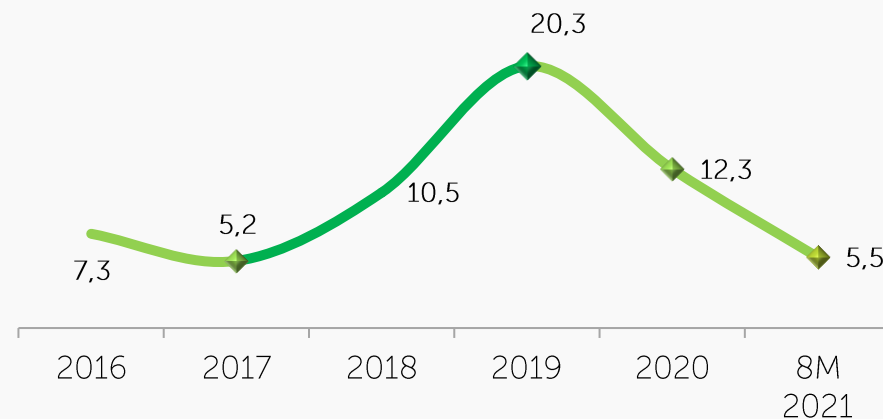
Рынок акций: инвесторская база

Доли основных категорий инвесторов на вторичном рынке за 8М 2021 года*

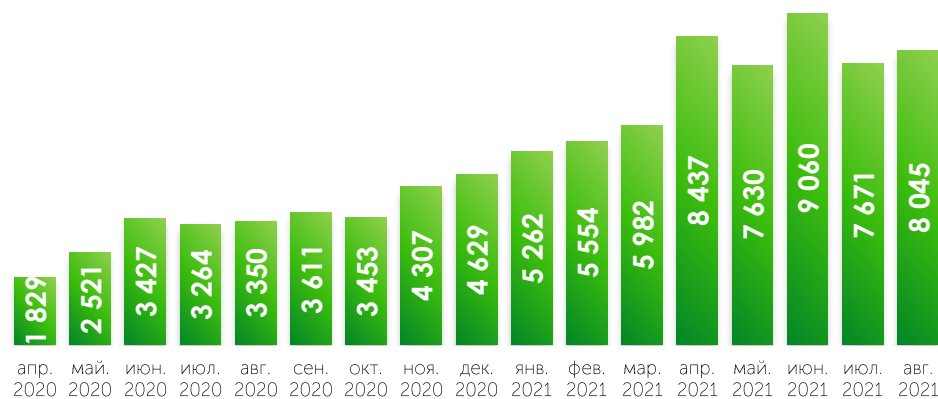


- Банки
- Брокеры-дилеры
- Др. институциональные инвесторы
- Физические лица
- Прочие юридические лица

Доля нерезидентов в брутто-обороте, %



Динамика активных счетов розничных инвесторов на рынке акций

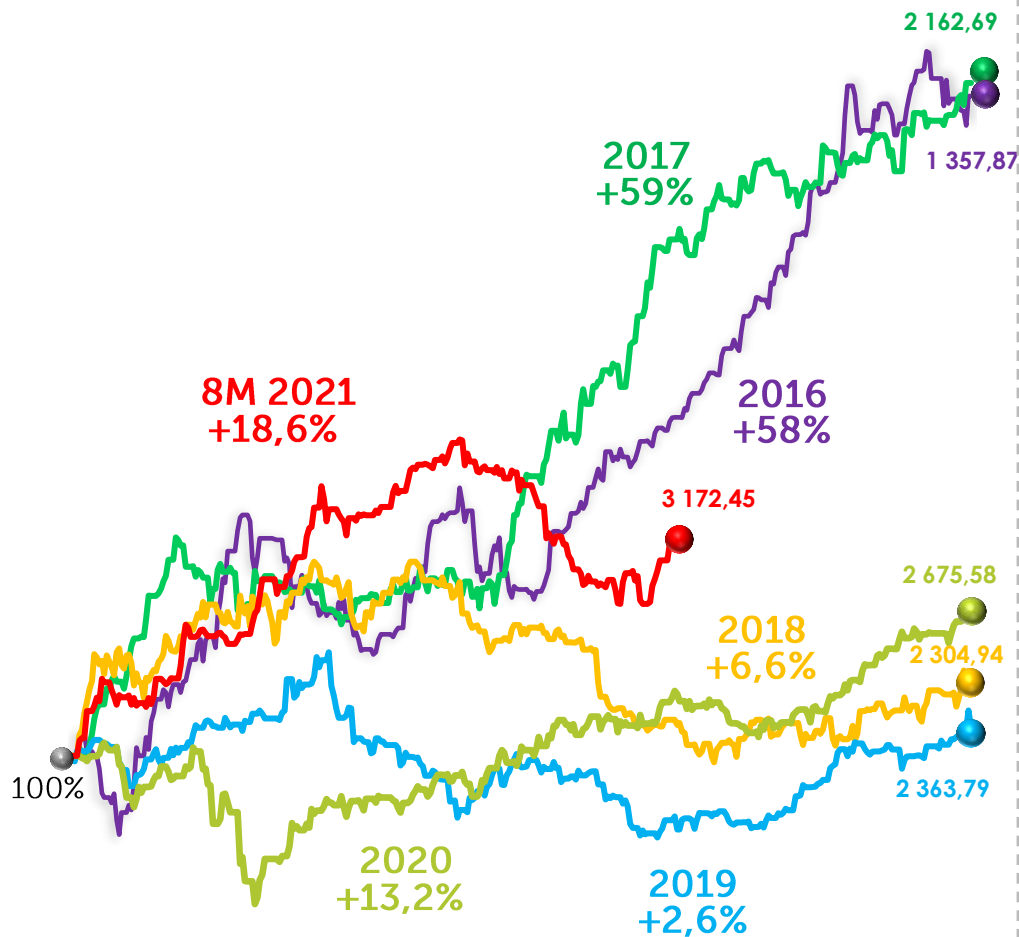


* от общего брутто-оборота торгов акциями на вторичном рынке без учета крупных сделок

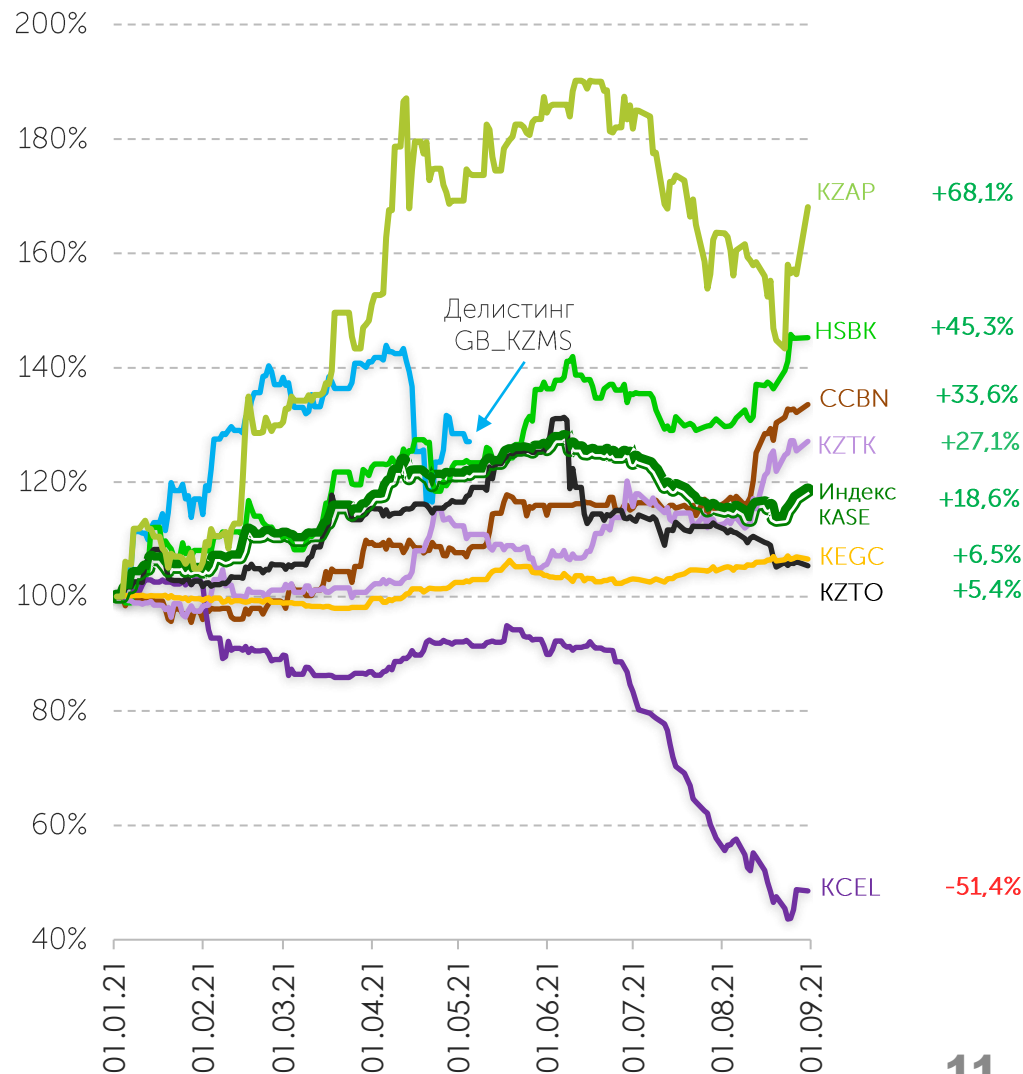
Источник: KASE

Динамика Индекса KASE

Индекс KASE в 2016 – 8М 2021



Динамика составляющих Индекса KASE



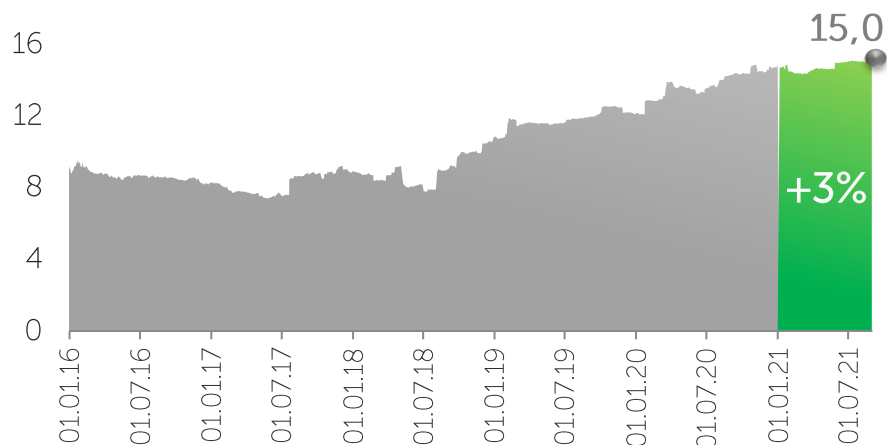
Источник: KASE, Bloomberg

Рынок корпоративных облигаций

Объем сделок, млрд KZT

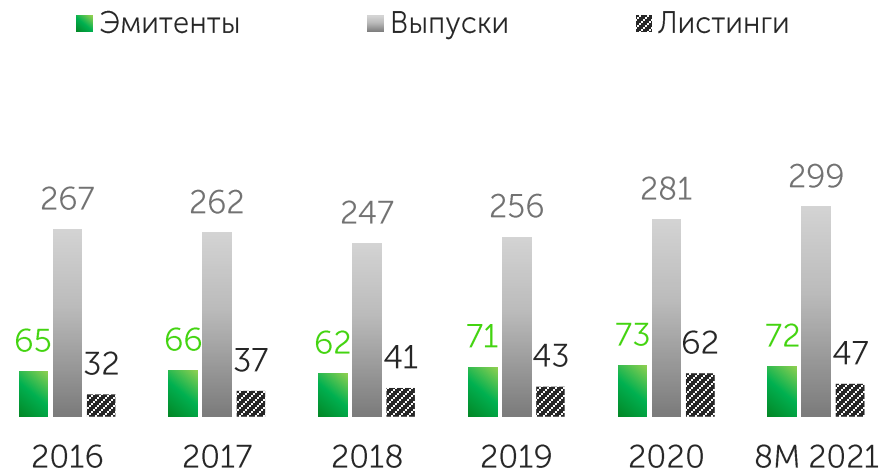


Объем корпоративного долга в обращении, трлн KZT



Источник: KASE

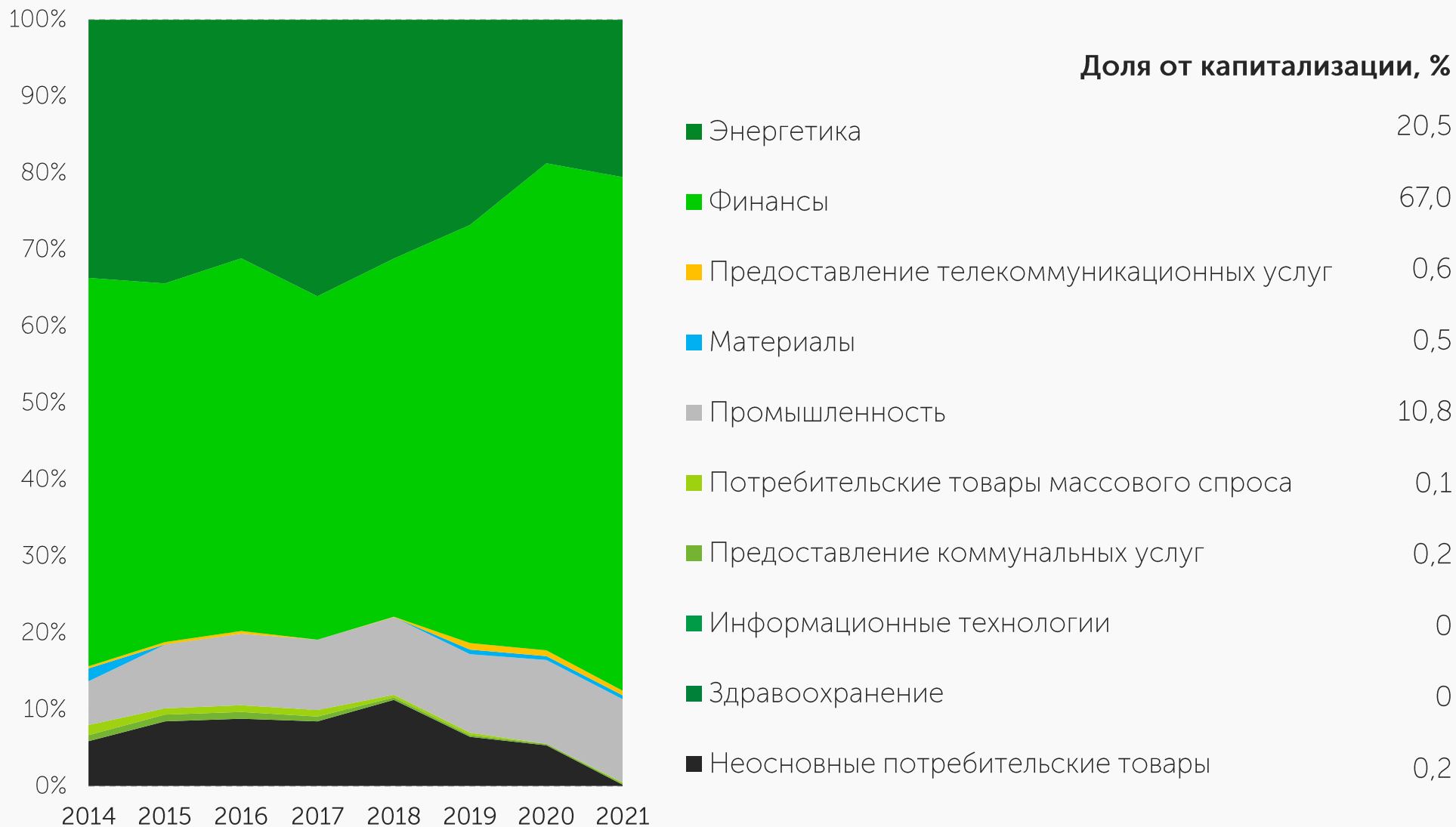
Новые листинги



Основные показатели за 8М 2021 года



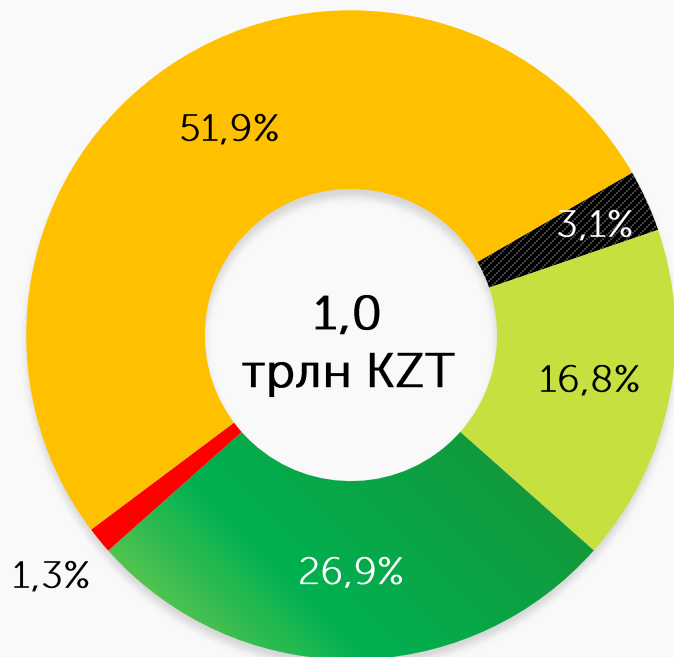
Отраслевая структура списков облигаций KASE



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

Инвесторская база рынка корпоративных облигаций KASE

Доли основных категорий инвесторов на вторичном рынке за 8М 2021 года*

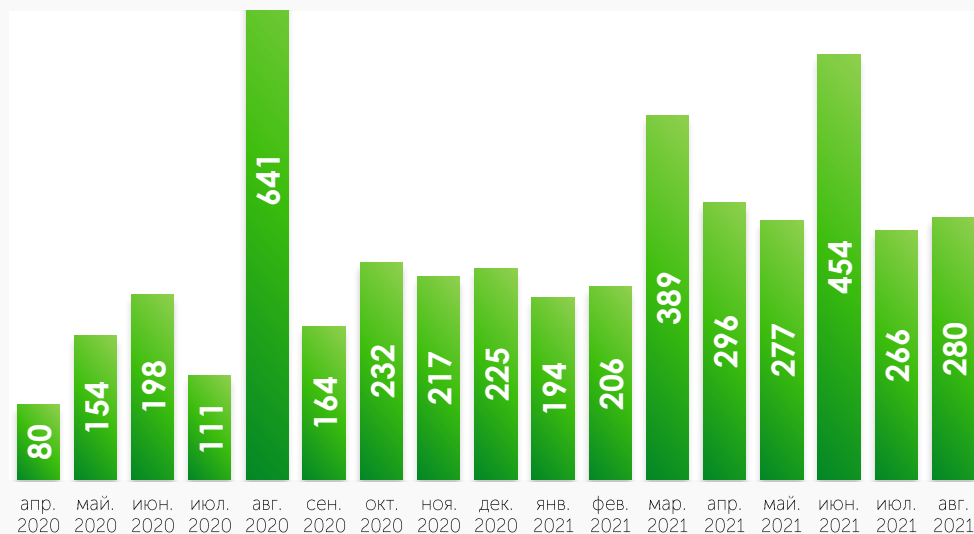


- Банки
- Брокеры-дилеры
- Др. институциональные инвесторы
- Физические лица
- Прочие юридические лица

Доля нерезидентов в брутто-обороте, %

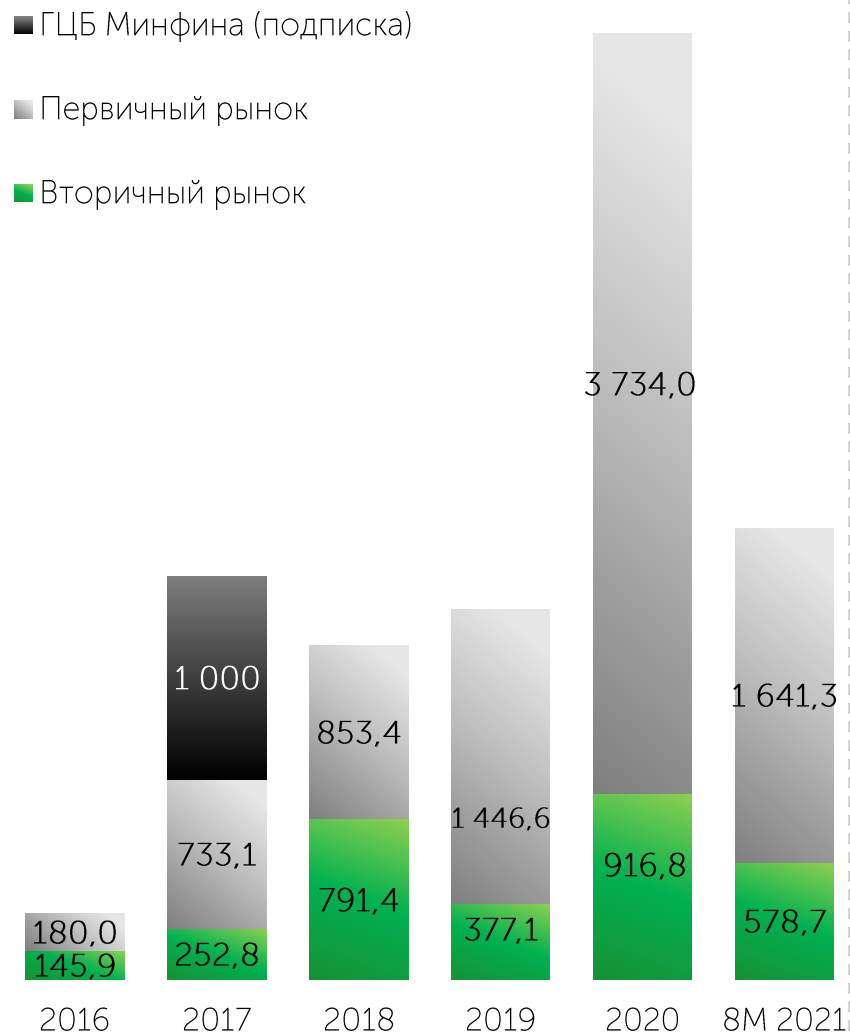


Динамика активных счетов на рынке корпоративных облигаций

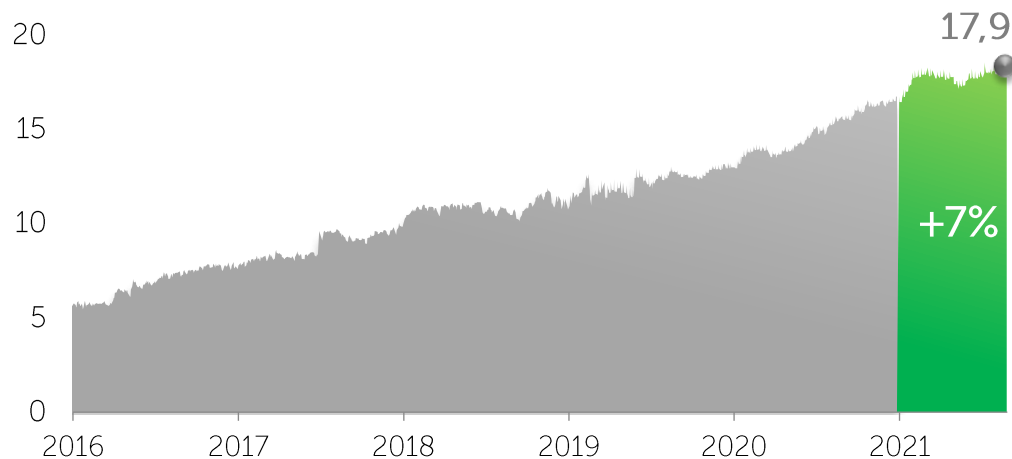


* от общего брутто-оборота торгов корпоративными облигациями на вторичном рынке

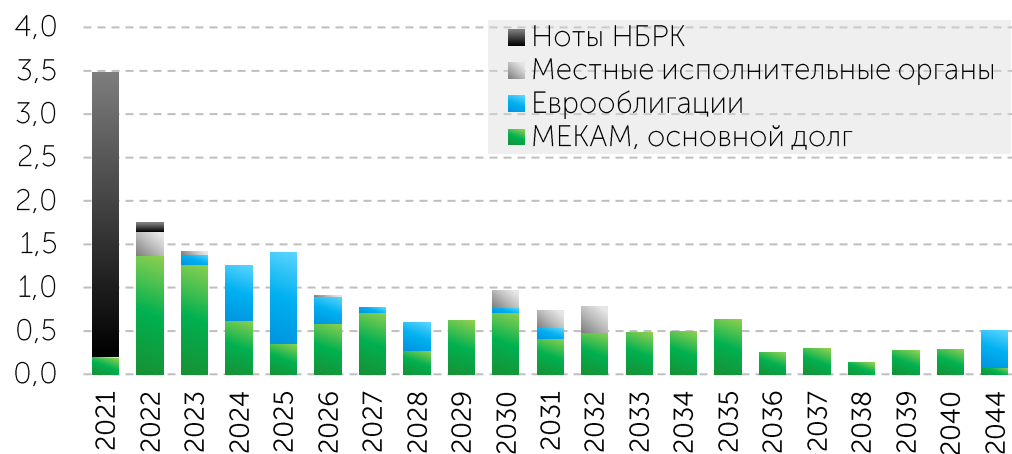
Динамика объема торгов, млрд KZT



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

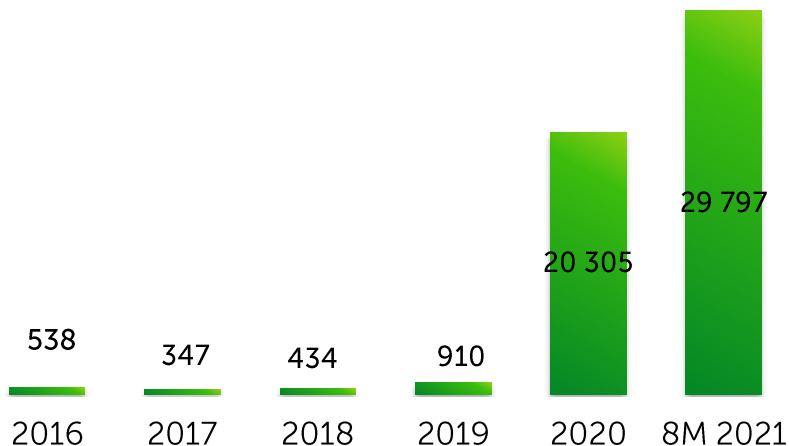


Динамика выплат по госдолгу, трлн KZT

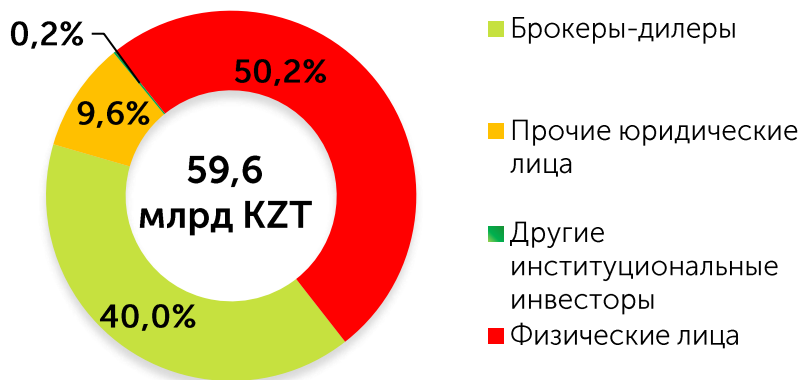


Источник: KASE

Объем сделок, млн KZT



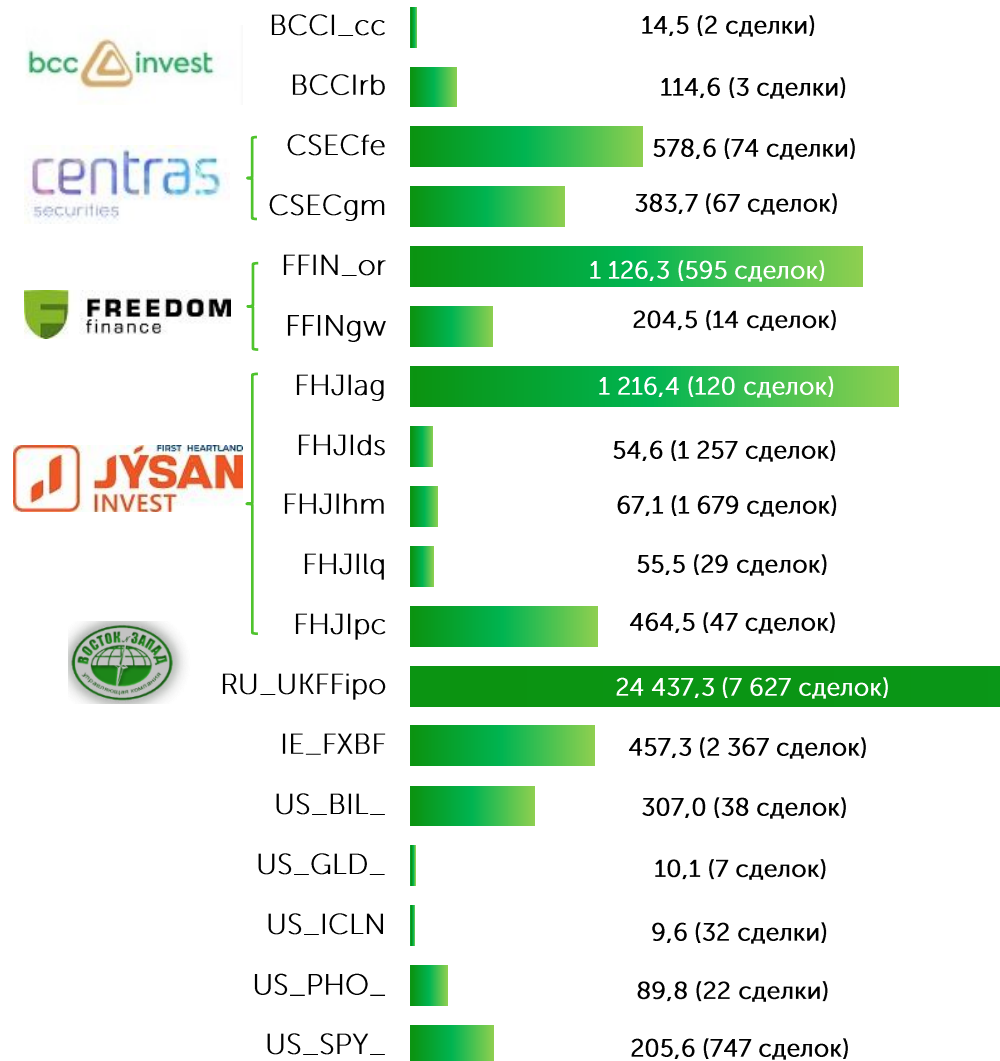
Доли основных категорий инвесторов за 8М 2021 года*



* от общего брутто-оборота торгов ценными бумагами инвестиционных фондов

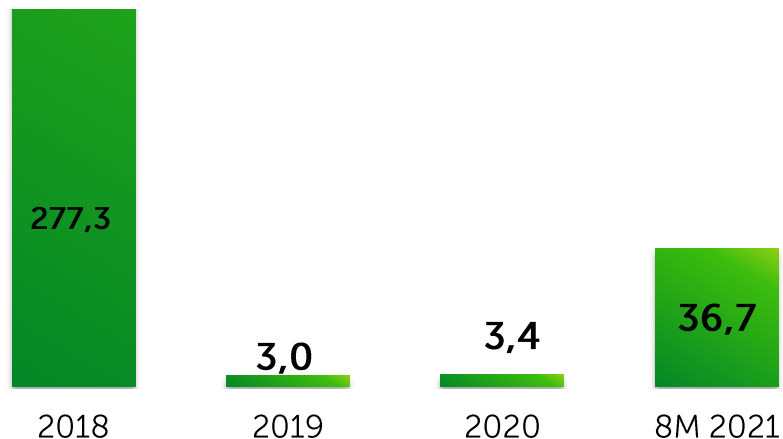
Источник: KASE

Объем торгов в разбивке по инструментам за 8М 2021 года, млн KZT

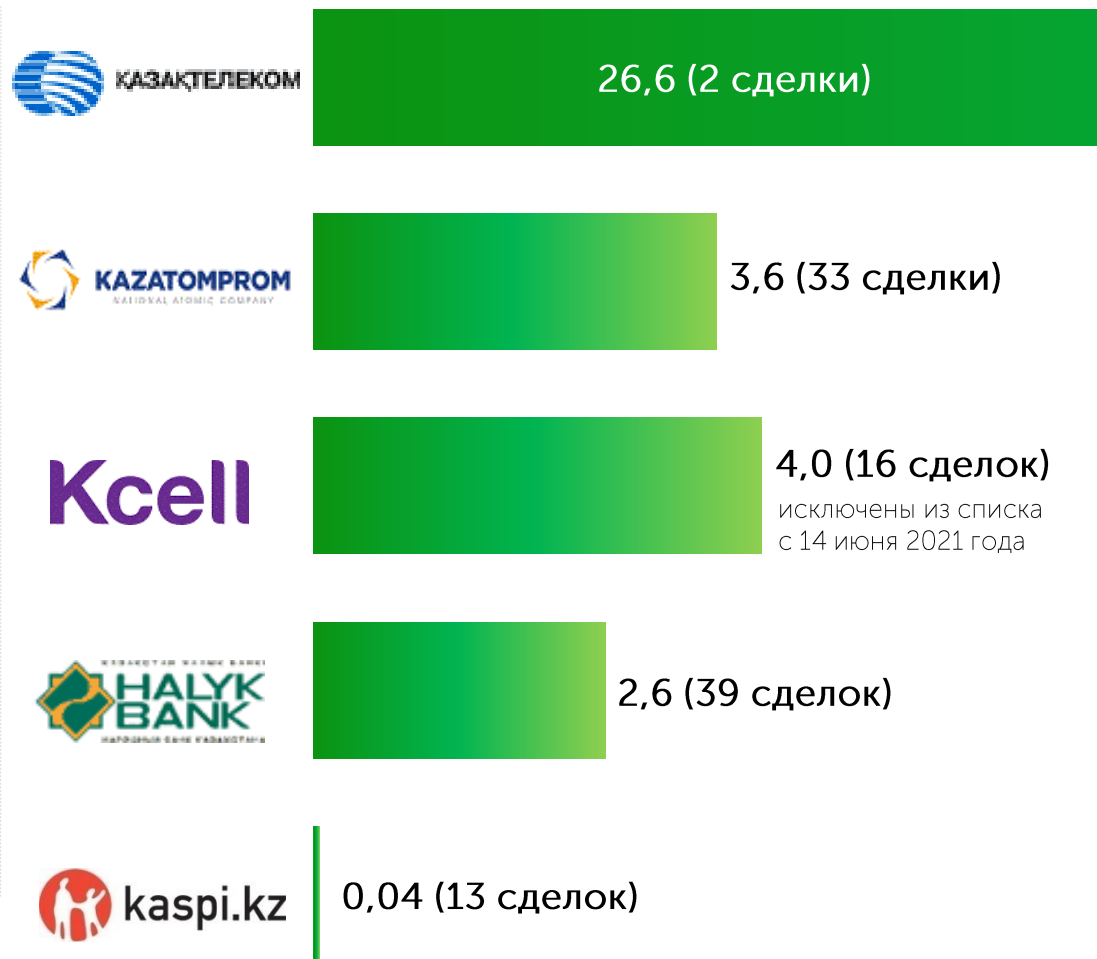


Производные ценные бумаги

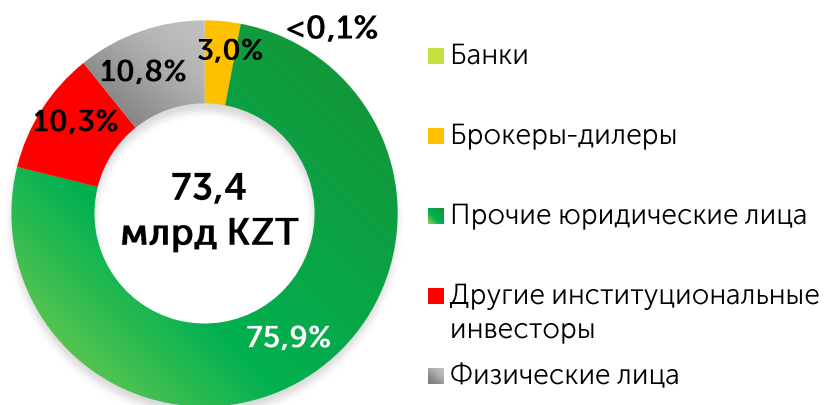
Объем сделок, млрд KZT



Объем торгов в разбивке по инструментам за 8М 2021 года, млрд KZT

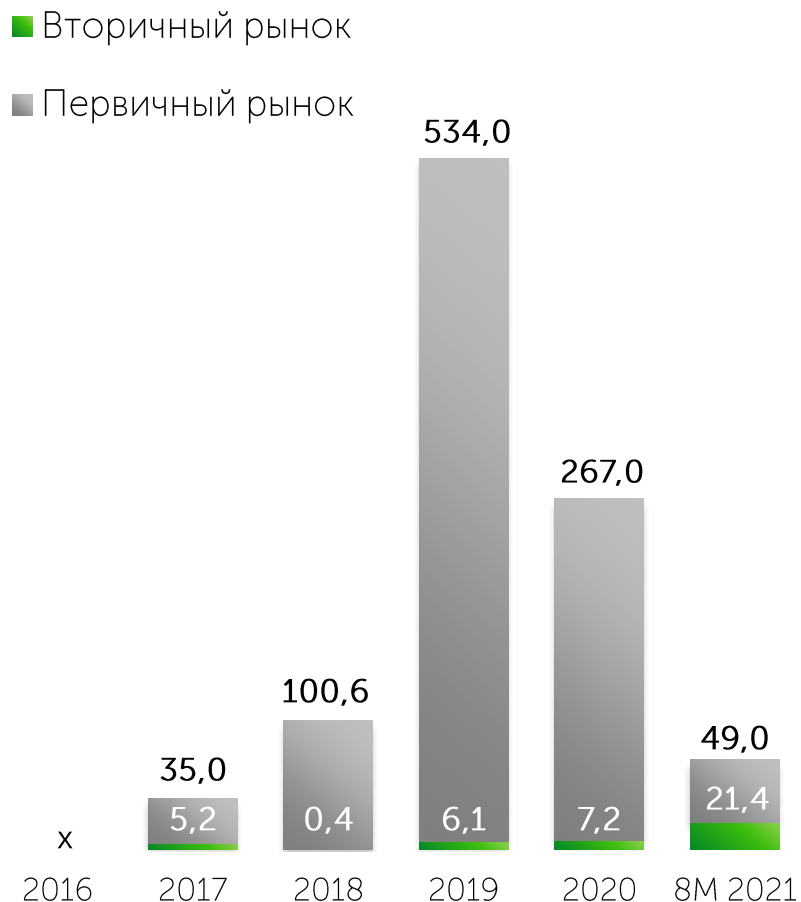


Доли основных категорий инвесторов за 8М 2021 года*



* от общего брутто-оборота торгов производными ценными бумагами

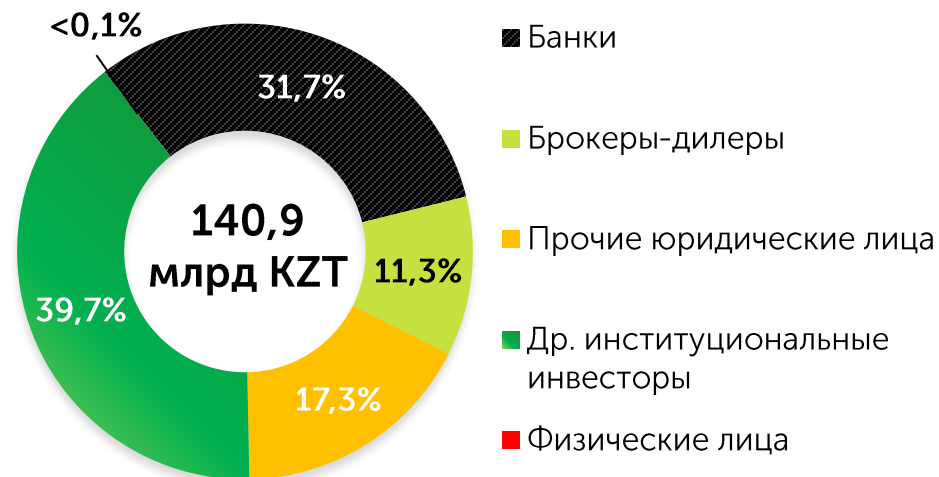
Объемы торгов, млрд KZT



На 01 сентября 2021 года в официальном списке KASE находятся **41 выпуск облигаций 4 организаций:**

- 17 выпусков Евразийского банка развития
- 12 выпусков Европейского банка реконструкции и развития
- 4 выпуска Международной финансовой корпорации
- 8 выпуска Азиатского банка развития

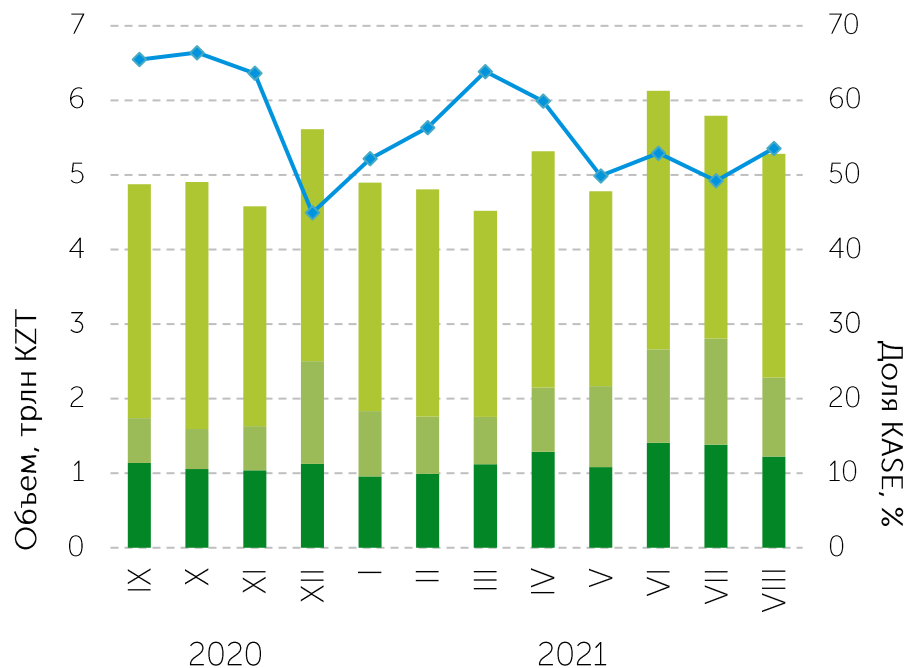
Доли основных категорий инвесторов за 8М 2021 года*



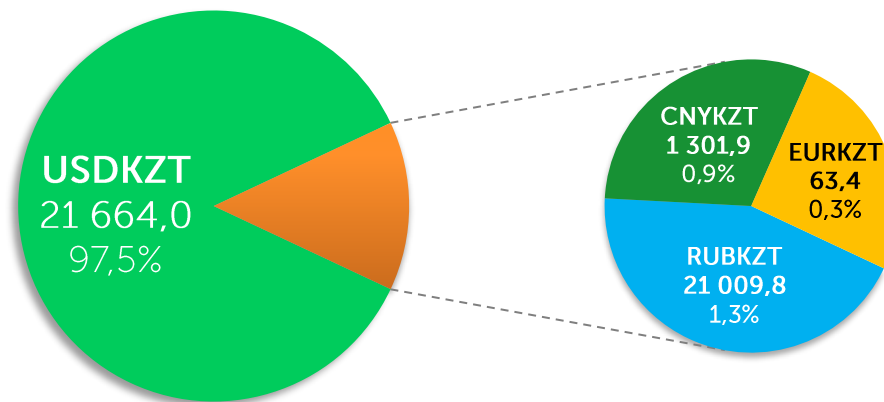
* от общего брутто-оборота торгов облигациями МФО, из расчета исключена позиция инициатора специализированных торгов

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

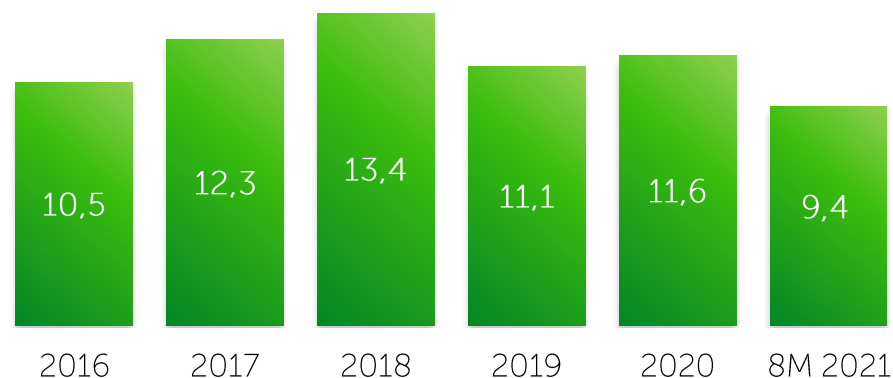


Структура биржевого рынка за 8М 2021 года в объеме торгов. Объем в млн единиц валюты



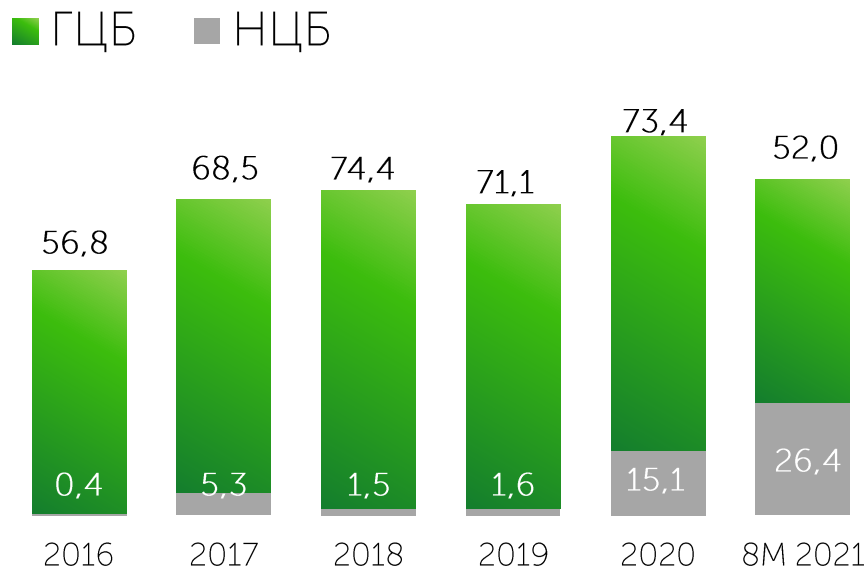
Примечание: доли рассчитаны от объема торгов в KZT

Объем торгов на спот-рынке, трлн KZT

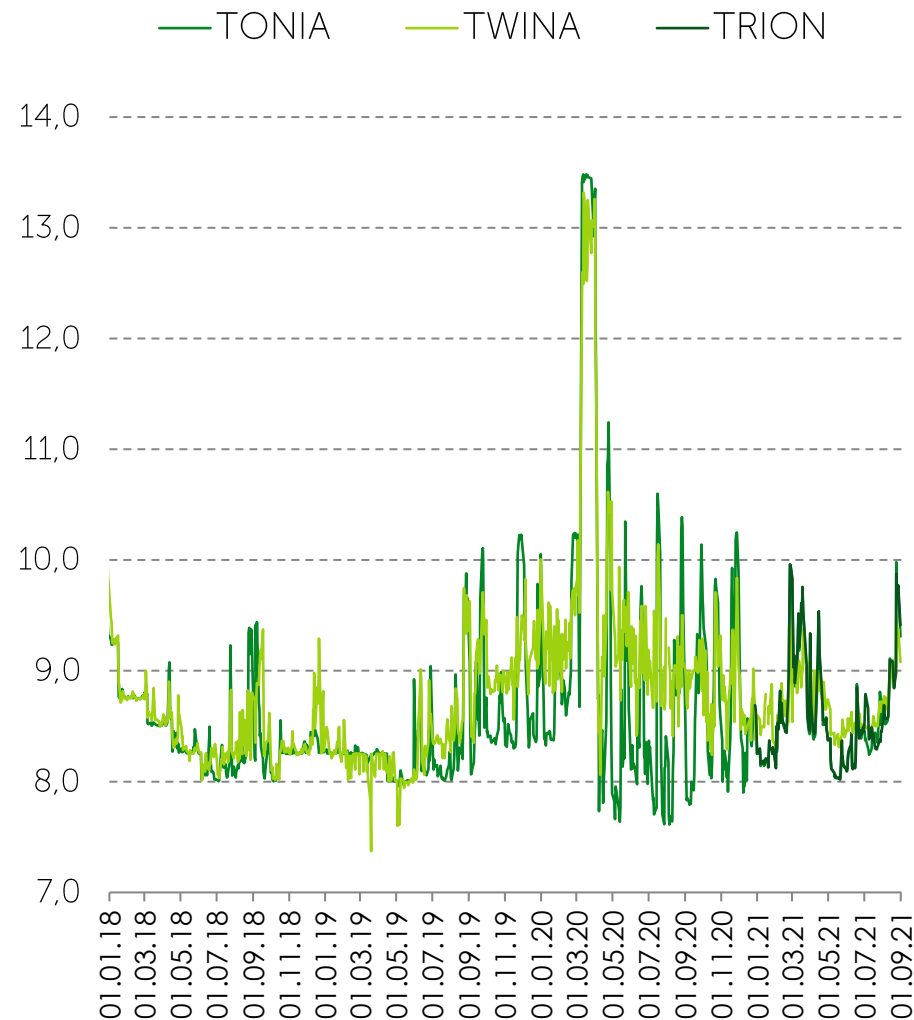


Рынок операций репо

Объем торгов, трлн KZT



Индикаторы репо, % годовых

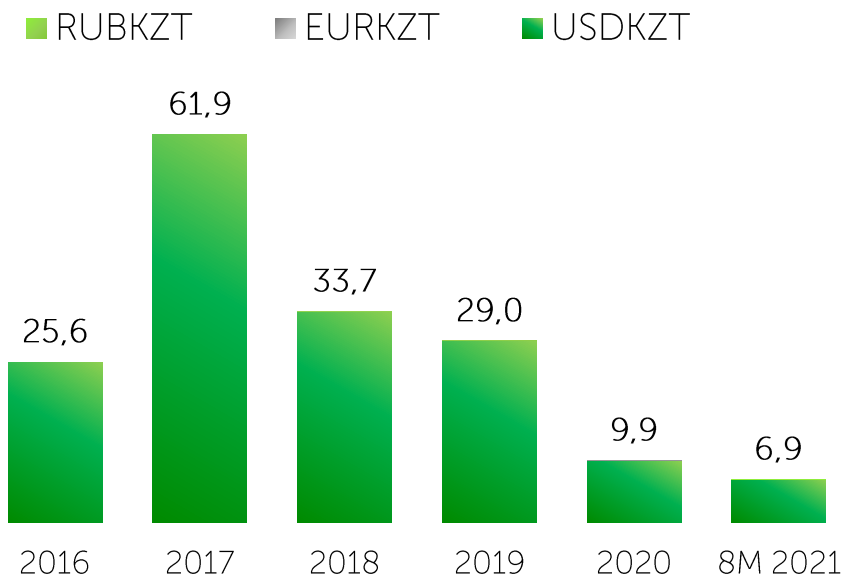


Инструменты рынка репо (объем за 8М 2021 / доля):

- Авторепо с корзиной ГЦБ (71 612,6 млрд KZT / 91,25%)
- Авторепо с корзиной ОДГУ (1 631,0 млрд KZT / 2,08%)
- Авторепо с НЦБ (3 365,4 млрд KZT / 4,29%)
- Авторепо с ГЦБ (1 790,2 млрд KZT / 2,28%)
- Прямое репо с НЦБ (46,5 млрд KZT / 0,06%)
- Прямое репо с ГЦБ (37,1 млн KZT / 0,05%)

Рынок операций валютного свопа

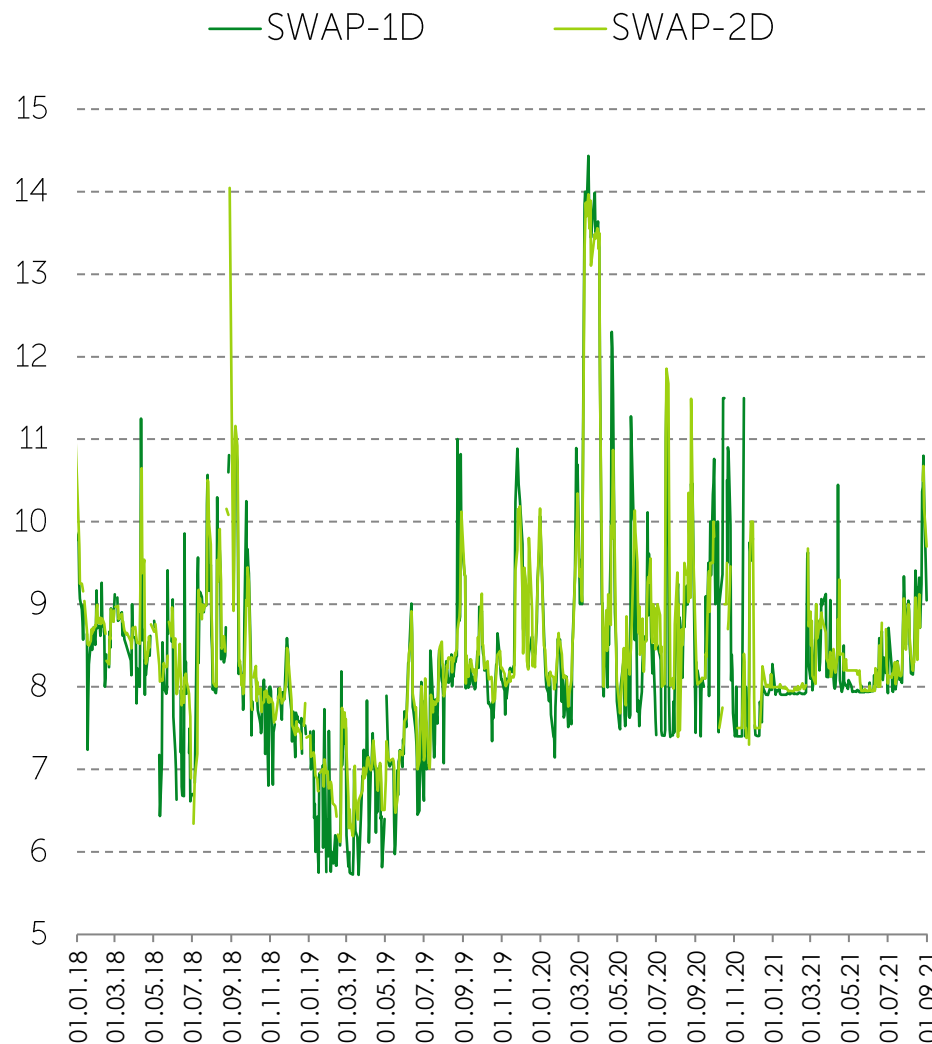
Объем торгов, трлн KZT



Инструменты рынка операций валютного свопа (объем за 8М 2021/ доля):

- **USDKZT_0_001** (3 720,86 млрд KZT / 54,01 %)
- USDKZT_0_002 (2 786,8 млрд KZT / 40,45 %)
- USDKZT_0_01W (12,6 млрд KZT / 0,18 %)
- USDKZT_0_01M (369,5 млрд KZT / 5,36 %)
- RUBKZT_0_001 (0,03 млрд KZT / <0,01 %)

Индикаторы своп-рынка, % годовых



Спасибо за внимание!

-  Kazakhstan Stock Exchange
-  kase_kz
-  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