



Қазақстан қор биржасы
Казахстанская фондовая биржа
Kazakhstan Stock Exchange

Типовая презентация

на 01 декабря 2021 года



АО "Казахстанская фондовая биржа"

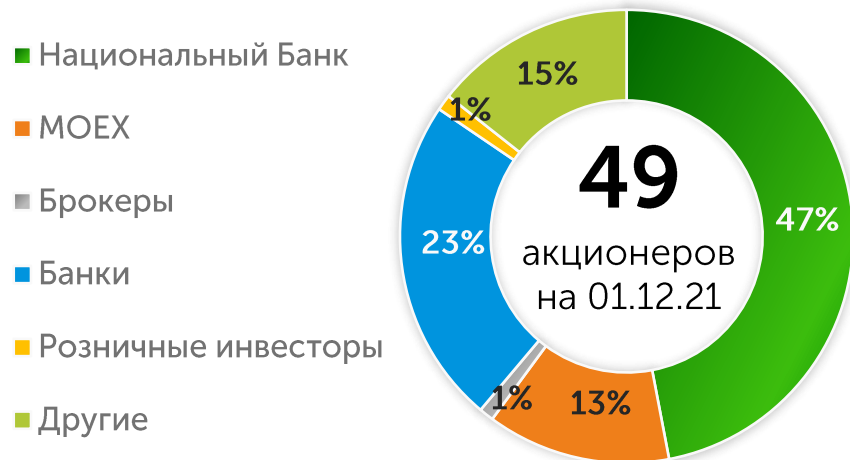
47,0% - НБРК

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



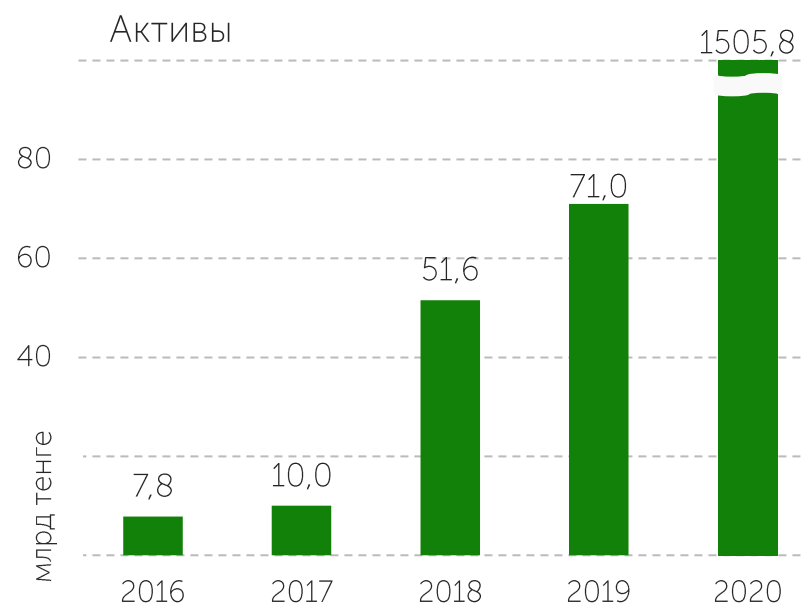
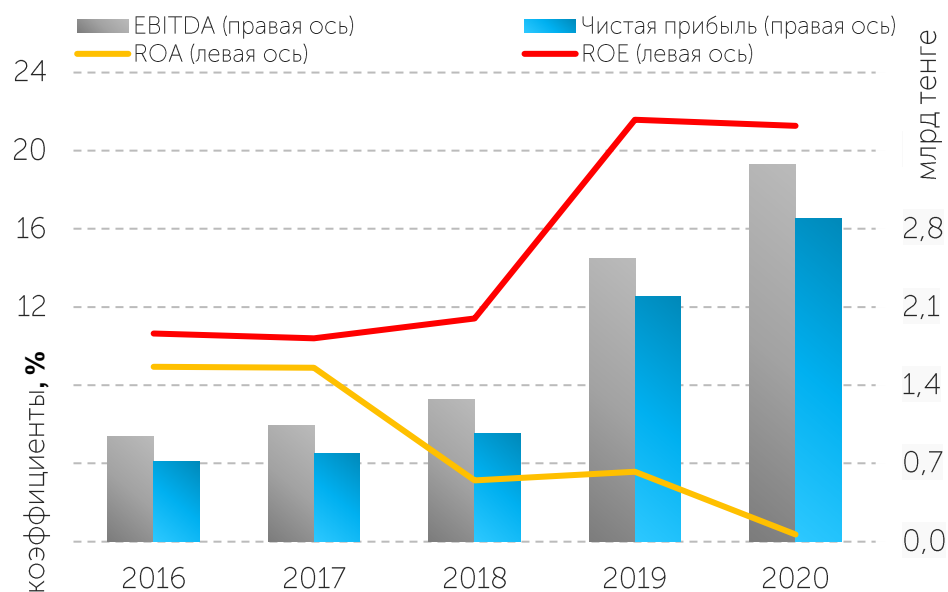
Акции и капитал KASE

На 01 октября 2021 года:

собственный капитал	18 889,7 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	17 568,0 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

40

Фондовая

32

Валютная

23

Деривативы

50

всего участников рынка

22

банков второго уровня (из 22)
резиденты РК

20

брокерских компаний (из 20)
резиденты РК

44

локальных участников

4

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

2

МФО (Межгосударственный банк,
Евразийский банк развития)

12

участников, предоставляющих
услуги прямого доступа (DMA)

Новые члены KASE:

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

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

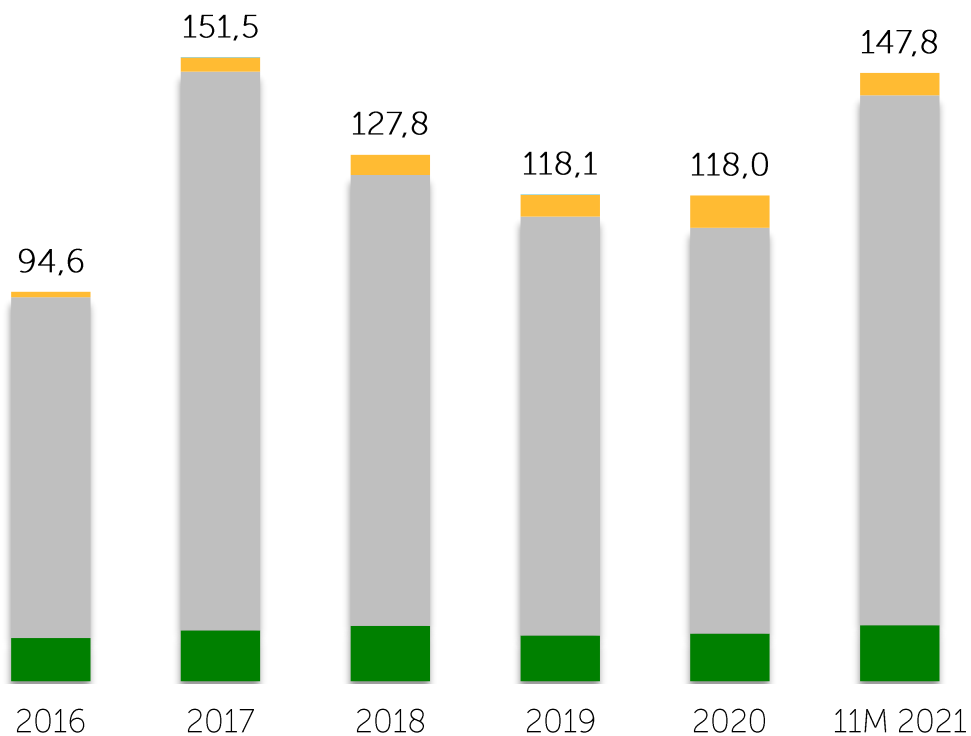
Показатели биржевого рынка за одиннадцать месяцев 2021 года

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	5 470,1	12 869,3	1 990	24 311,7	12,2
Акции	212,9	500,7	1 842	946,3	0,5
Корпоративные долговые ЦБ	1 703,0	4 015,1	35	7 568,9	216,7
ГЦБ	3 326,7	7 816,8	11	14 785,5	1 388,5
Облигации МФО	152,8	359,5	1	679,0	960,9
ЦБ инвестиционных фондов	36,0	85,0	102	159,9	1,6
Производные ценные бумаги	38,7	92,1	1	172,1	293,4
Рынок иностранных валют	13 593,4	31 933,5	414	60 415,0	146,1
Рынок денег	128 686,5	302 579,6	564	571 940,0	1 014,3
Операций репо	119 088,6	279 983,0	552	529 282,7	959,4
Операций валютного свопа	9 597,6	22 596,7	12	42 657,2	3 492,7
Деривативы	<0,1	<0,1	<1	<0,1	0,2
Итого	147 750	347 382,5	2 968	656 666,7	221,3

Объем и структура рынка

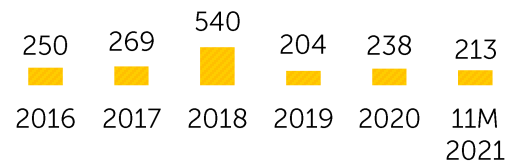


Динамика объема торгов по секторам, трлн KZT



Рынок акций

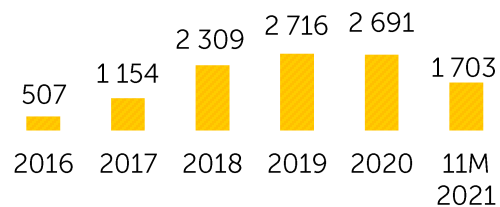
млрд KZT



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

Рынок корпоративных облигаций

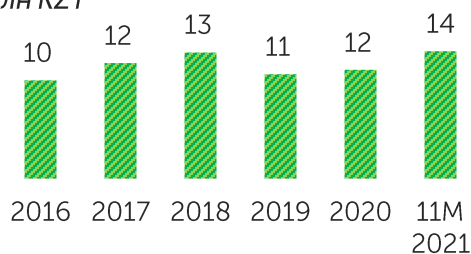
млрд KZT



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

Рынок иностранных валют

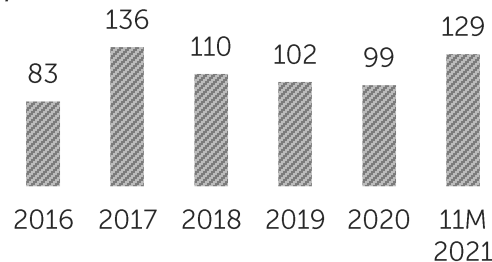
трлн KZT



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

Рынок денег

трлн KZT



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

Рынок акций

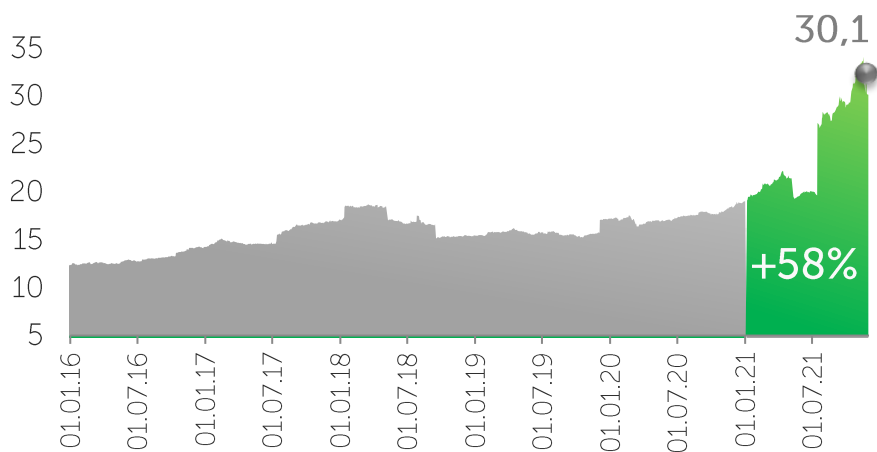
Объем сделок, млрд KZT



Новые листинги



Капитализация рынка акций, трлн KZT

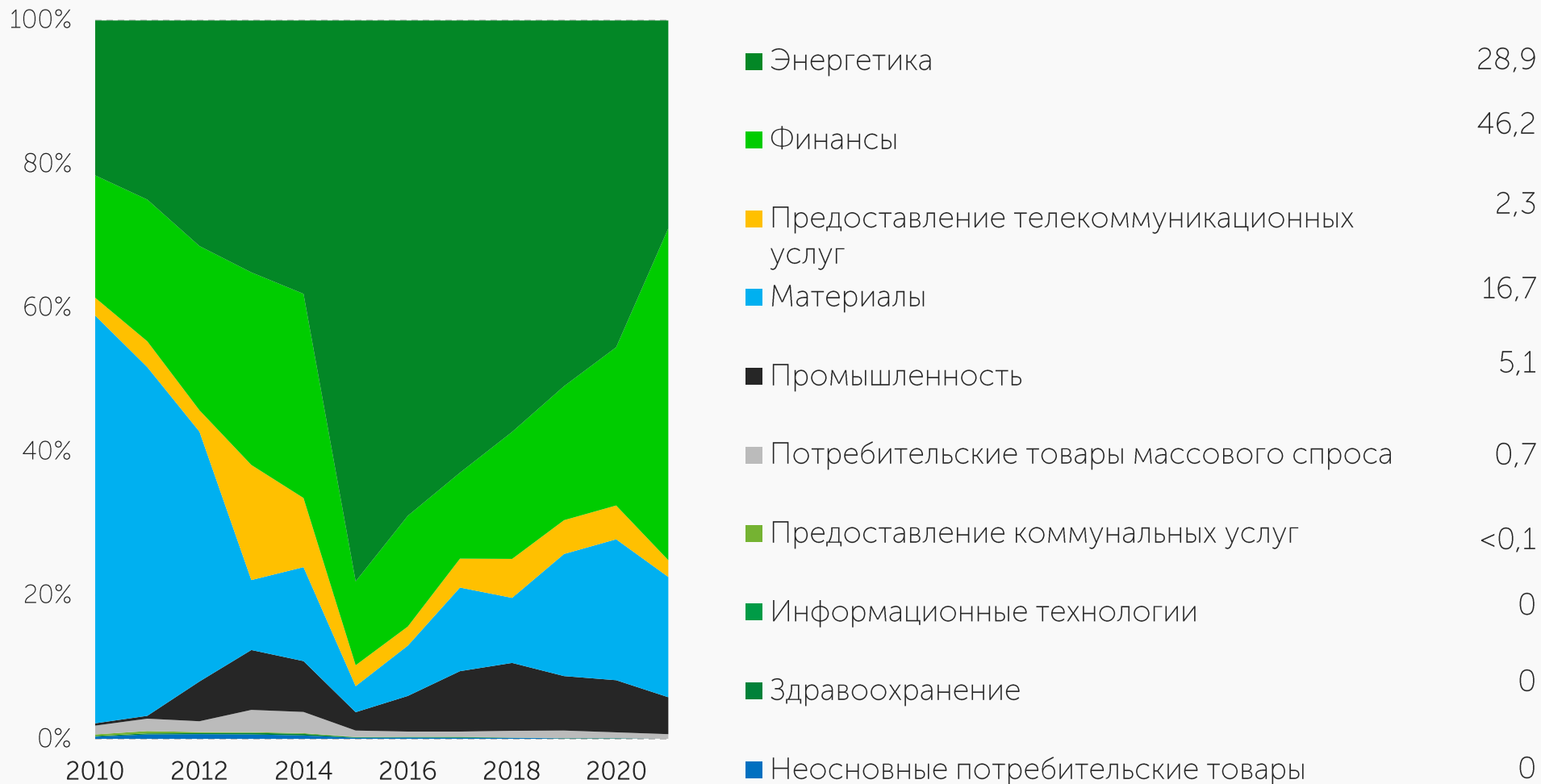


Основные показатели за 11M 2021 года



Отраслевая структура списков акций

Доля от капитализации, %

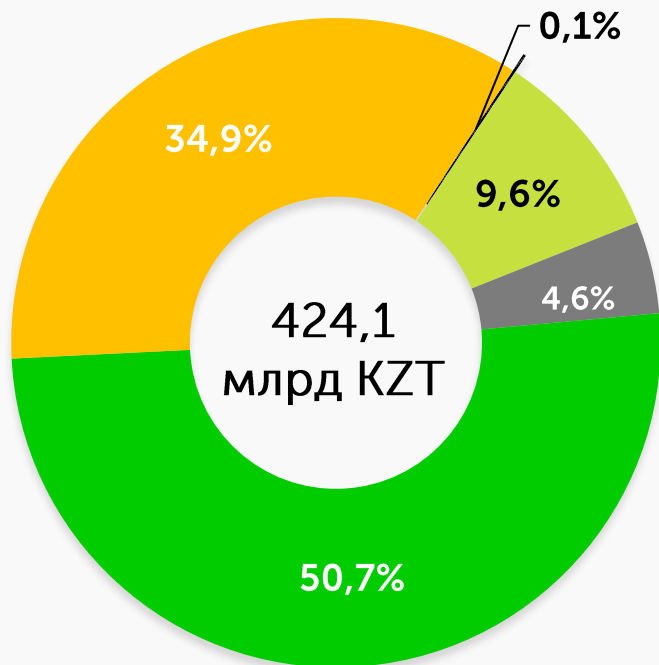


Примечание: в качестве классификатора используется "Global Industry Classification Standard (GICS)®"

Источник: KASE

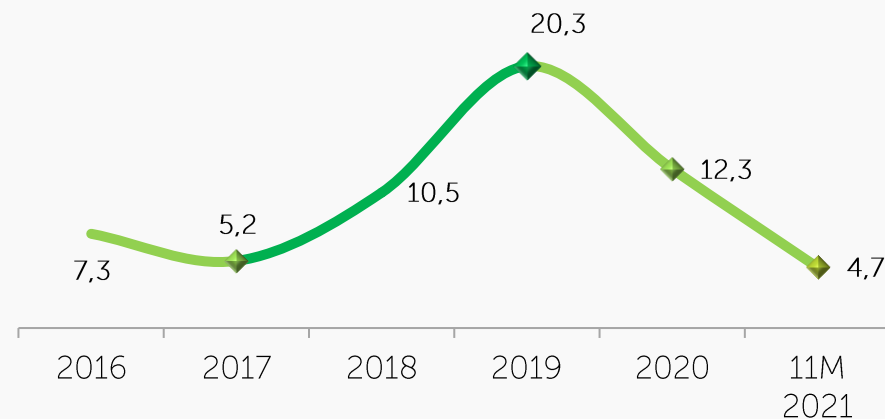
Рынок акций: инвесторская база

Доли основных категорий инвесторов на вторичном рынке за 11М 2021 года*

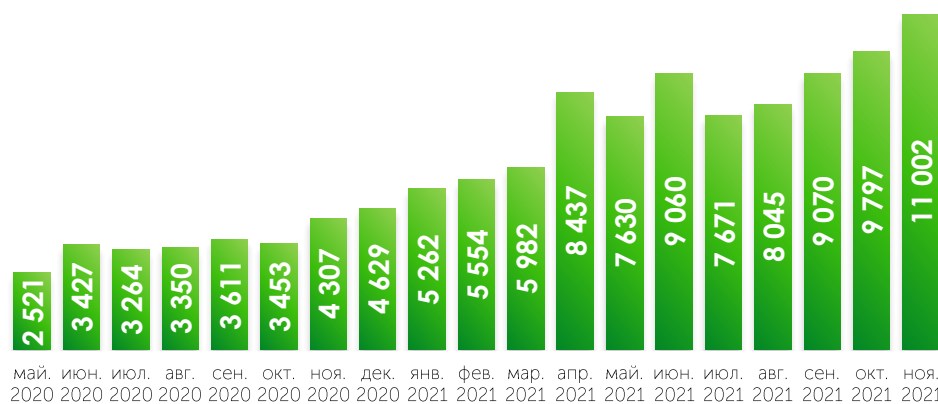


- Банки
- Брокеры-дилеры
- Др. институциональные инвесторы
- Физические лица
- Прочие юридические лица

Доля нерезидентов в брутто-обороте, %



Динамика активных счетов розничных инвесторов на рынке акций

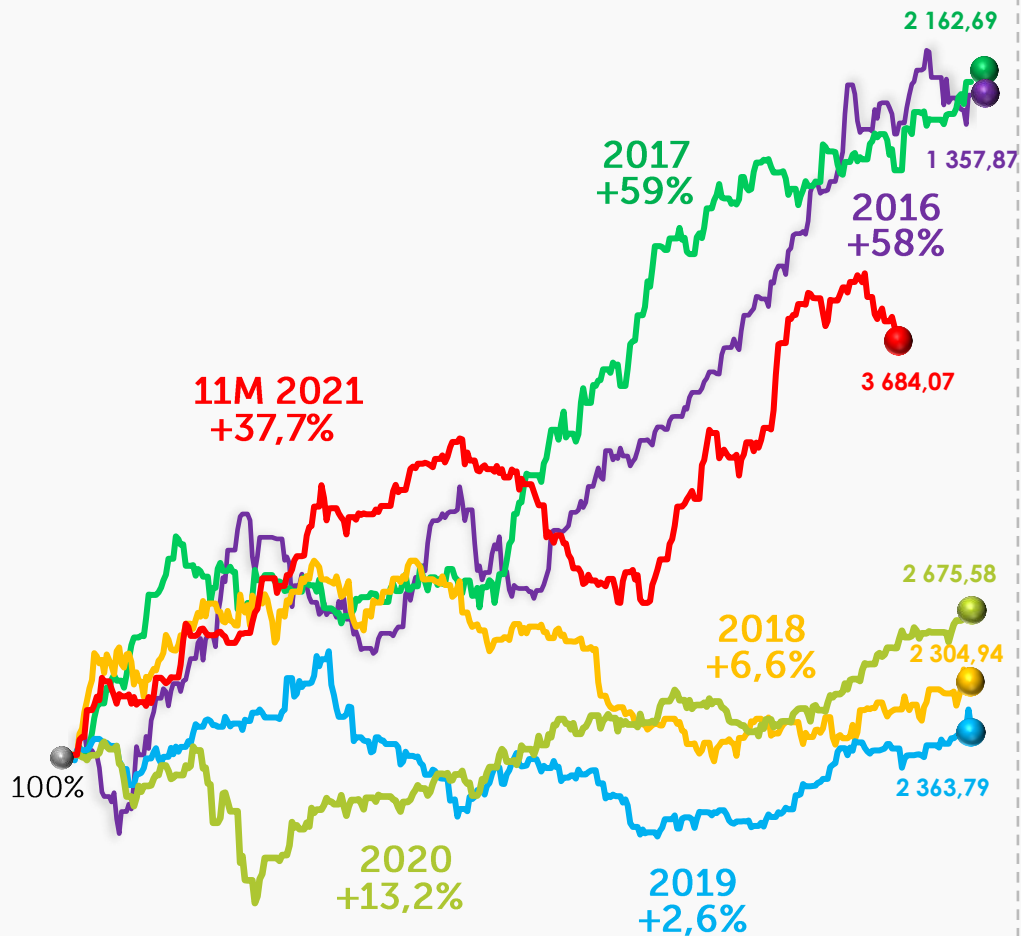


* от общего брутто-оборота торгов акциями на вторичном рынке без учета крупных сделок

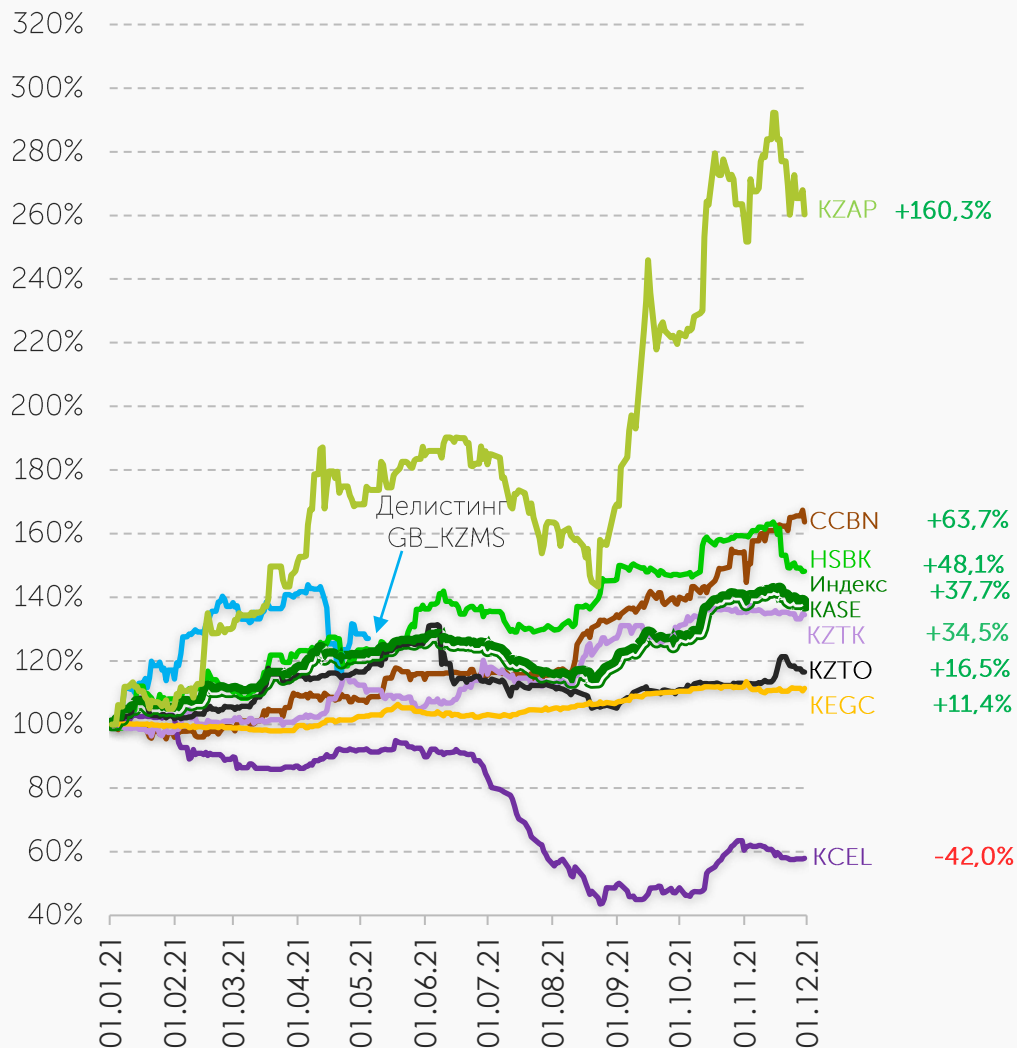
Источник: KASE

Динамика Индекса KASE

Индекс KASE в 2016 – 11М 2021



Динамика составляющих Индекса KASE

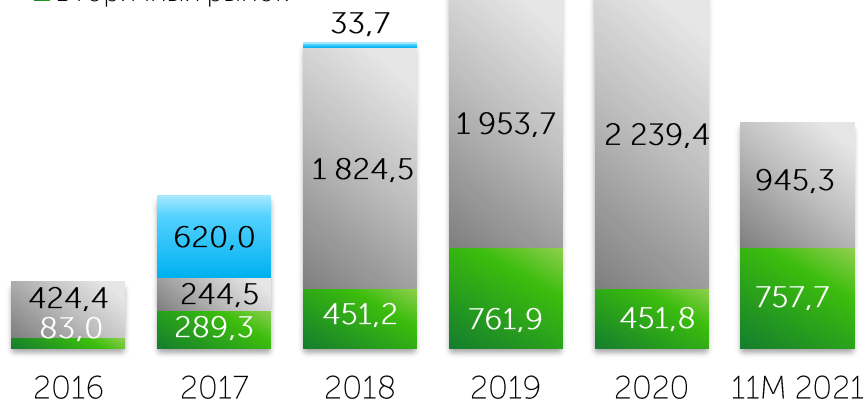


Источник: KASE, Bloomberg

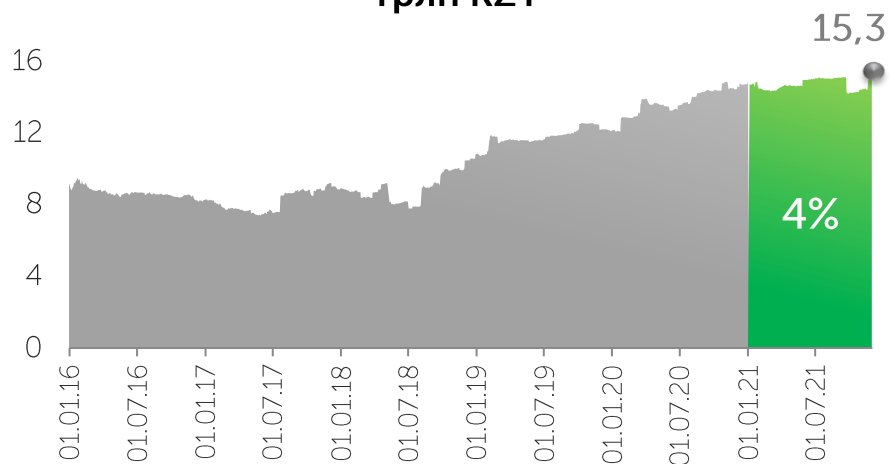
Рынок корпоративных облигаций

Объем сделок, млрд KZT

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

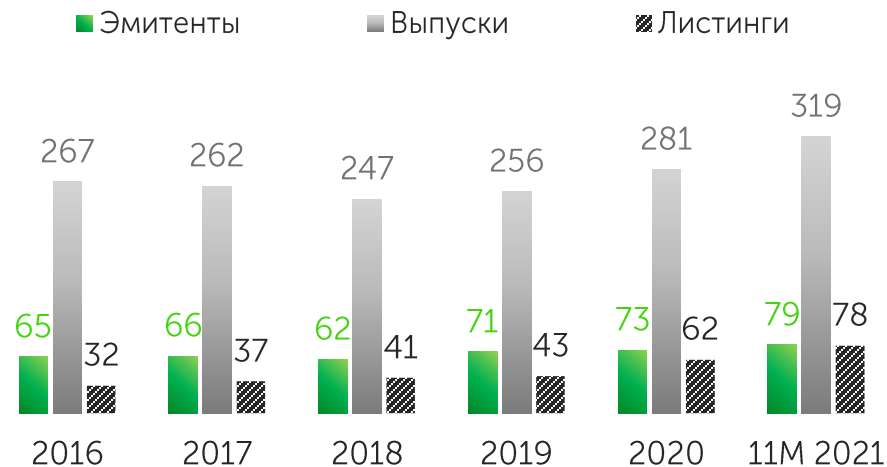


Объем корпоративного долга в обращении, трлн KZT

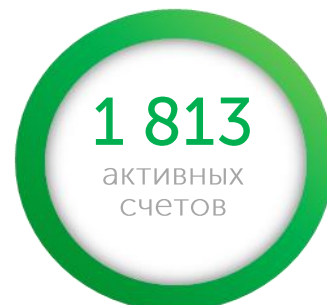


Источник: KASE

Новые листинги



Основные показатели за 11M 2021 года



45,3%
к 11M 2020 года

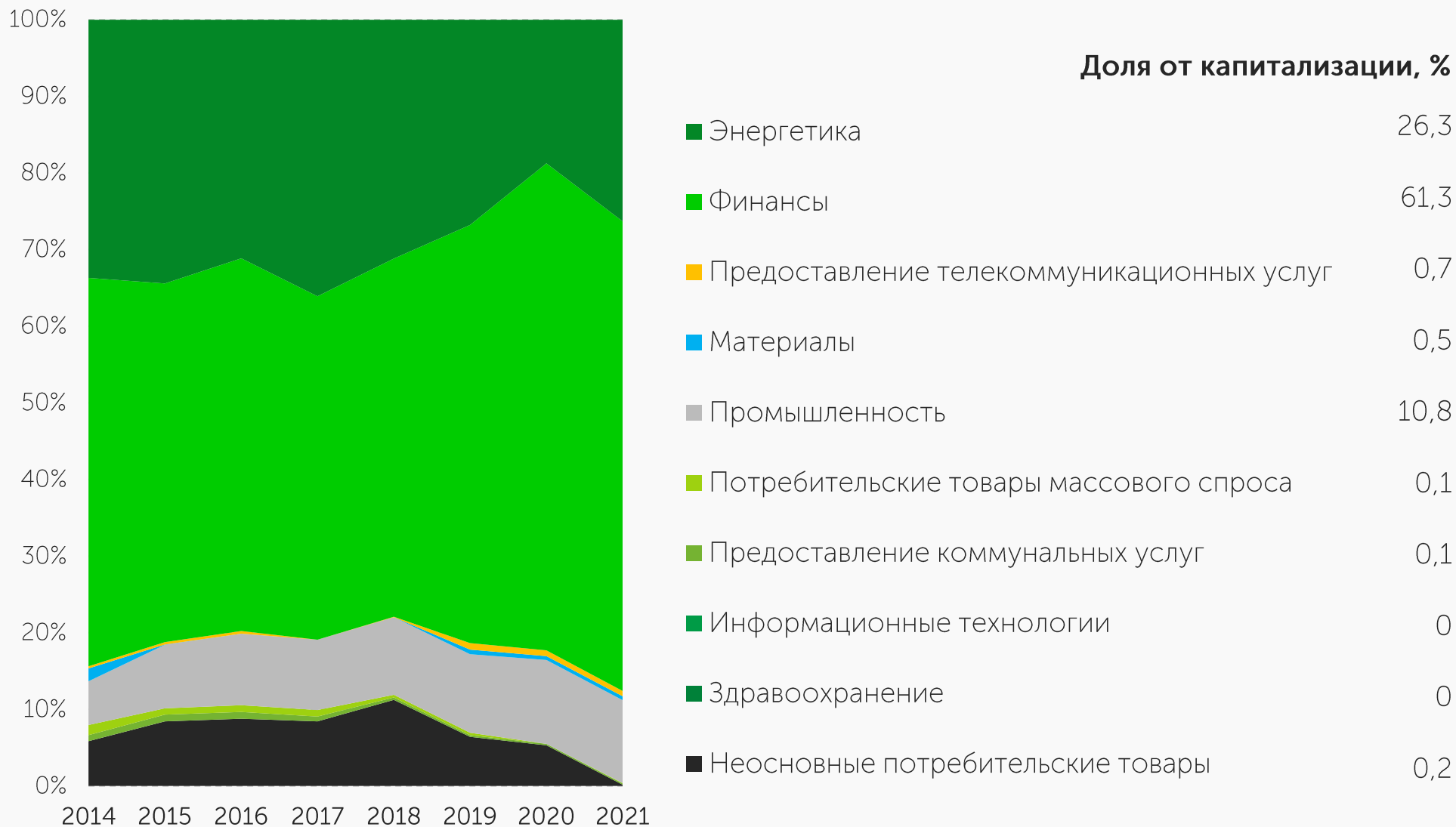


-14,7%
к 11M 2020 года



X 2,8
к 11M 2020 года

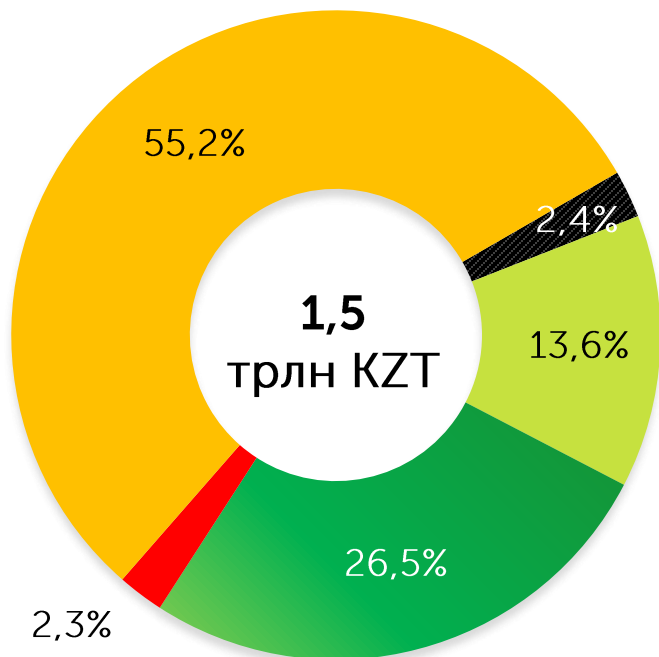
Отраслевая структура списков облигаций KASE



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

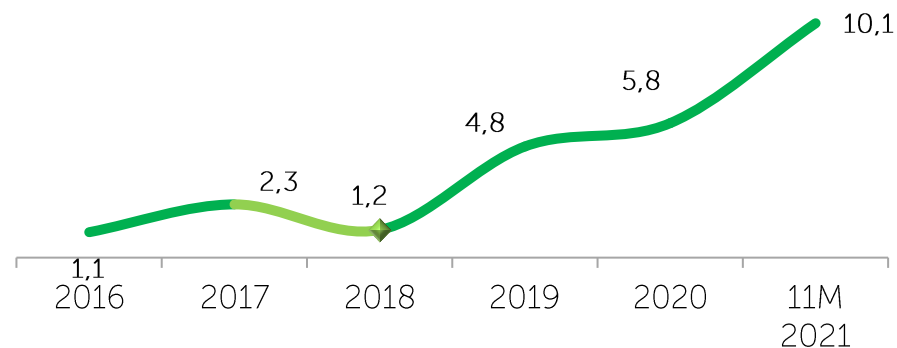
Инвесторская база рынка корпоративных облигаций KASE

Доли основных категорий инвесторов на вторичном рынке за 11М 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

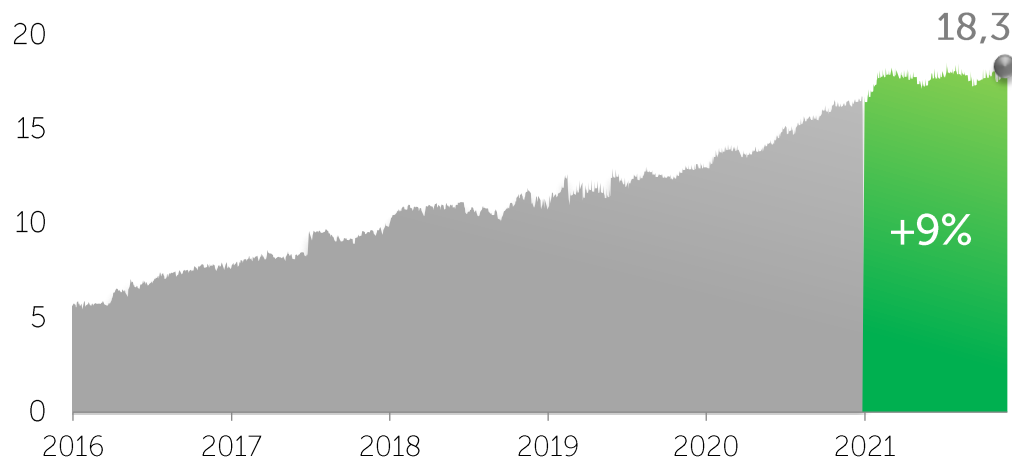


* от общего брутто-оборота торгов корпоративными облигациями на вторичном рынке

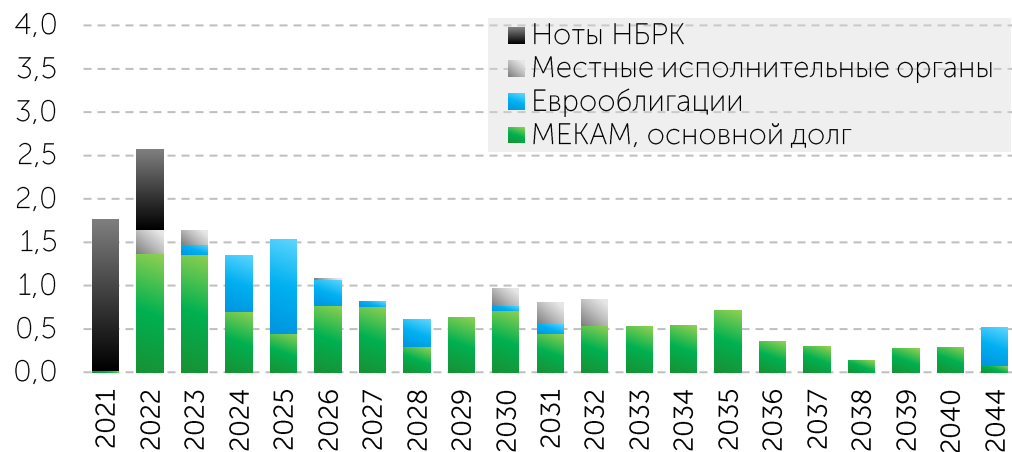
Динамика объема торгов, млрд KZT



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

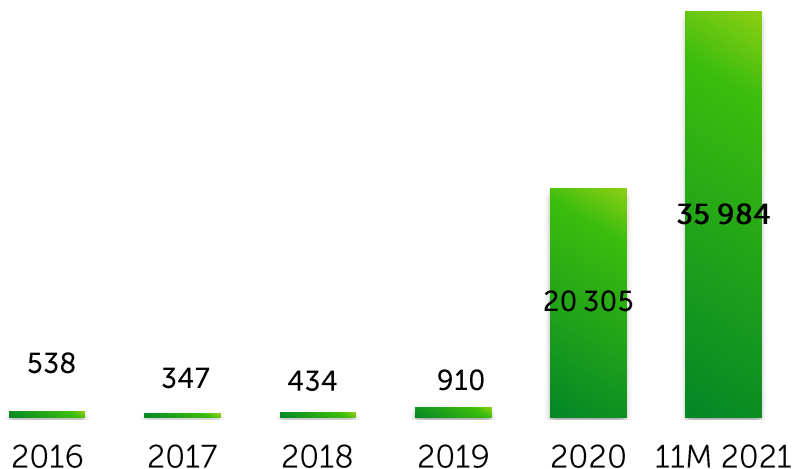


Динамика выплат по госдолгу, трлн KZT

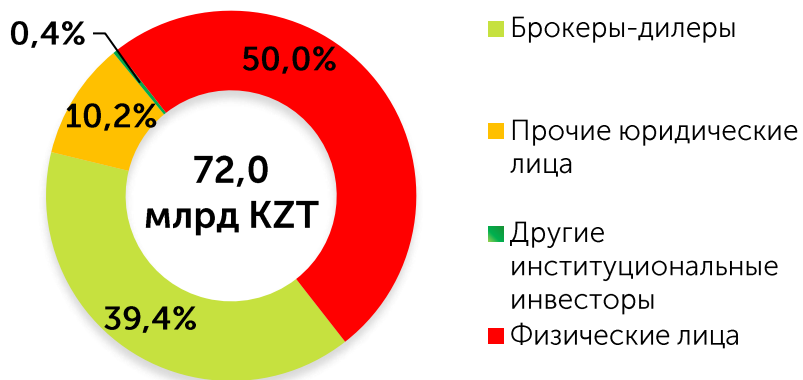


Источник: KASE

Объем сделок, млн KZT



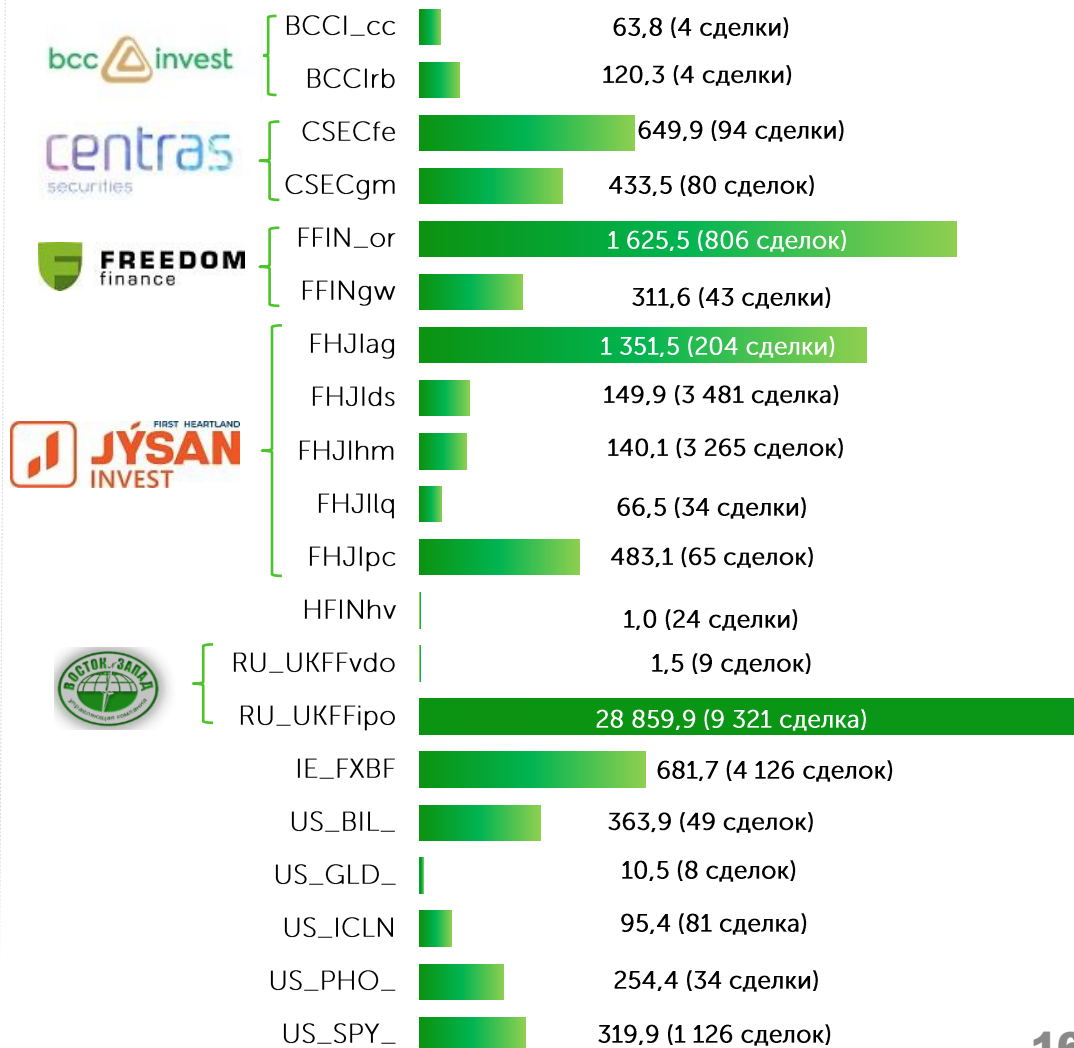
Доли основных категорий инвесторов за 11M 2021 года*



* от общего брутто-оборота торгов ценными бумагами инвестиционных фондов

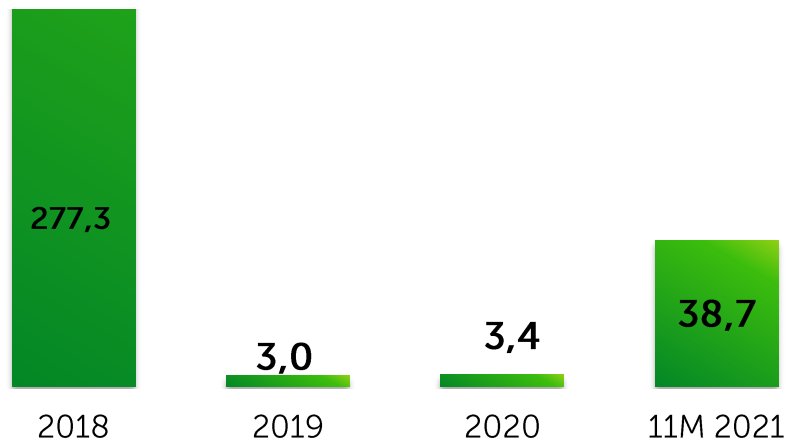
Источник: KASE

Объем торгов в разбивке по инструментам за 11M 2021 года, млн KZT

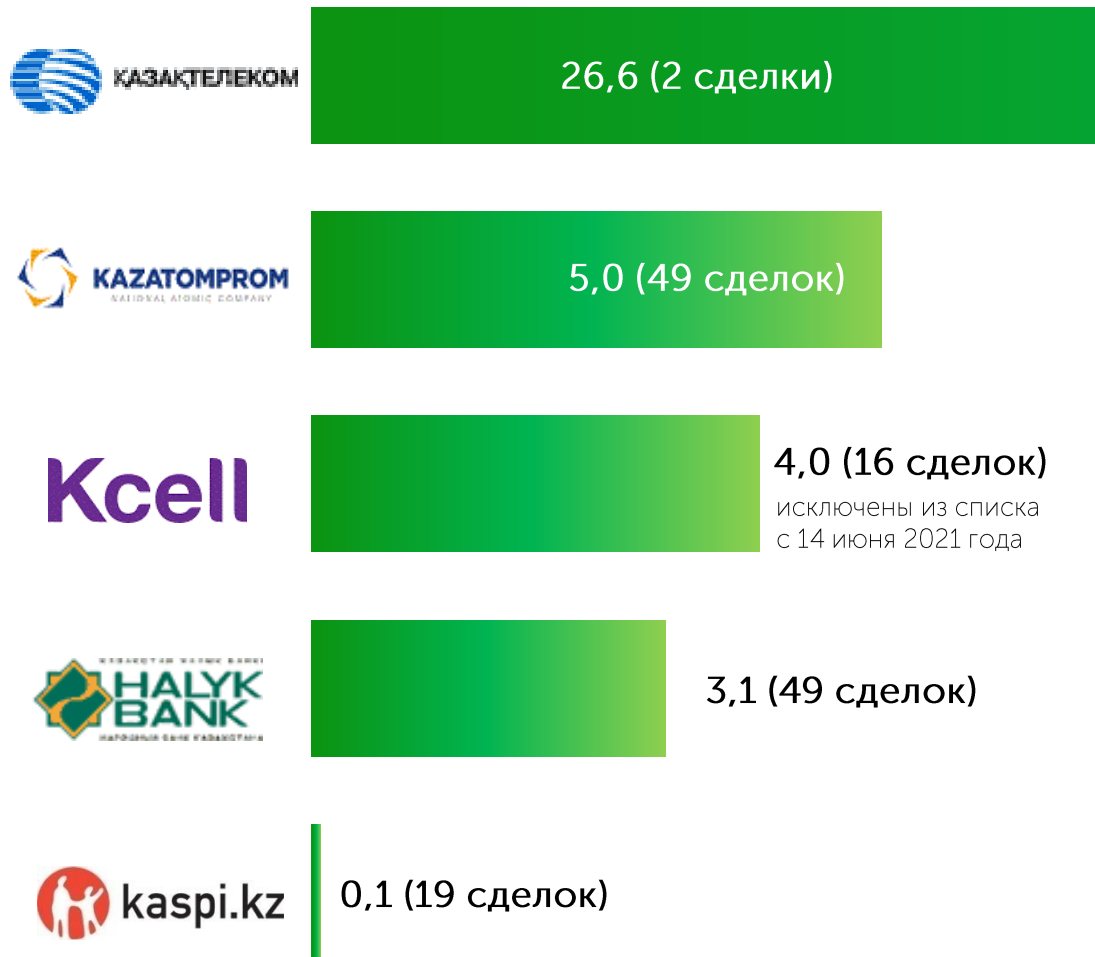


Производные ценные бумаги

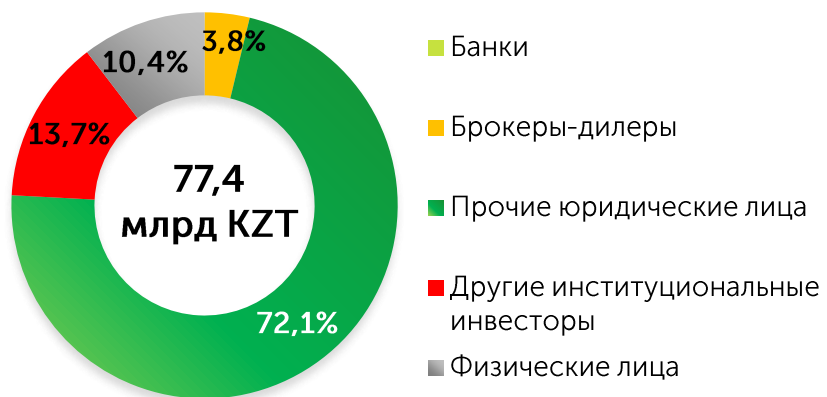
Объем сделок, млрд KZT



Объем торгов в разбивке по инструментам за 11М 2021 года, млрд KZT

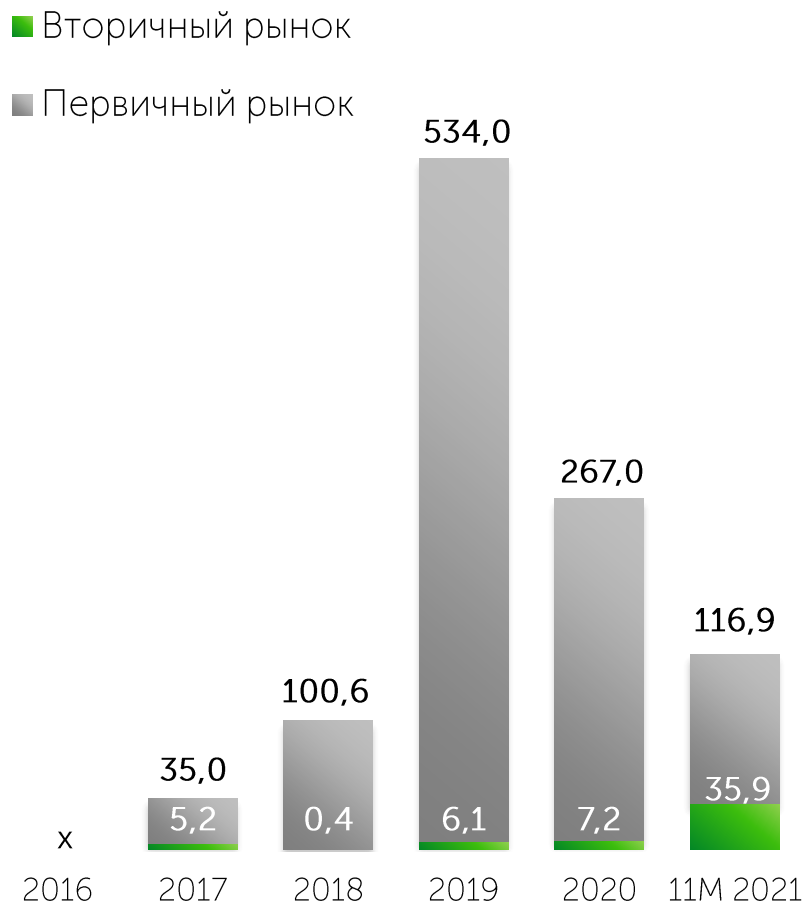


Доли основных категорий инвесторов за 11М 2021 года*



* от общего брутто-оборота торгов производными ценными бумагами

Объемы торгов, млрд KZT

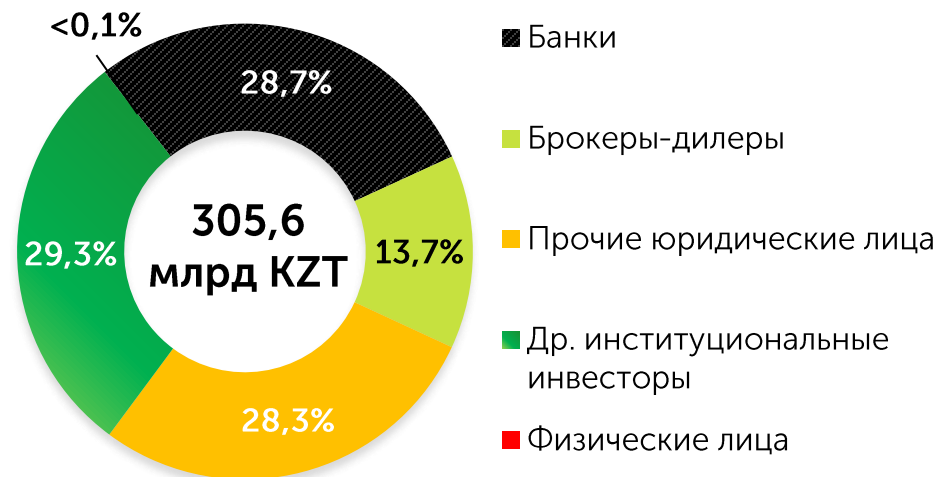


На 01 декабря 2021 года в официальном списке KASE находятся **43 выпуска облигаций**

4 организаций:

- 20 выпусков Евразийского банка развития
- 12 выпусков Европейского банка реконструкции и развития
- 3 выпуска Международной финансовой корпорации
- 8 выпусков Азиатского банка развития

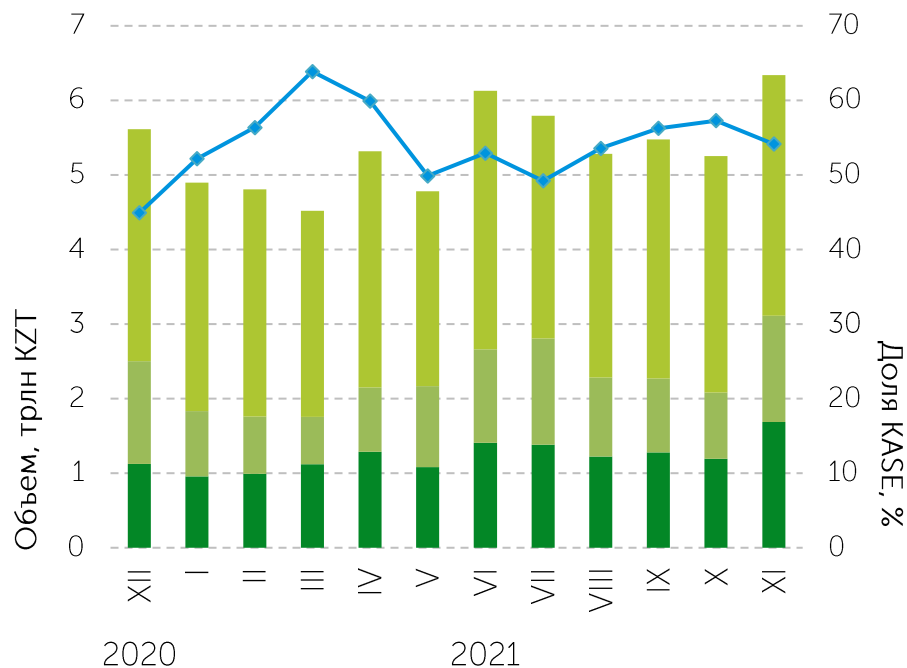
Доли основных категорий инвесторов за 11М 2021 года*



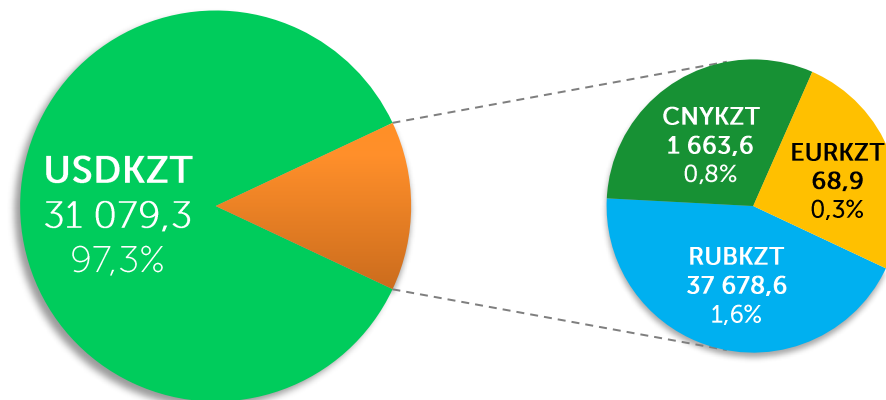
* от общего брутто-оборота торгов облигациями МФО, из расчета исключена позиция инициатора специализированных торгов

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

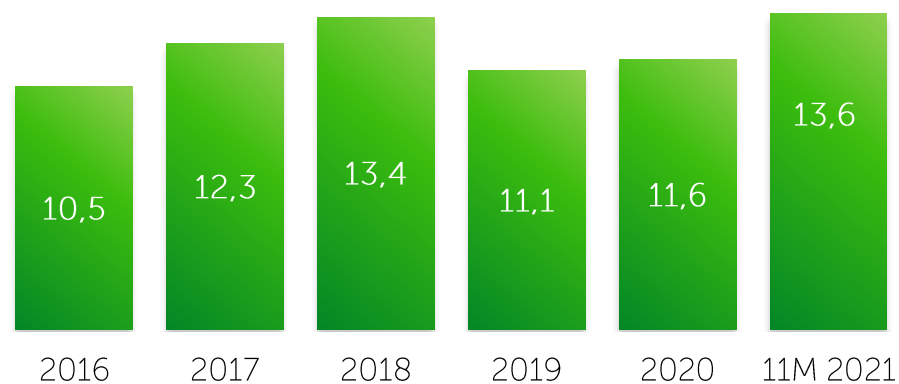


Структура биржевого рынка за 11М 2021 года в объеме торгов. Объем в млн единиц валюты



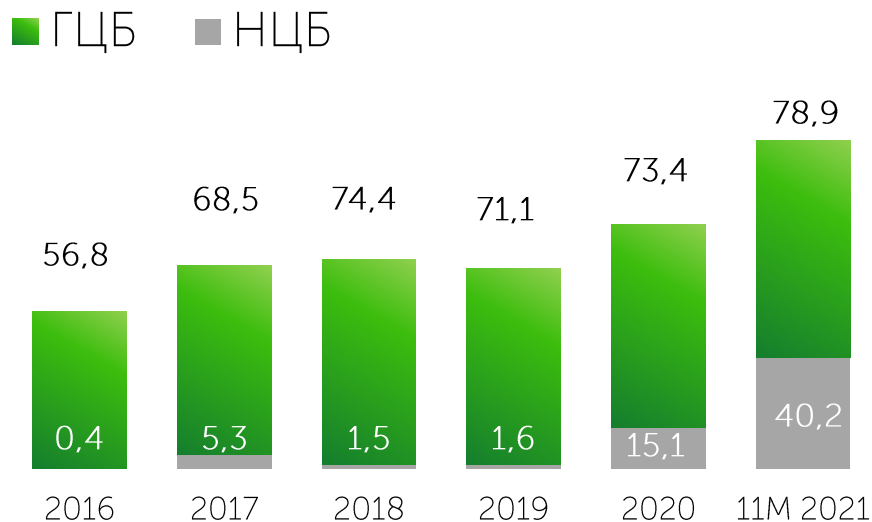
Примечание: доли рассчитаны от объема торгов в KZT

Объем торгов на спот-рынке, трлн KZT

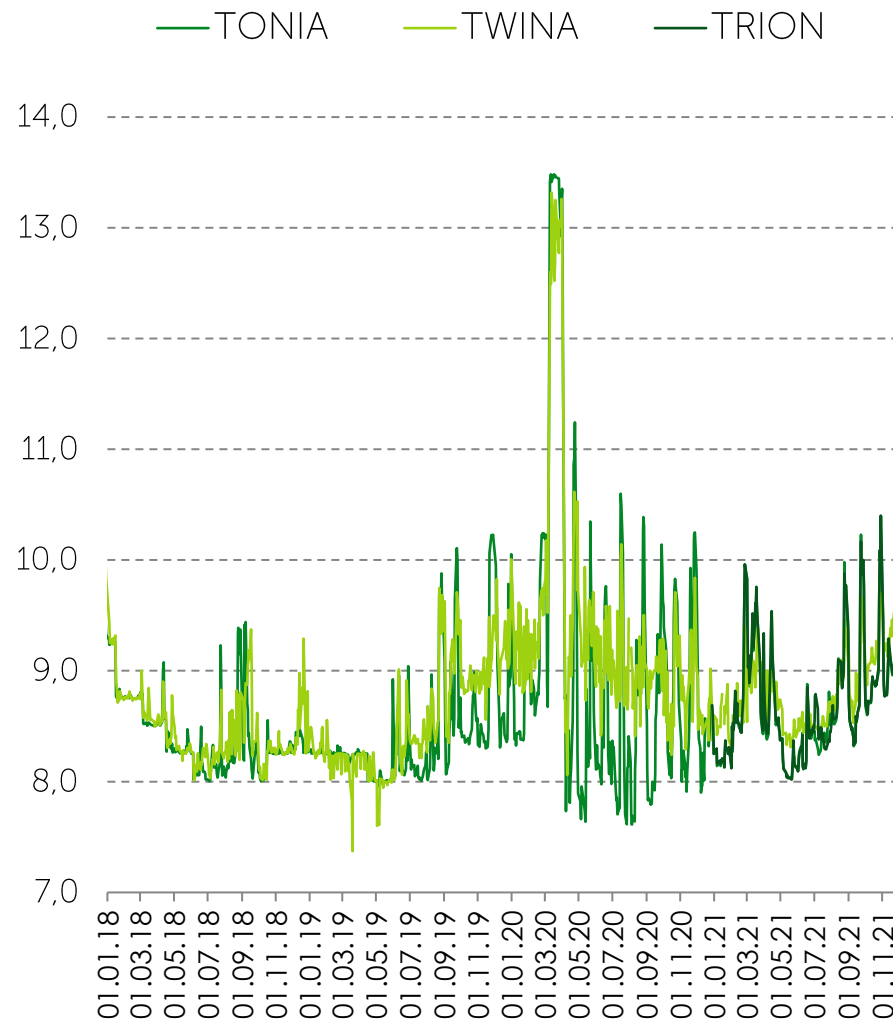


Рынок операций репо

Объем торгов, трлн KZT



Индикаторы репо, % годовых

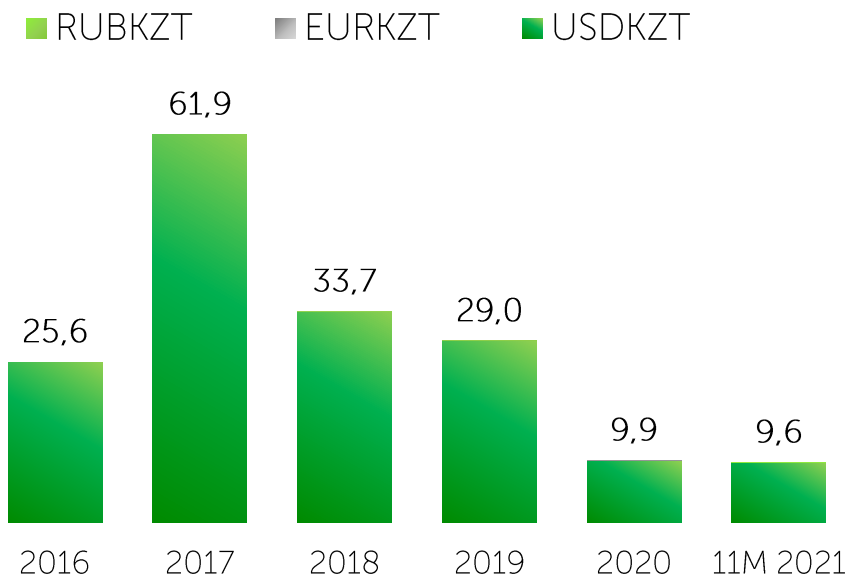


Инструменты рынка репо, трлн KZT



Рынок операций валютного свопа

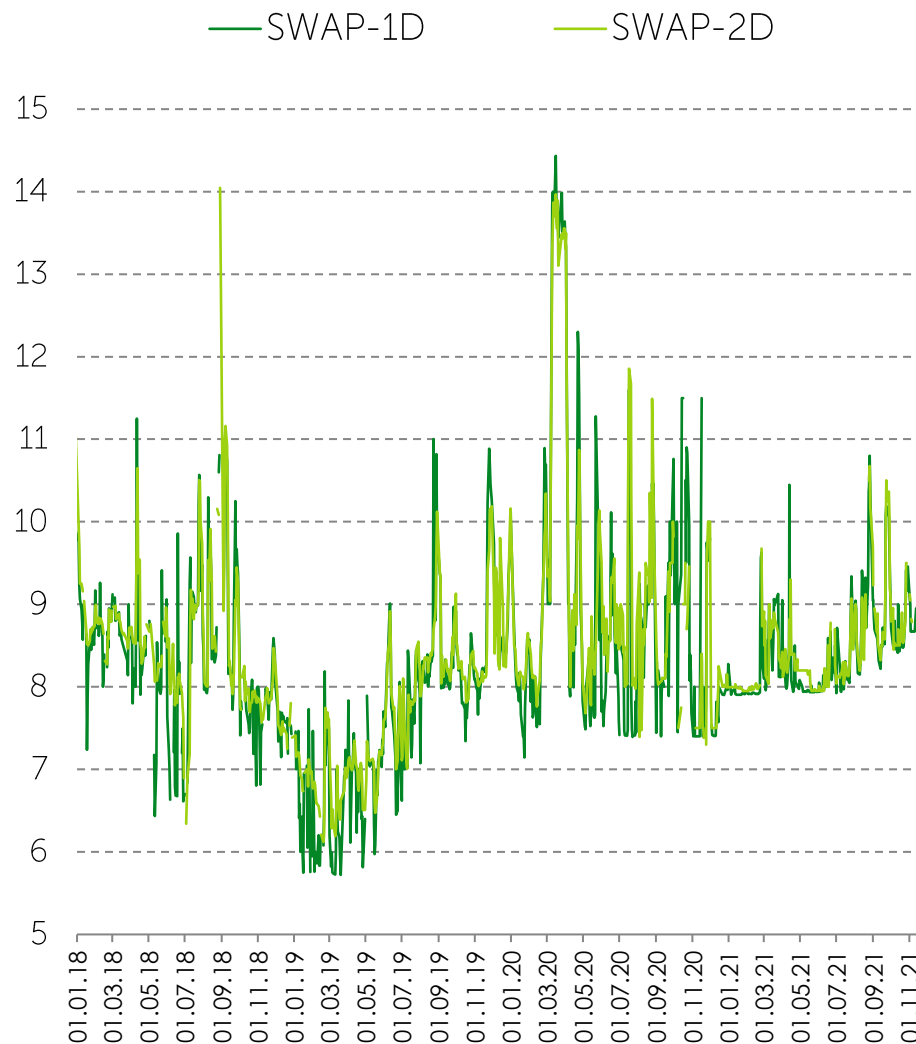
Объем торгов, трлн KZT



Инструменты рынка операций валютного свопа (объем за 11М 2021/ доля):

- USDKZT_0_001 (5 645,8 млрд KZT / 58,82 %)
- USDKZT_0_002 (3 353,2 млрд KZT / 34,94 %)
- USDKZT_0_01W (12,6 млрд KZT / 0,13 %)
- USDKZT_0_01M (586,1 млрд KZT / 6,11 %)
- RUBKZT_0_001 (0,3 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