

Типовая презентация

на 01 января 2023 года



АО "Казахстанская фондовая биржа"

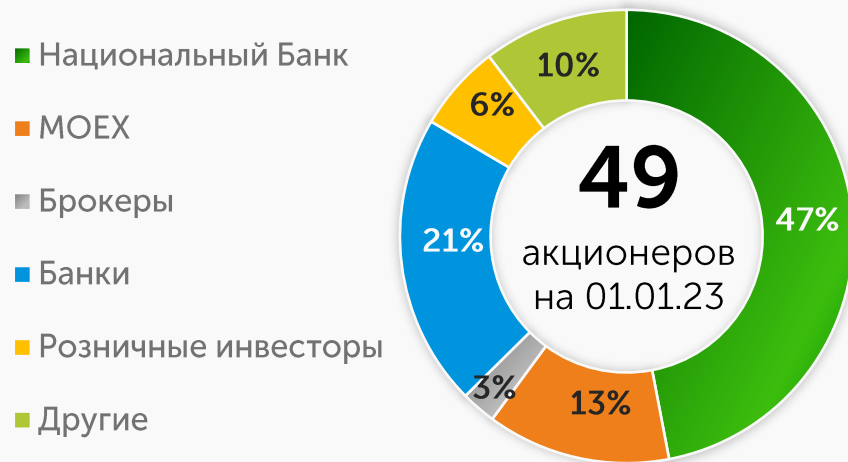
47,0% - НБРК

13,1% – МОЕХ

33,7% - 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



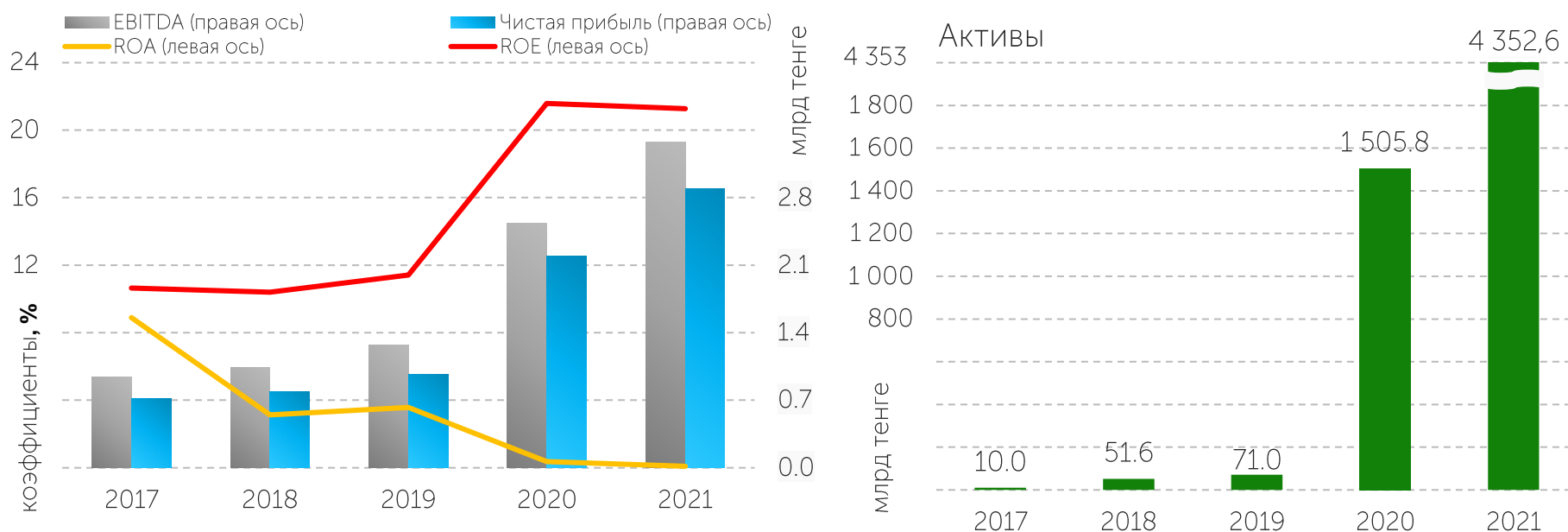
Акции и капитал KASE

На 01 октября 2022 года:

собственный капитал	24 648,4 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	22 923,8 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

43

Фондовая

33

Валютная

27

Деривативы

52

всего участников рынка

21

банк второго уровня (из 21)
резиденты РК

22

брокерских компаний (из 22)
резиденты РК

46

локальных участников

4

иностранного участника
(ООО "ИВА Партнерс", ООО ИК "Фридом Финанс",
АО "Райффайзенбанк", Freedom Finance Global PLC)

2

МФО (Межгосударственный банк,
Евразийский банк развития)

12

участников, предоставляющих
услуги прямого доступа (DMA)

Новые члены KASE:

2022

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

2021

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

2020

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

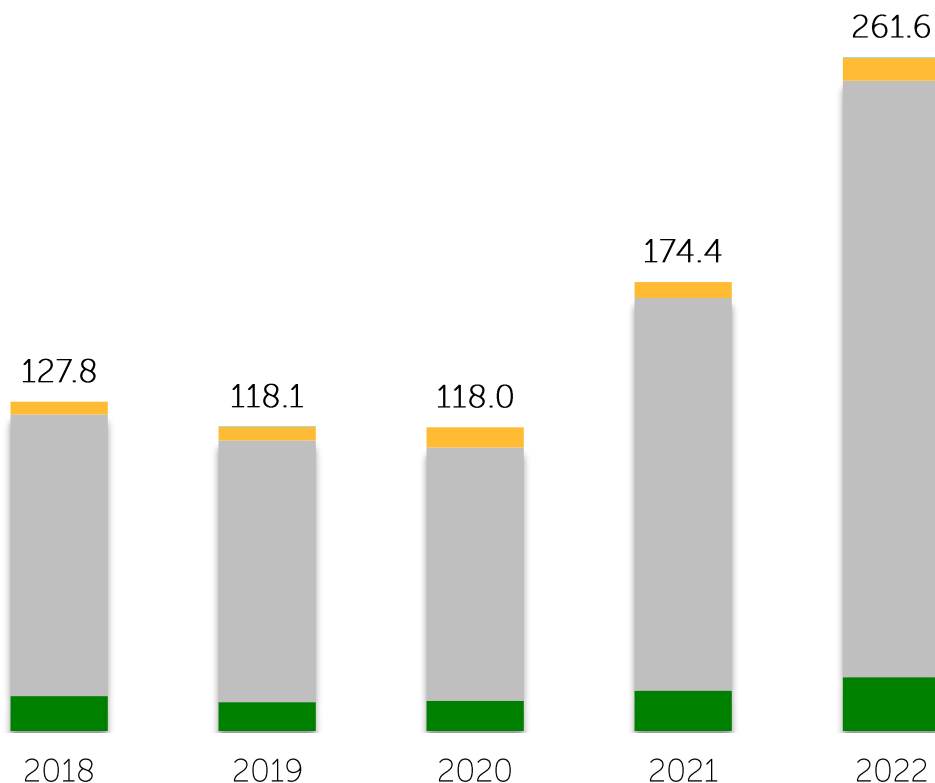
Показатели биржевого рынка за 2022 год

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	8 980,5	19 451.6	2 382	36 654,9	15,4
Акции	307,3	656.9	2 107	1 254,3	0,6
KASE Global	25,8	57.2	116	105,3	0,9
Корпоративные долговые ЦБ	2 488,8	5 390.5	75	10 158,6	134,7
ГЦБ	6 004,3	13 010.9	14	24 507,4	1 755,7
Облигации МФО	126,9	276.6	1	518,1	351,6
ЦБ инвестиционных фондов	8,8	19.3	63	36,1	0,6
Производные ценные бумаги	18,4	40.1	4	75,2	16,6
Рынок иностранных валют	20 798,2	44 848.0	350	84 890,4	242,6
Рынок денег	231 834,4	506 280.0	963	946 262,7	982,5
Операций репо	202 635,7	442 699.1	942	827 084,6	878,1
Операций валютного свопа	29 198,6	63 580.9	21	119 178,2	5 606,5
Деривативы	7.9	16.8	<1	32.1	1 573.2
Итого	261 620,8	570 596.4	3 695	1 067 840,1	289,0

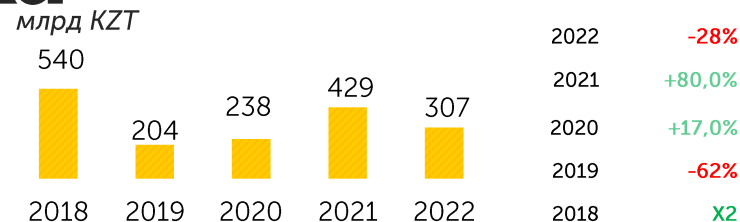
Объем и структура рынка



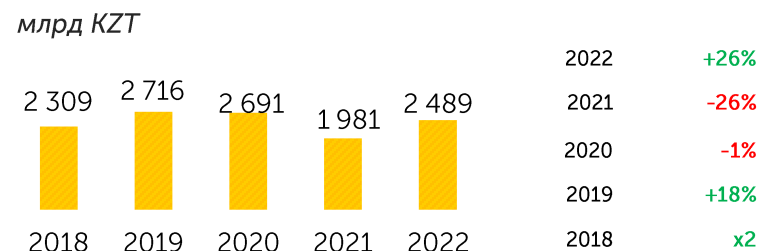
Динамика объема торгов по секторам, трлн KZT



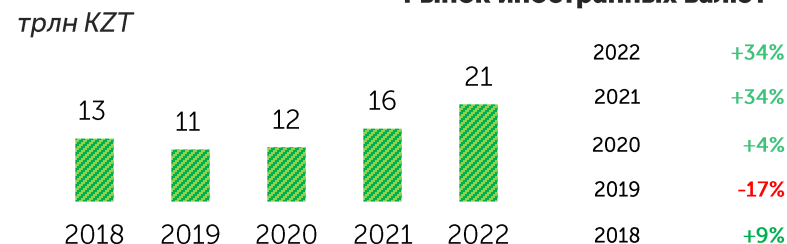
Рынок акций



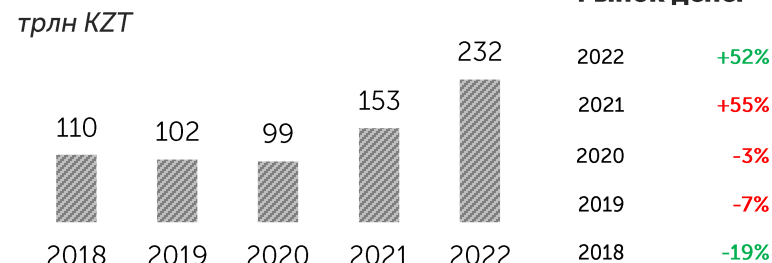
Рынок корпоративных облигаций



Рынок иностранных валют



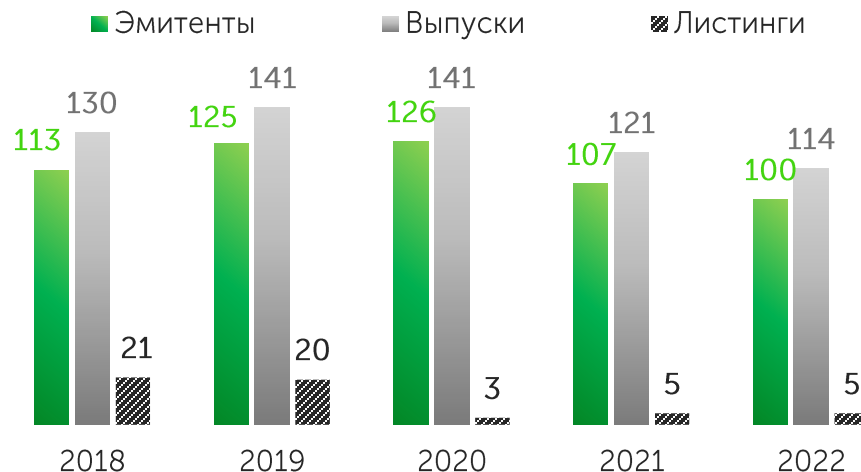
Рынок денег



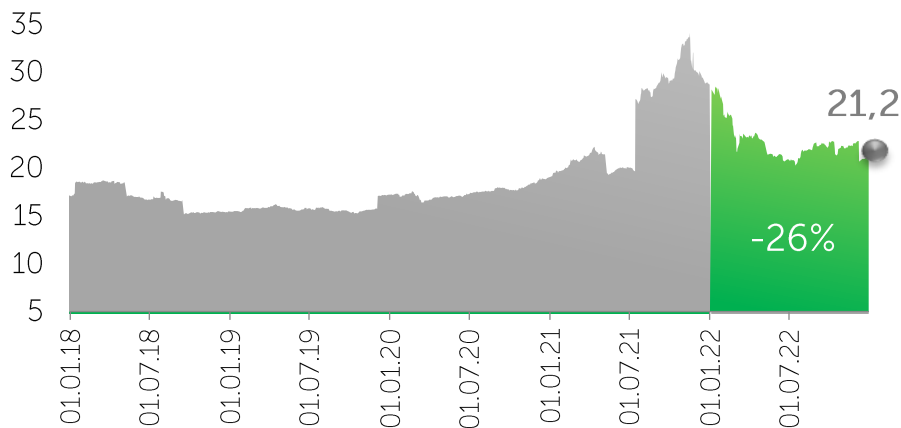
Объем сделок, млрд KZT



Новые листинги



Капитализация рынка акций, трлн KZT



Основные показатели за 2022 год

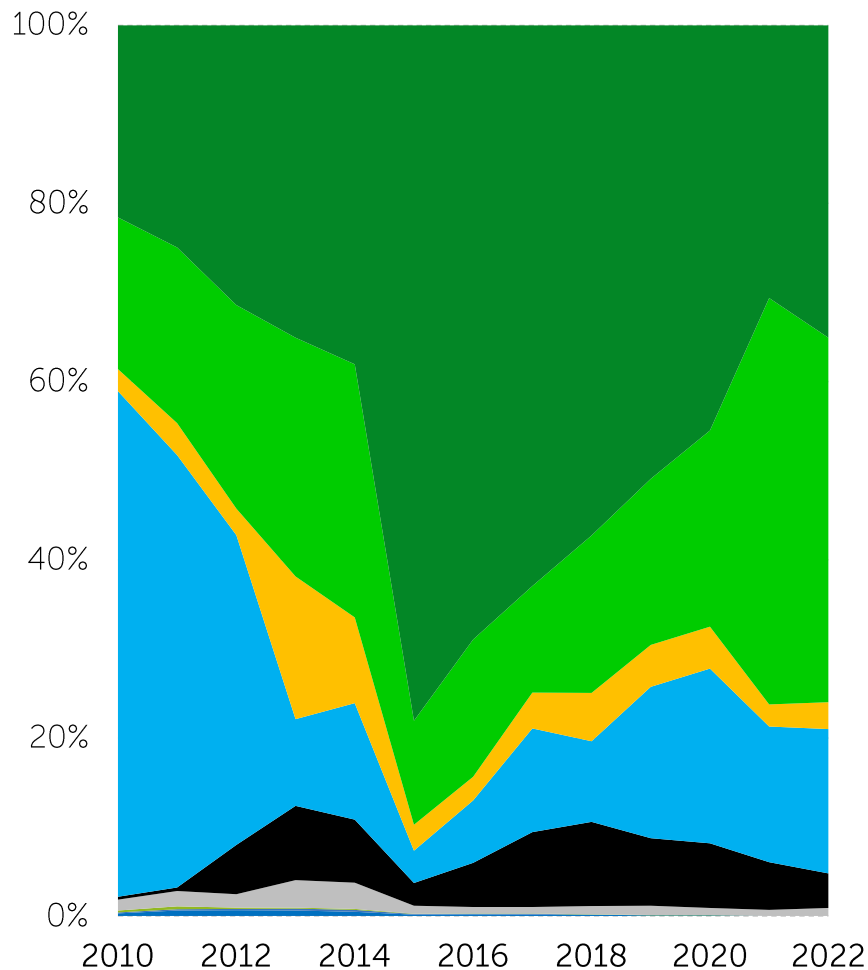


Источник: KASE

* на вторичном рынке с учетом индивидуальных счетов и уникальных кодов по омнибус счетам

Отраслевая структура списков акций

Доля от капитализации, %



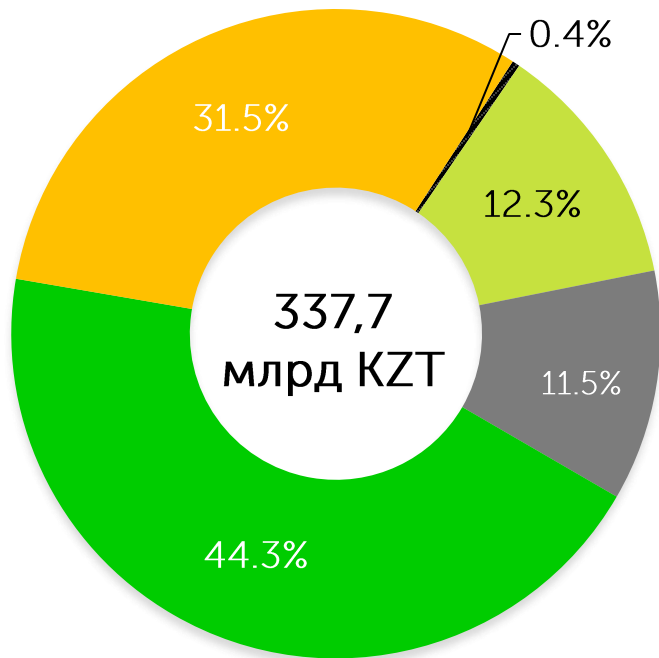
■ Энергетика	35,1
■ Финансы	40,9
■ Предоставление телекоммуникационных услуг	3,0
■ Материалы	16,2
■ Промышленность	3,9
■ Потребительские товары массового спроса	0,9
■ Предоставление коммунальных услуг	<0,1
■ Информационные технологии	—
■ Здравоохранение	—
■ Неосновные потребительские товары	—

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

Источник: KASE

Рынок акций: инвесторская база

Доли основных категорий инвесторов на вторичном рынке за 2022 год*

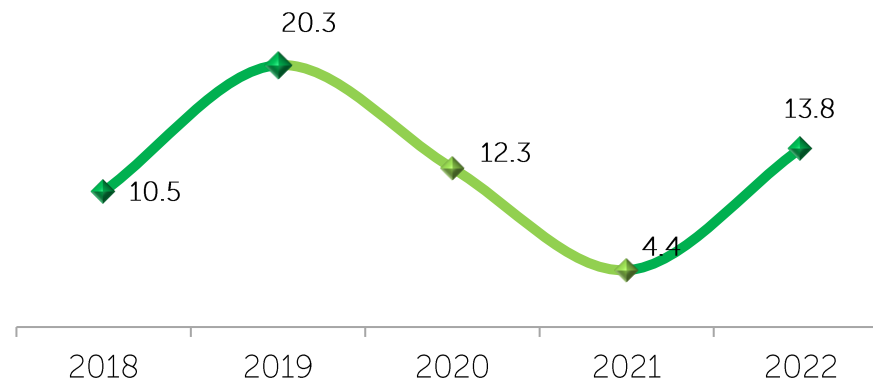


- Банки
- Брокеры-дилеры
- Др. институциональные инвесторы
- Физические лица
- Прочие юридические лица

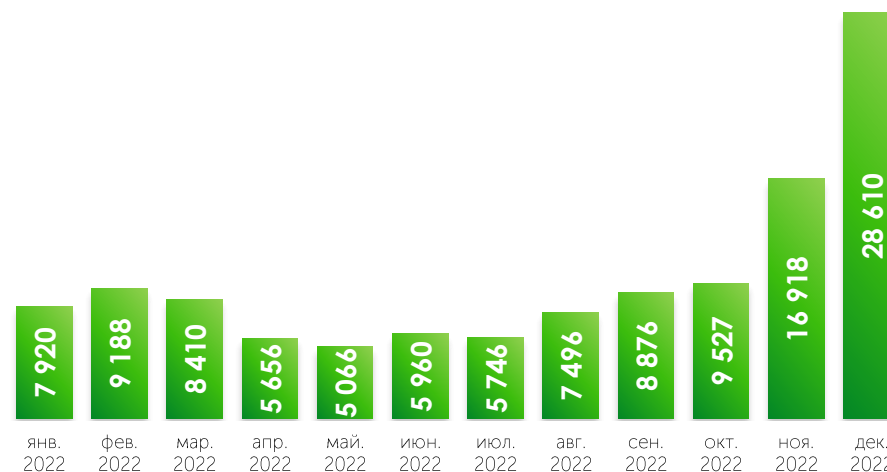
* от общего брутто-оборота торгов акциями без учета крупных сделок

Источник: KASE

Доля нерезидентов в брутто-обороте*, %



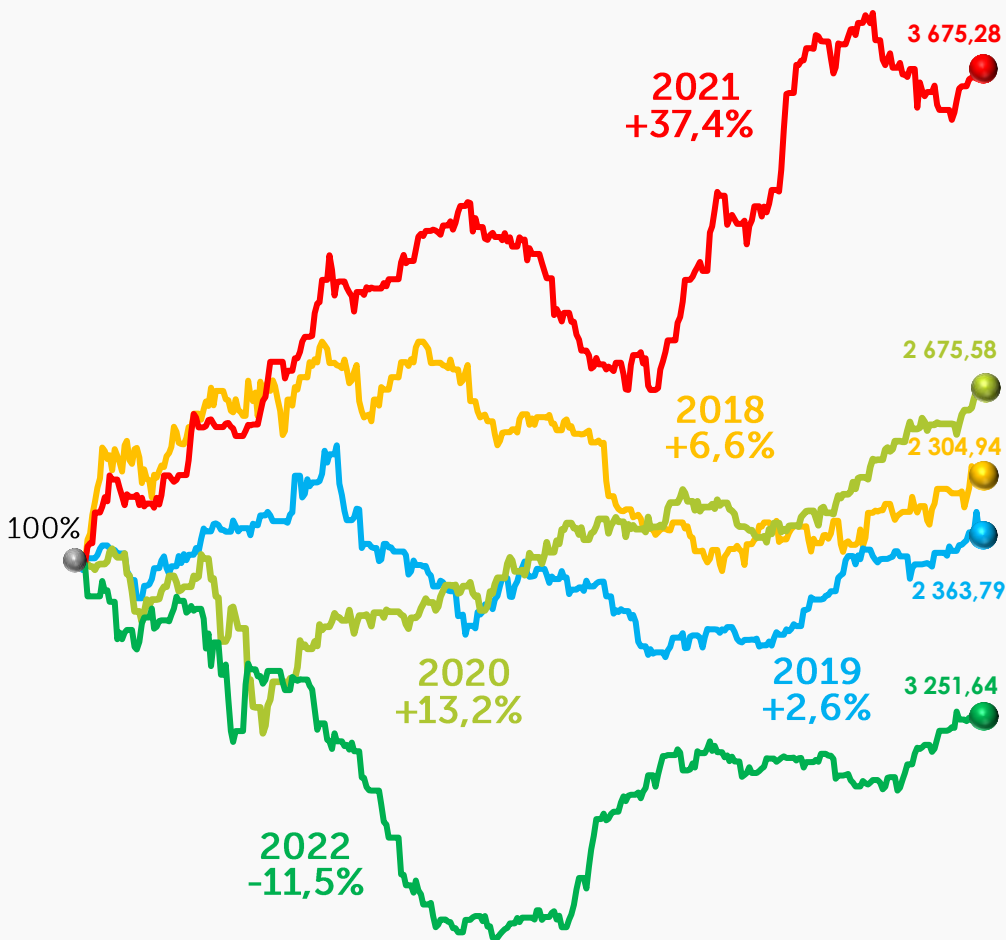
Динамика активных розничных инвесторов на вторичном рынке акций**



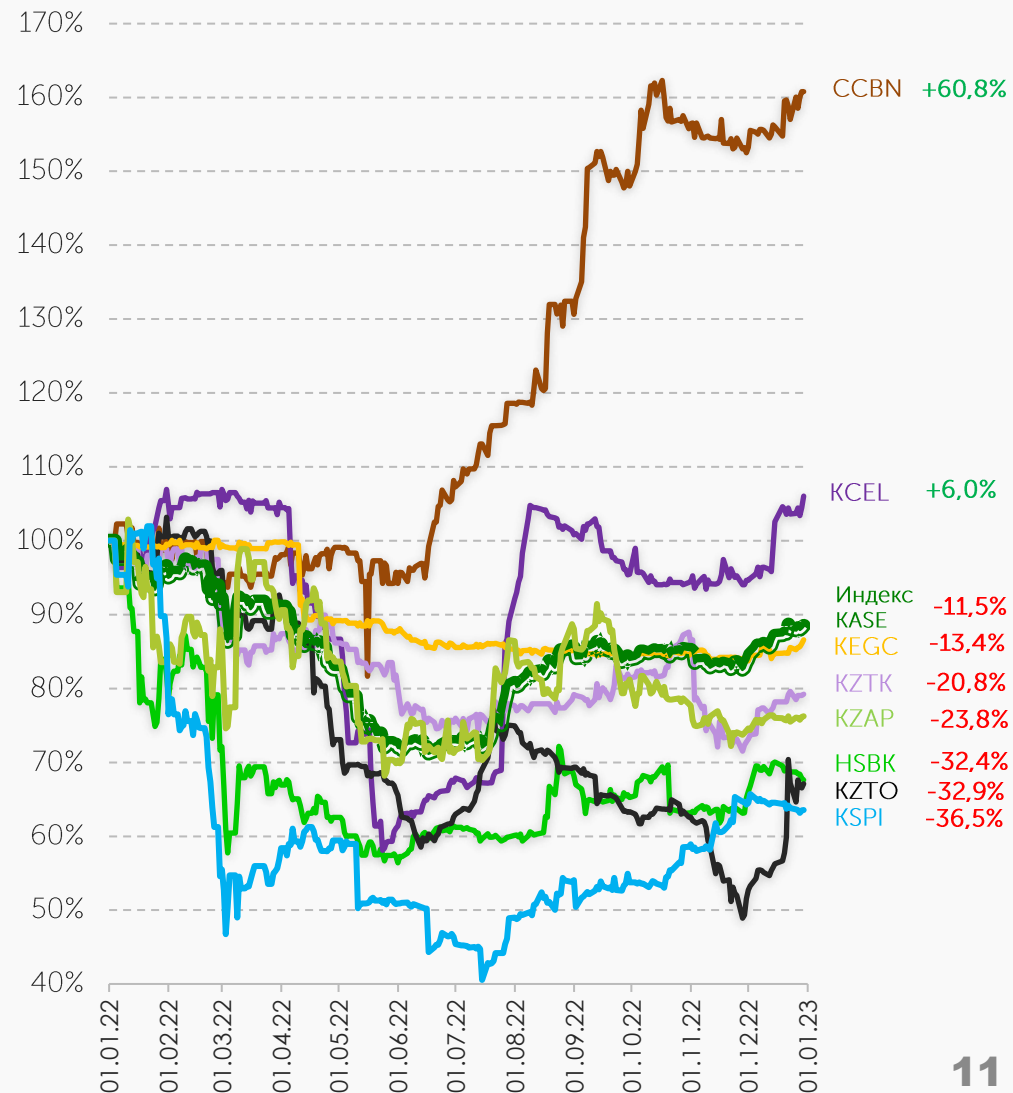
** с учетом индивидуальных счетов и уникальных кодов по омнибус счетам

Динамика Индекса KASE

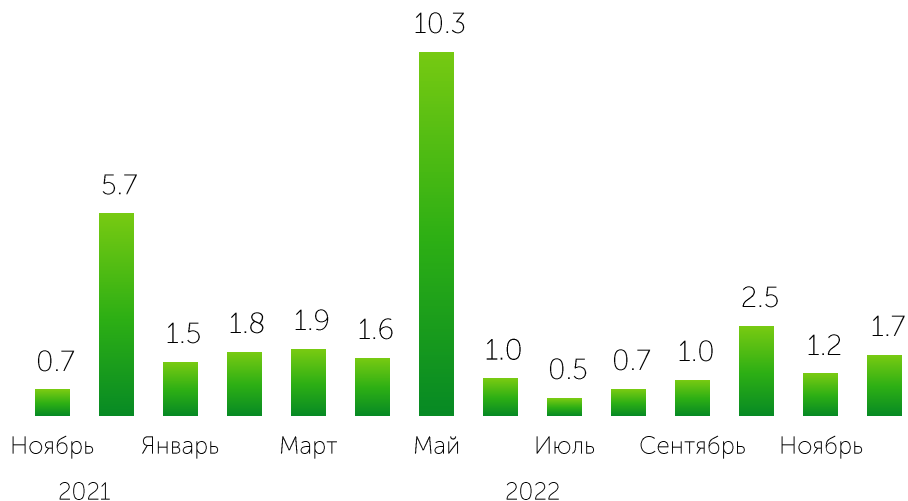
Индекс KASE в 2018 – 2022



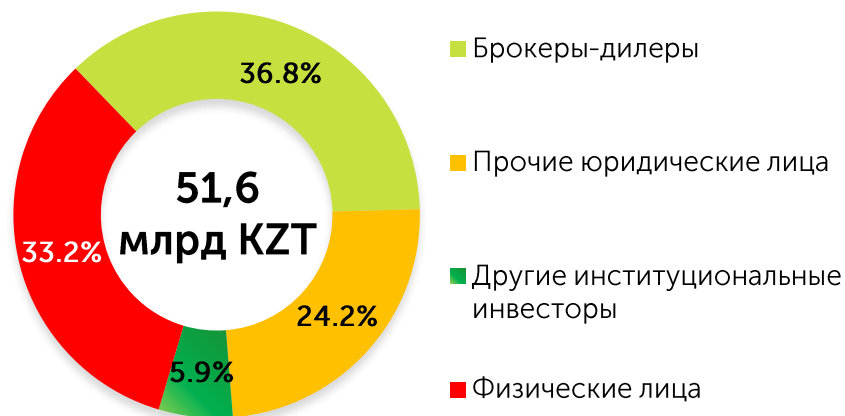
Динамика составляющих Индекса KASE



Объем сделок, млрд KZT



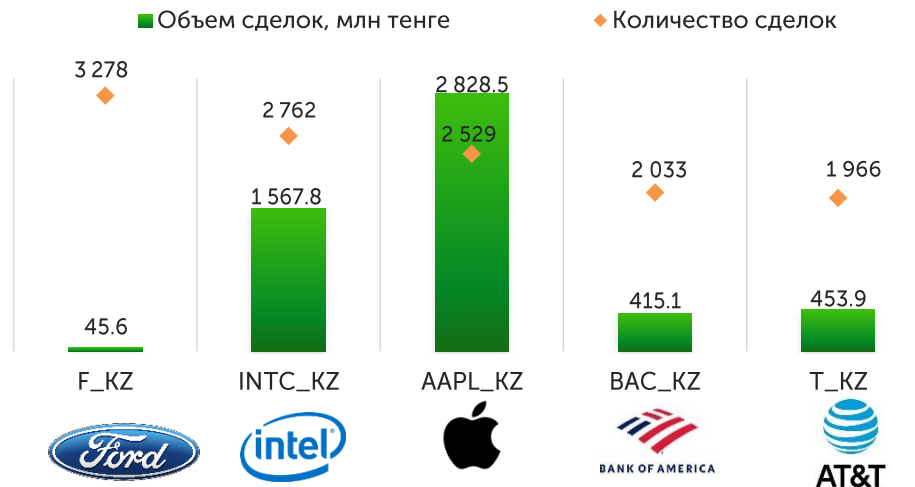
Доли основных категорий инвесторов за 2022 год*



* 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 2022 года



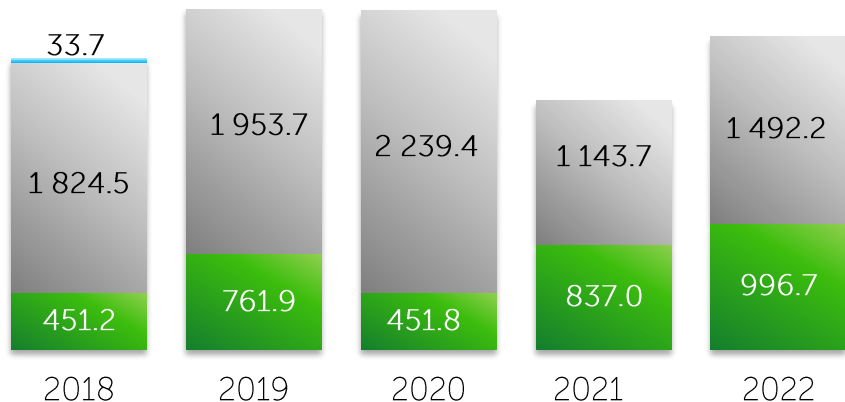
Основные показатели за 2022 год



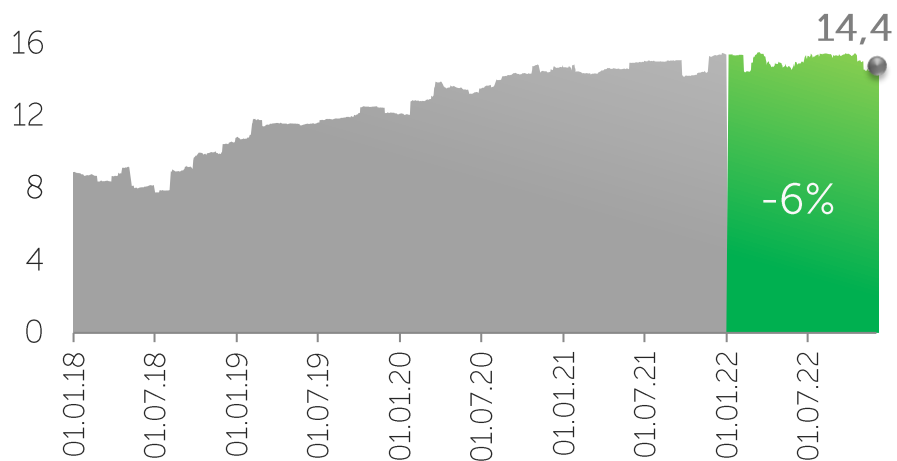
Рынок корпоративных облигаций

Объем сделок, млрд KZT

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



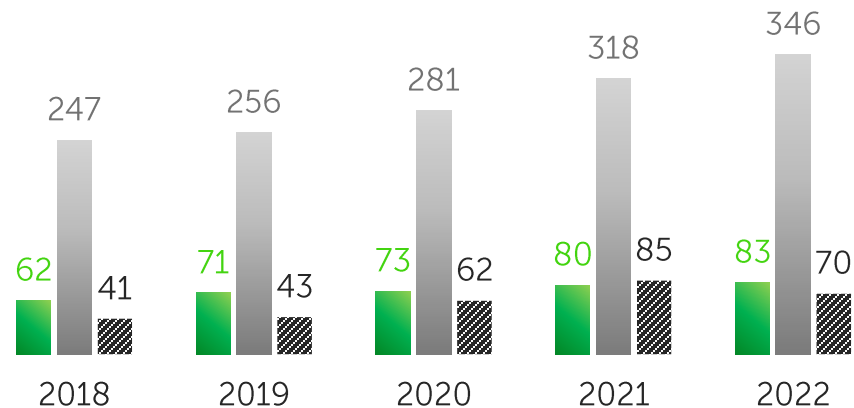
Объем корпоративного долга в обращении, трлн KZT



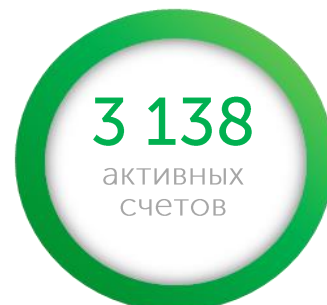
Источник: KASE

Новые листинги

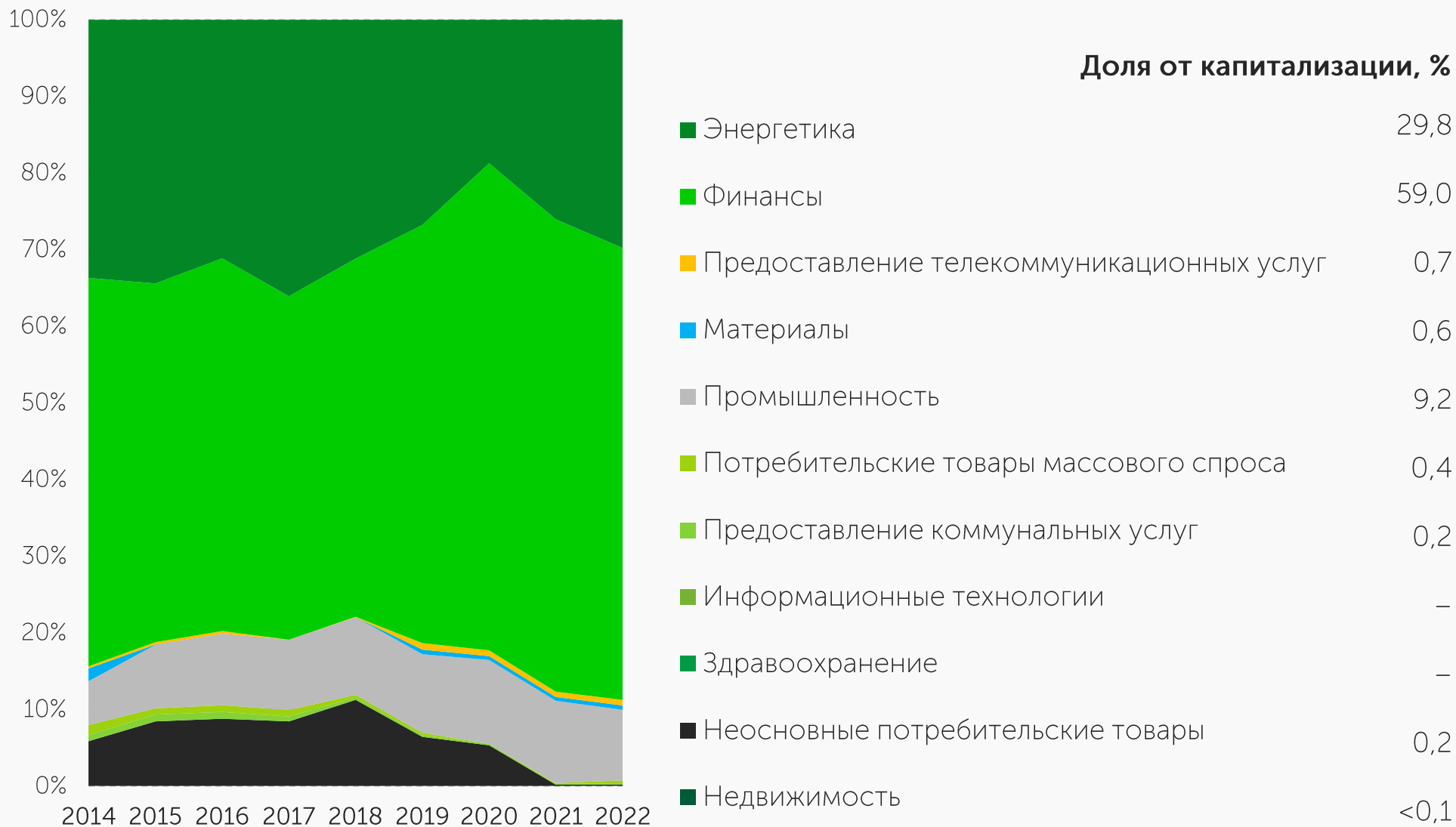
- Эмитенты
- Выпуски
- Листинги



Основные показатели за 2022 год



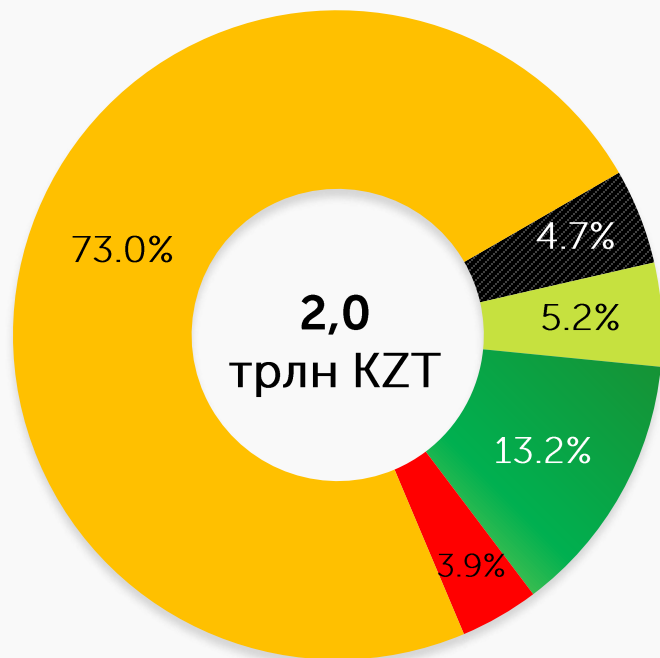
Отраслевая структура списков облигаций KASE



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

Инвесторская база рынка корпоративных облигаций KASE

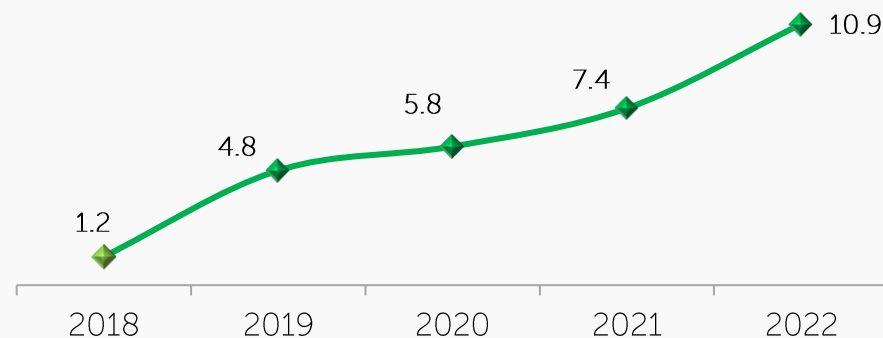
Доли основных категорий инвесторов на вторичном рынке за 2022 год*



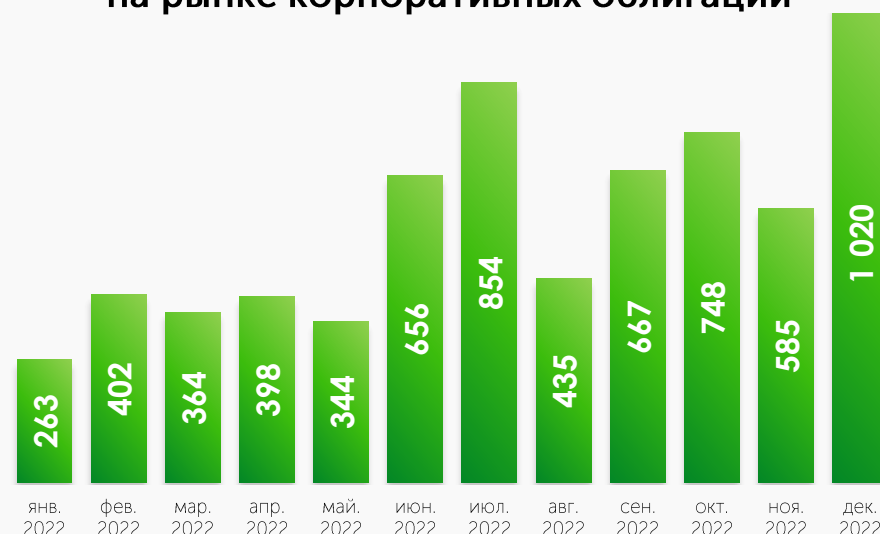
- Банки
- Брокеры-дилеры
- Др. институциональные инвесторы
- Физические лица
- Прочие юридические лица

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

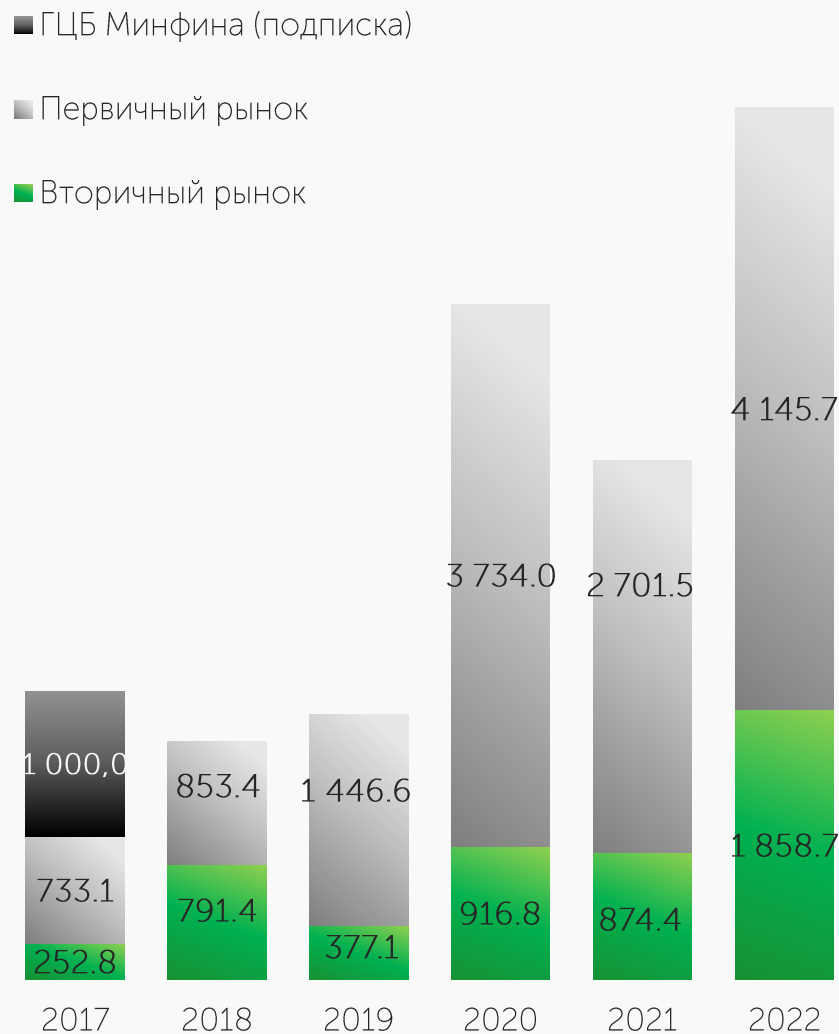
Доля нерезидентов в брутто-обороте, %



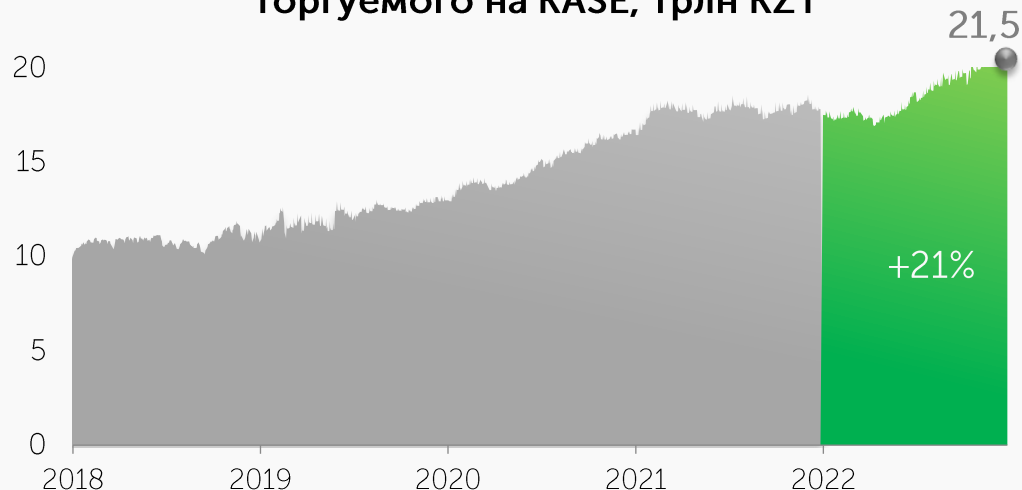
Динамика активных счетов на рынке корпоративных облигаций



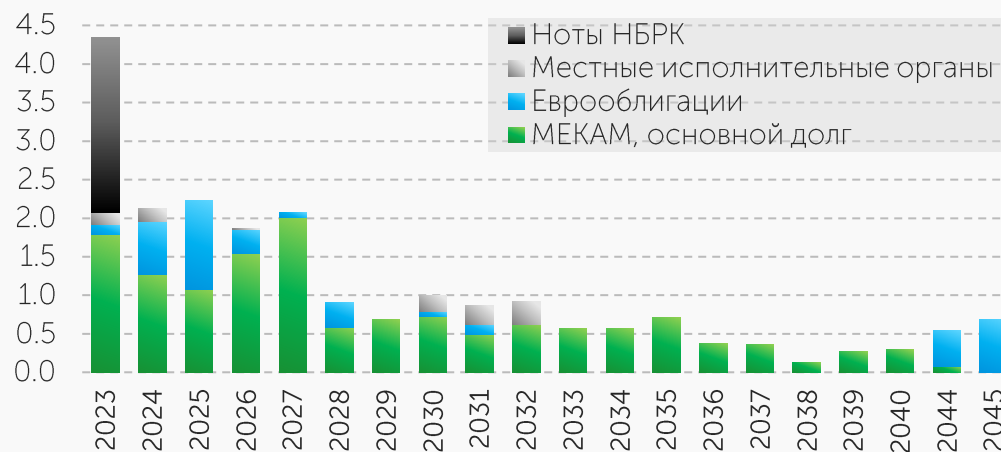
Динамика объема торгов, млрд KZT



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



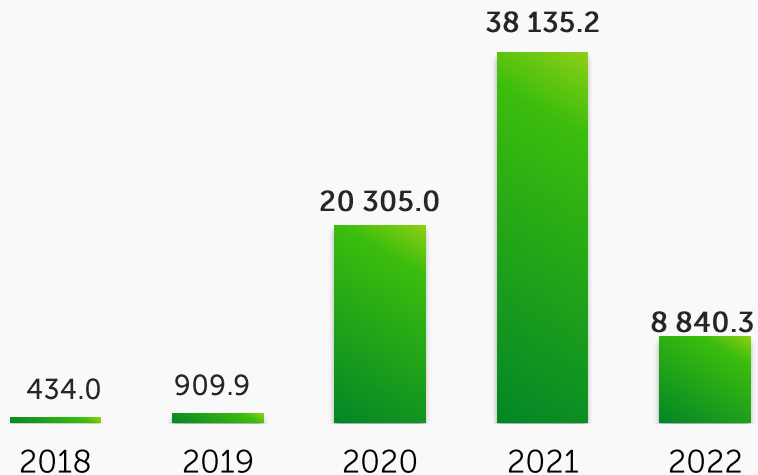
Динамика выплат по госдолгу, трлн KZT



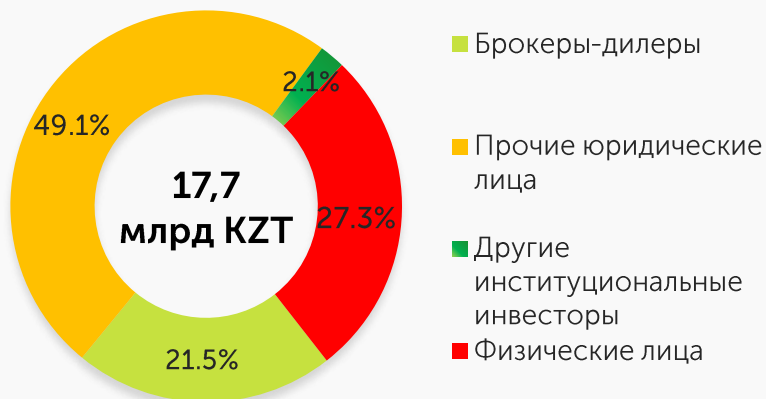
Источник: KASE

Ценные бумаги инвестиционных фондов

Объем сделок, млн KZT



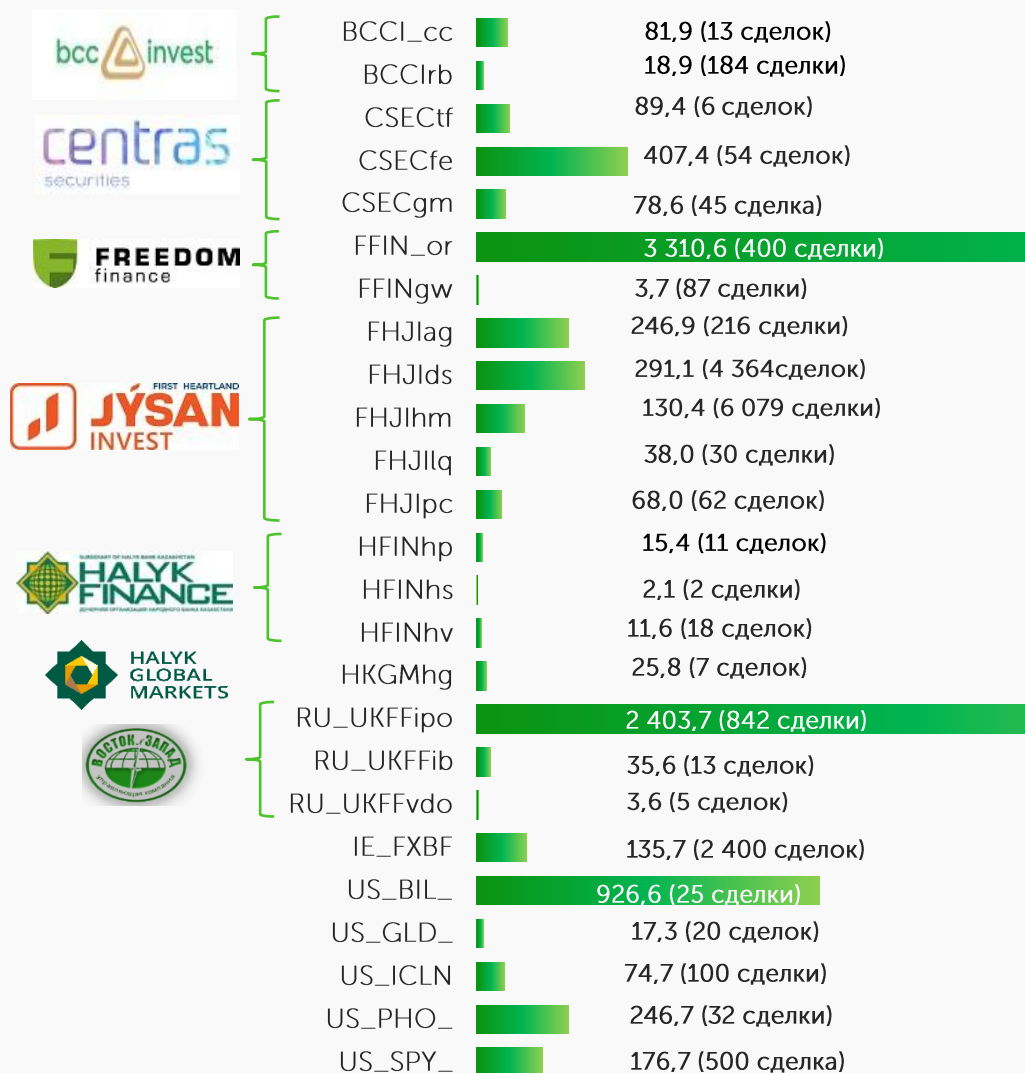
Доли основных категорий инвесторов за 2022 года*



* от общего брутто-оборота торгов ценными бумагами инвестиционных фондов

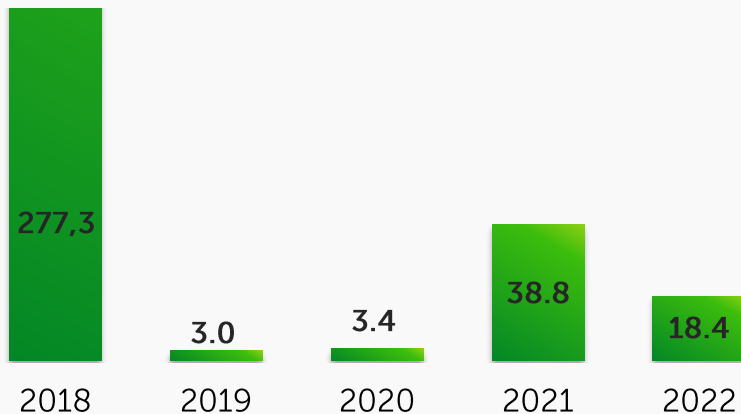
Источник: KASE

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

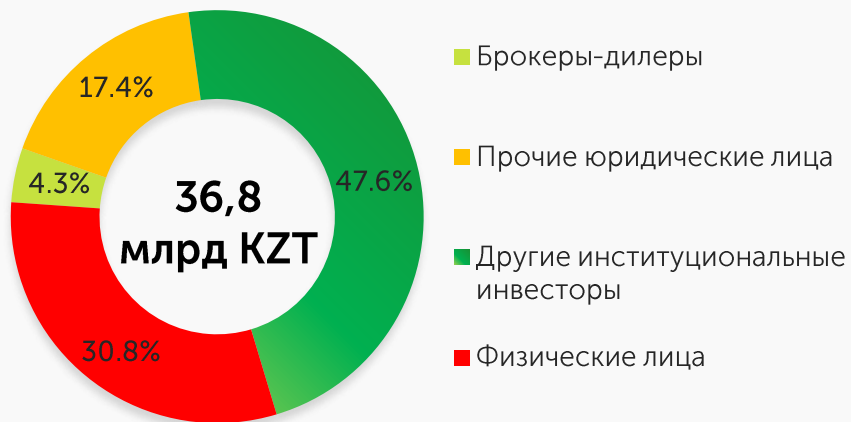


Производные ценные бумаги

Объем сделок, млрд KZT



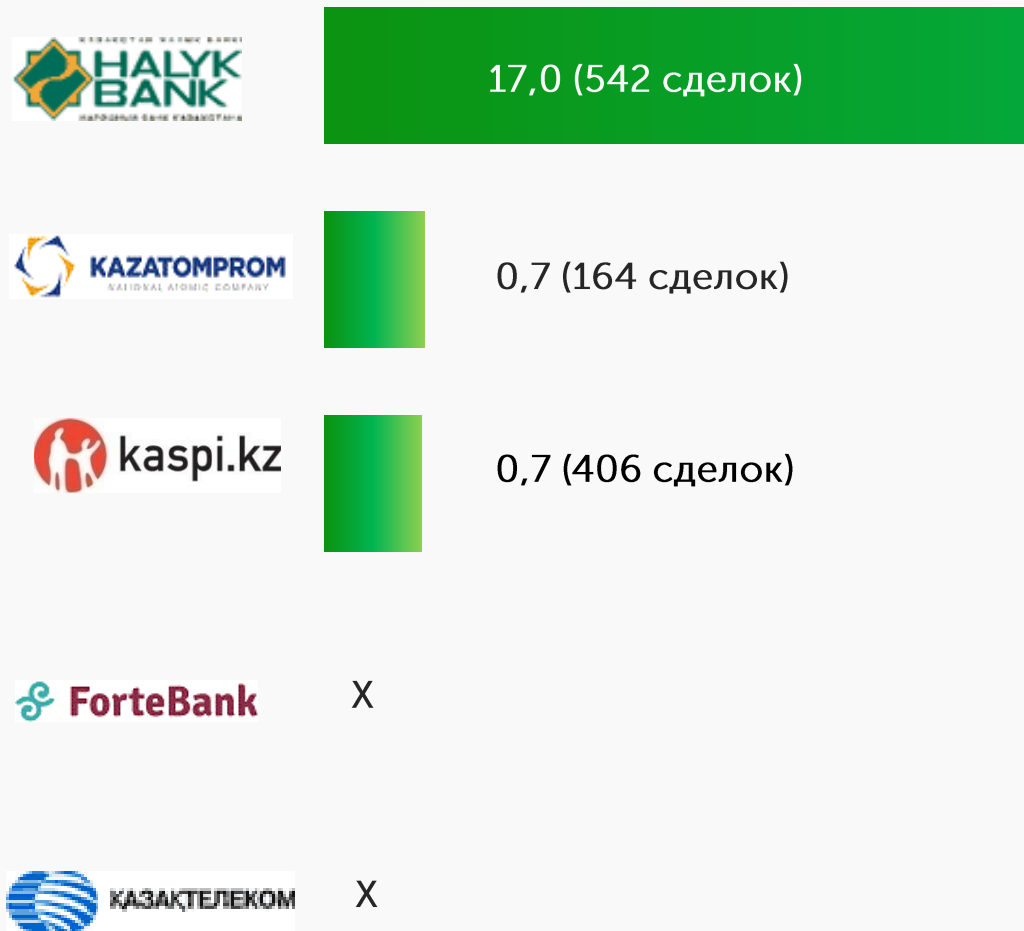
Доли основных категорий инвесторов за 2022 года*



* от общего брутто-оборота торгов производными ценными бумагами

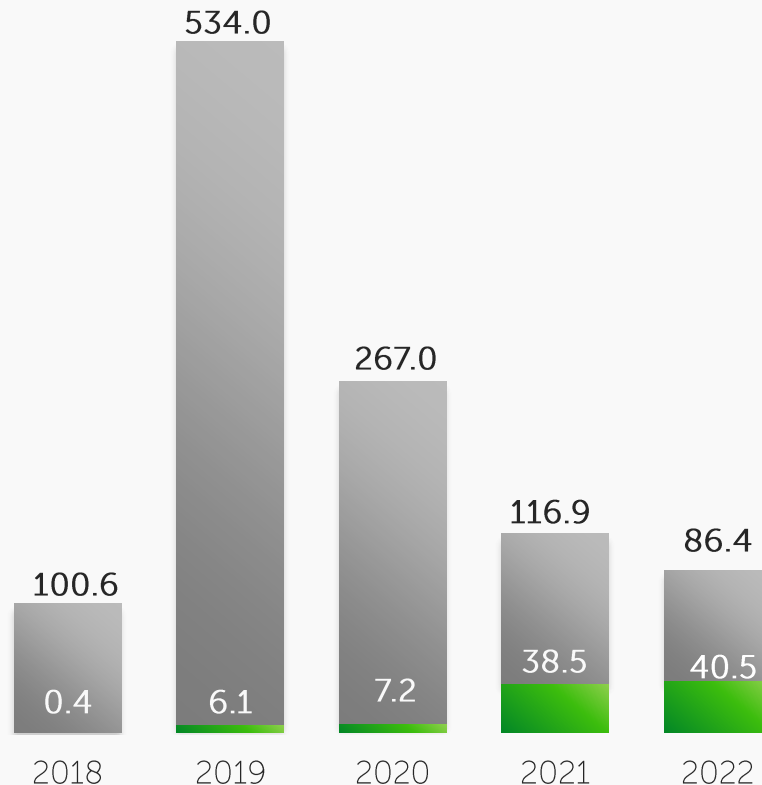
Источник: KASE

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



Объемы торгов, млрд KZT

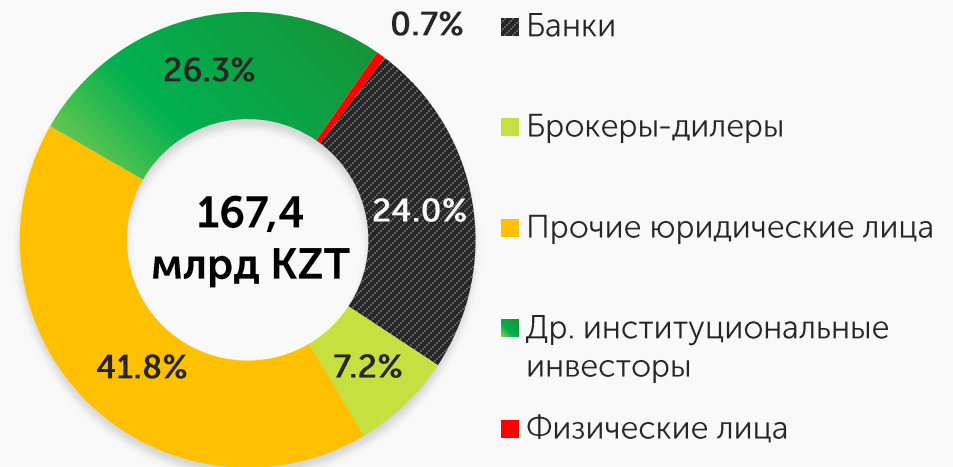
- Вторичный рынок
- Первичный рынок



На 01 января 2023 года в официальном списке KASE находятся **40 выпуск облигаций 4 организаций:**

- 16 выпусков Евразийского банка развития
- 13 выпусков Европейского банка реконструкции и развития
- 2 выпуска Международной финансовой корпорации
- 9 выпусков Азиатского банка развития

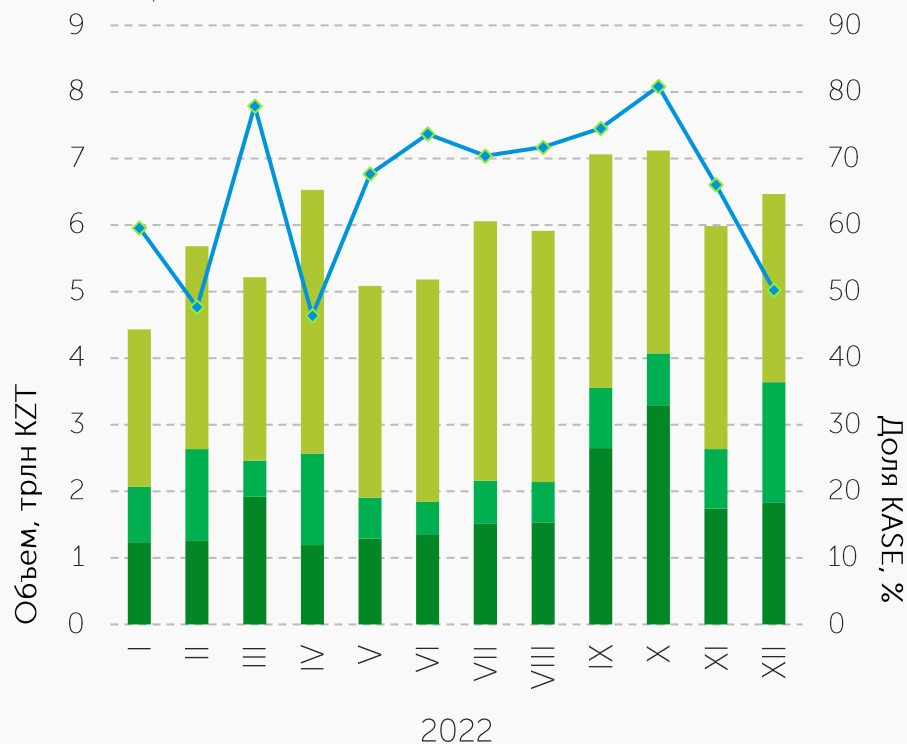
Доли основных категорий инвесторов за 2022 года*



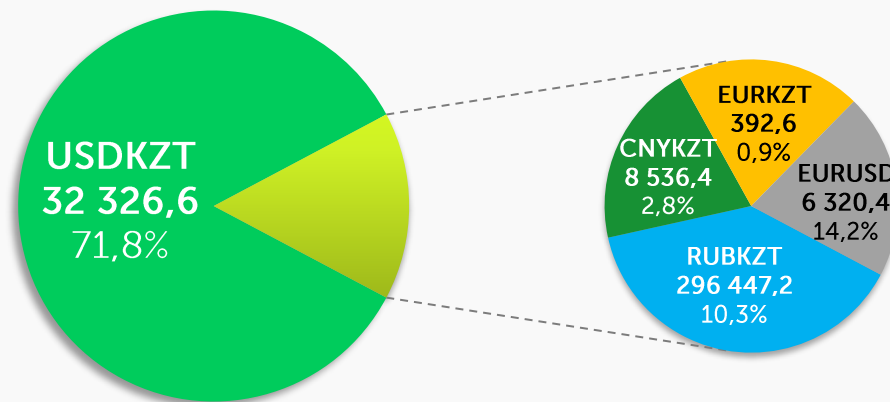
* от общего брутто-оборота торгов облигациями МФО, из расчета исключена позиция инициатора специализированных торгов

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

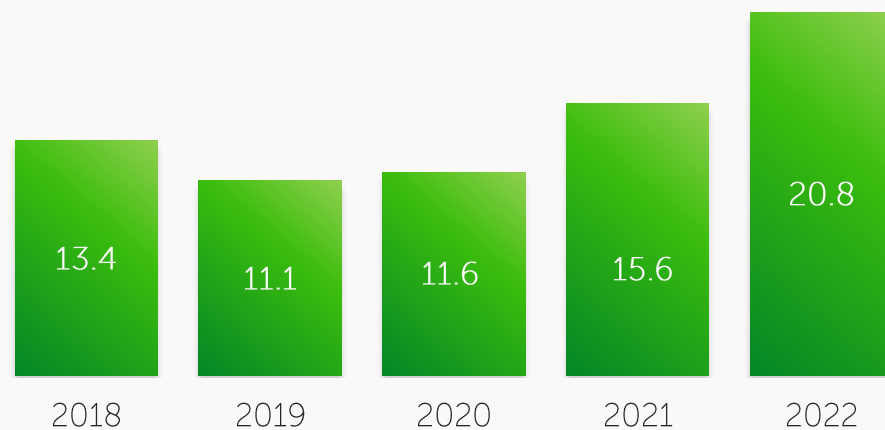


Структура биржевого рынка за 2022 года в объеме торгов. Объем в млн единиц валюты



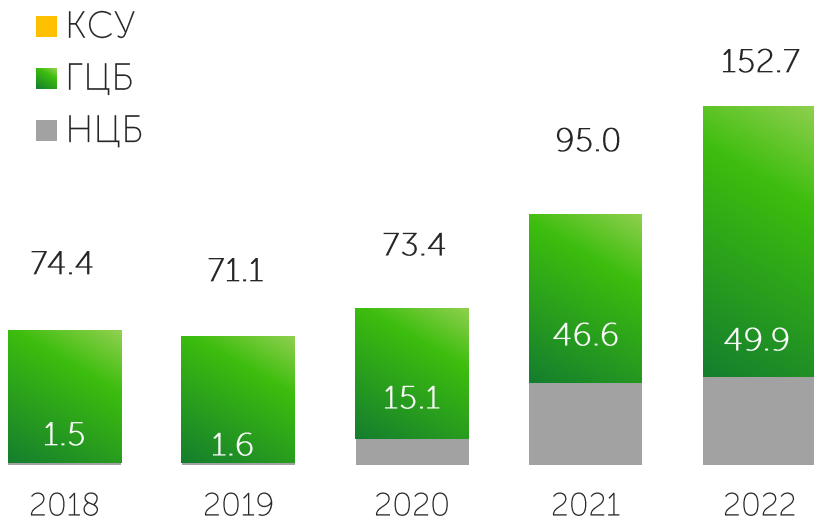
Примечание: доли рассчитаны от объема торгов в KZT

Объем торгов на спот-рынке, трлн KZT

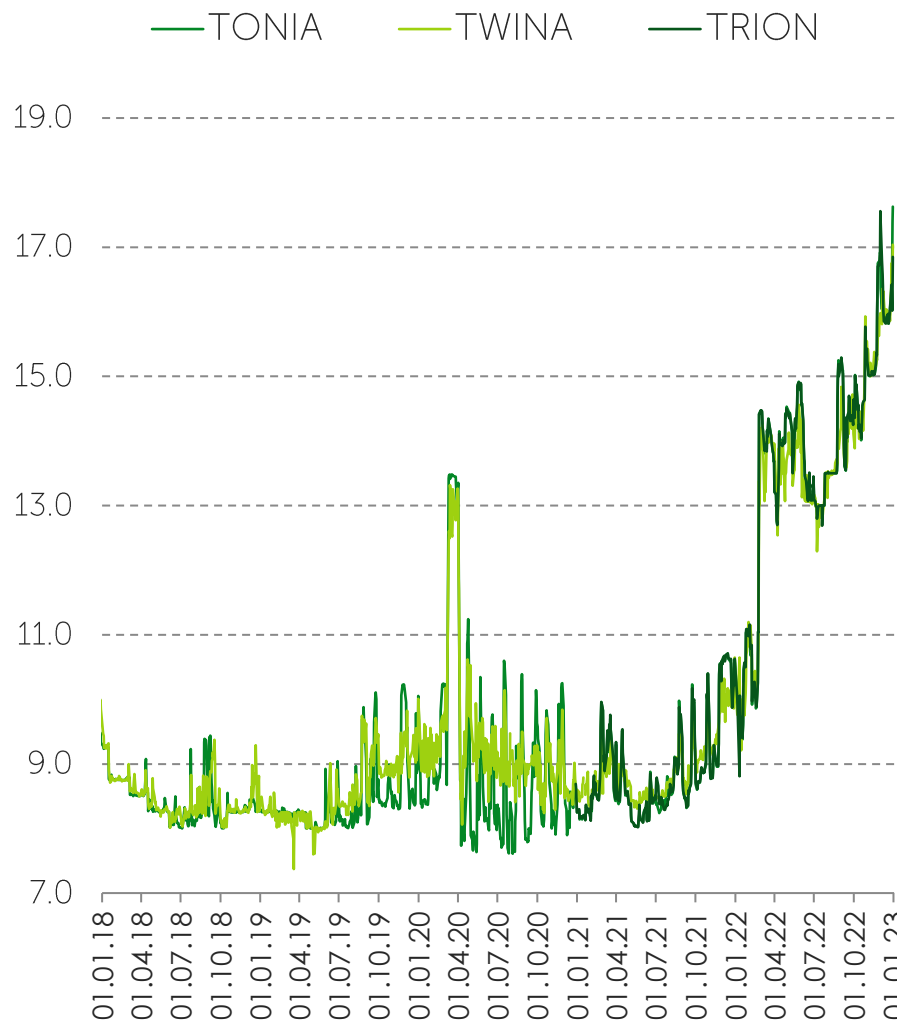


Рынок операций репо

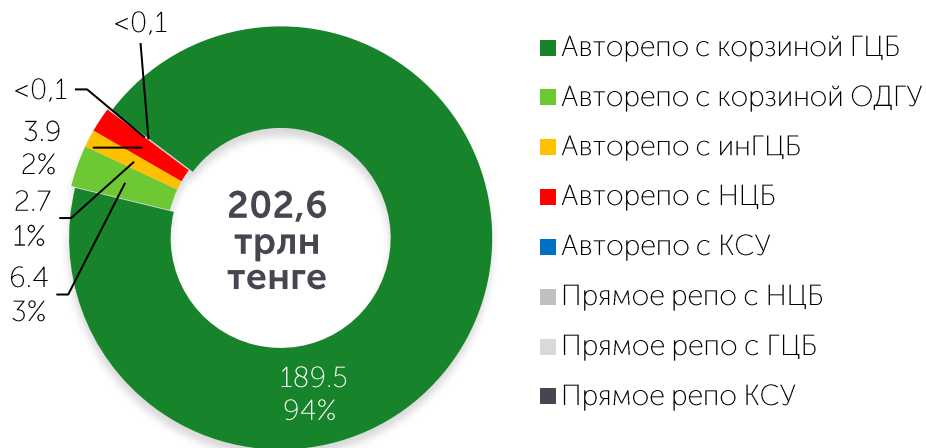
Объем торгов, трлн KZT



Индикаторы репо, % годовых



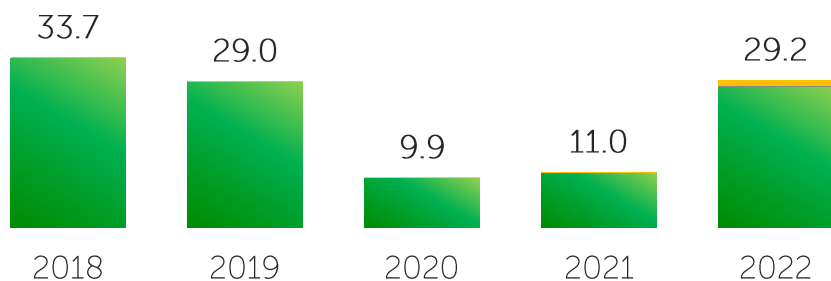
Инструменты рынка репо, трлн KZT



Рынок операций валютного свопа

Объем торгов, трлн KZT

RUBKZT EURKZT USDKZT



Индикаторы своп-рынка, % годовых

SWAP-1D SWAP-2D



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

- USDKZT_0_001 (21 673,4 млрд KZT / 74,2 %)
- USDKZT_0_002 (6 037,1 млрд KZT / 20,7 %)
- USDKZT_0_01W (32,0 млрд KZT / 0,1 %)
- USDKZT_0_01M (194,2 млрд KZT / 0,7 %)
- RUBKZT_0_001 (166,5 млрд KZT / 0,6 %)
- RUBKZT_0_002 (914,2 млрд KZT / 3,1 %)
- RUBKZT_1_001 (11,2 млрд KZT / 0,04 %)
- EURKZT_0_001 (139,2 млрд KZT / 0,5 %)
- 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