



Қазақстан қор биржасы  
Казахстанская фондовая биржа  
Kazakhstan Stock Exchange

# Типтік презентация

*2020 жылдың 01 мамыры*



## "Қазақстан қор биржасы" АҚ

49,1% - ҚРҰБ

3,4% – МОЕХ

44,4% - қаржылық ұйымдар

■ Ұлттық Банк

■ МОЕХ

■ Брокерлер

■ Банктер

■ Бөлшек инвесторлар

■ Басқасы



KASE Қазақстанның ұлттық валютасы – теңге енгізілгеннен кейін екі күннен соң 1993 жылдың 17 қарашасында «Қазақ банкаралық валюта биржасы» атауымен құрылған

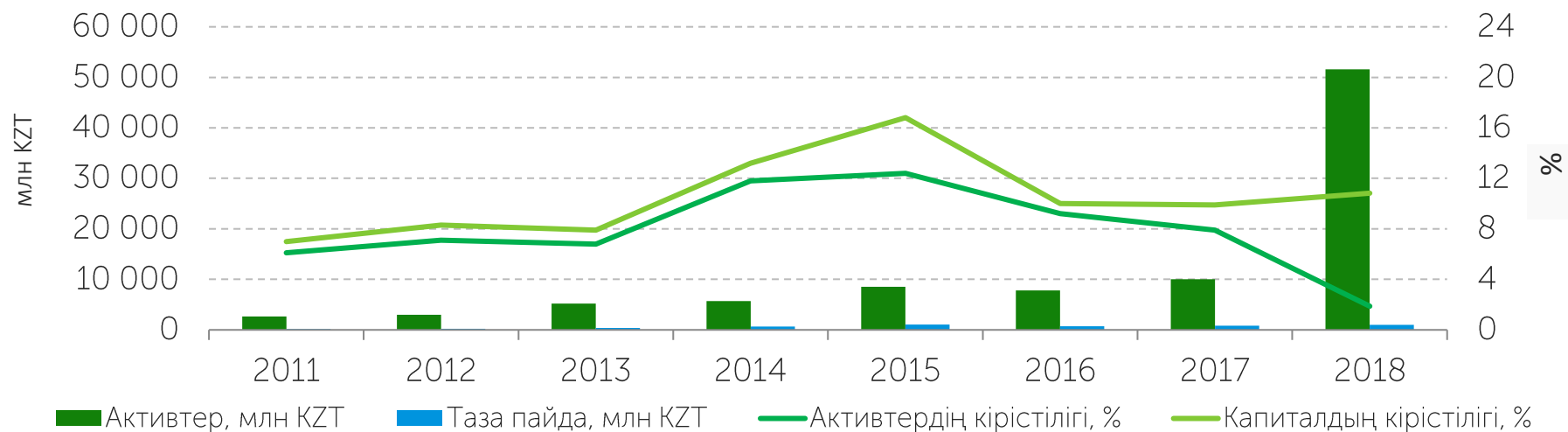
KASE – акционерлік қоғам ұйымдастырушылық-құқықтық нысанында қызмет ететін, коммерциялық ұйым

2020 жылдың 01 сәуіріндегі жағдай бойынша:

меншікті капитал	12 055,7 млн KZT
төленген жарғылық капитал	2 661,8 млн KZT
жарияланған акциялардың саны	5 000 000
орналастырылған акциялардың саны	974 373
кері сатып алынған акциялардың саны	13 329
акцияның теңгерімдік құны	12 544,4 KZT

# KASE кірістілігінің көрсеткіштері

	Активтер, млн KZT	Таза пайда, млн KZT	Активтердің кірістілігі, %	Капиталдың кірістілігі, %
2018	51 583,8	965,3	1,9	10,8
2017	10 009,5	792,8	7,9	9,9
2016	7 809,9	721,8	9,2	10,0
2015	8 516,9	1 060,1	12,4	16,8
2014	5 677,4	667,7	11,8	13,2
2013	5 224,8	352,9	6,8	7,9
2012	2 967,9	210,0	7,1	8,3
2011	2 661,5	162,1	6,1	7,0



Ескерту: ROA, ROE активтер мен капиталдың орташа жылдық көрсеткіштері негізінде есептелген

43

Қор

32

Валюта

23

Деривативтер

51

нарыққа қатысушылардың барлығы

25

екінші деңгейдегі банктер (27-ден)  
*ҚР резиденттері*

20

брокерлік компаниялар (20-дан)  
*ҚР резиденттері*

49

жергілікті қатысушылар

2

шетелдік қатысушылар  
(*"УНИВЕР Капитал" ЖШҚ, "Фридом Финанс" ИК ЖШҚ*)

2

ХҚҰ (*Мемлекетаралық банк,  
Еуразиялық даму банк*)

12

тікелей рұқсаттама қызметін көрсететін,  
қатысушылар (DMA)

## KASE жаңа мүшелері:

### 2019

- "CAIFC INVESTMENT GROUP" АҚ / валюта
- "Фридом Финанс" АҚ / валюта
- "Bank RBK" Банкі" АҚ / деривативтер
- "Шинхан Банк Қазақстан" АҚ / валюта
- "Қазпочта" АҚ / валюта

### 2018

- "Фридом Финанс" ИК ЖШҚ / қор
- "Цесна Капитал" АҚ / деривативтер
- "Tengri Bank" АҚ / қор

### 2017

- "УНИВЕР Капитал" ЖШҚ / қор және деривативтер
- "АТФБанк" АҚ / деривативтер
- "Еуразиялық Капитал" АҚ / деривативтер

## Биржалық нарықтың 2020 жылдың төрт айындағы көрсеткіштері

Биржалық нарықтың секторы	Көлемі, млрд KZT	Көлемі млн USD	Мәмілелердің орташа күндік саны	Мәмілелердің орташа күндік көлемі, млн KZT	Бір мәміленің орташа көлемі, млн KZT
<b>Бағалы қағаздар нарығы</b>	2 059,4	4 899,8	587	25 742,2	43,8
Акциялар	40,5	101,6	571	506,4	0,9
Корпоративтік борыштық БҚ	549,6	1 296,8	8	6 869,9	911,4
Қазақстандық МБҚ	1 454,4	3 466,2	6	18 179,9	3 239,2
ХҚҰ облигациялары	14,1	33,3	<1	176,4	705,7
Инвестициялық қорлардың БҚ	0,8	2,0	3	9,7	3,6
Туынды бағалы қағаздар	–	–	–	–	–
<b>Шетел валюталарының нарығы</b>	3 914,3	9 764,6	343	48 928,2	142,6
<b>Ақша нарығы</b>	34 788,5	87 087,1	488	434 856,2	891,3
Репо операциялары	29 855,0	74 606,4	465	373 188,0	802,9
Валюталық своп операциялары	4 933,5	12 480,7	23	61 668,2	2 671,1
<b>Деривативтер нарығы</b>	–	–	–	–	–
<b>БАРЛЫҒЫ</b>	40 762,1	101 751,6	1 418	509 526,6	359,3

# Нарықтың көлемі мен құрылымы

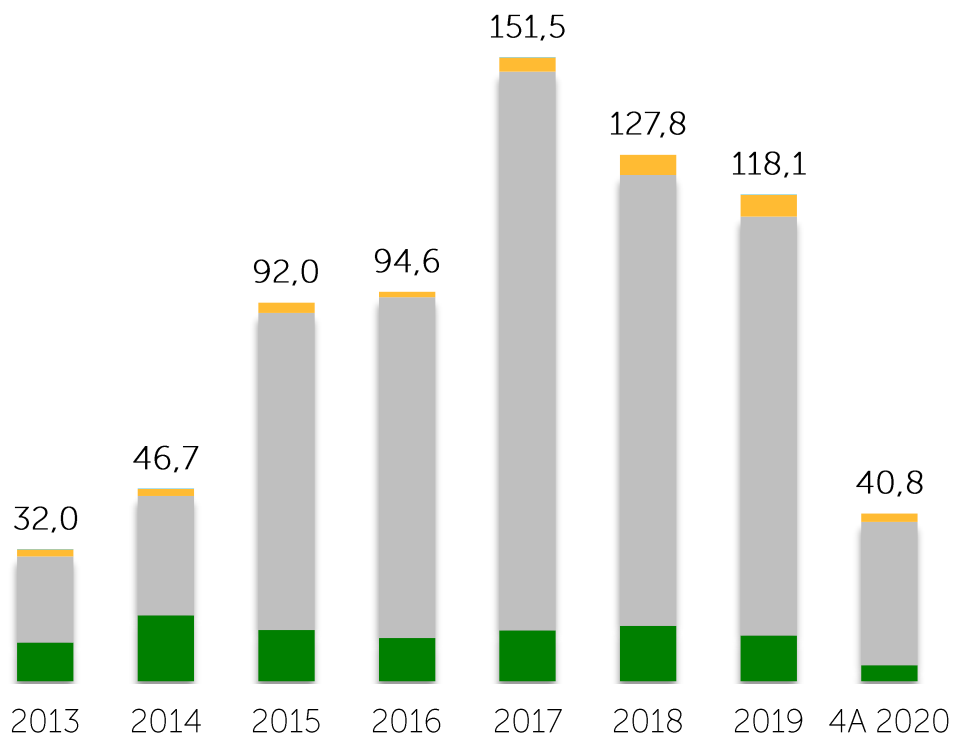
Шетел валюталарының нарығы

Ақша нарығы

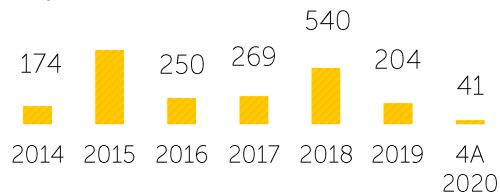
Бағалы қағаздар нарығы

Деривативтер нарығы

Сауда-саттық көлемінің секторлар бойынша динамикасы, трлн KZT



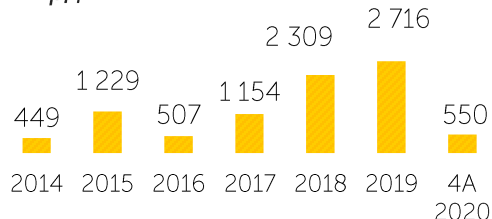
млрд KZT



Акциялар

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

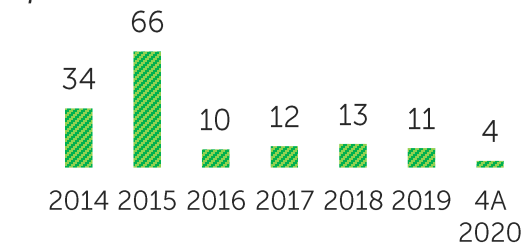
млрд KZT



Корпоративтік облигациялар

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

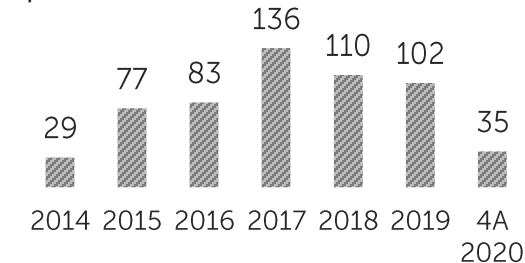
трлн KZT



Шетелдік валюталар нарығы

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

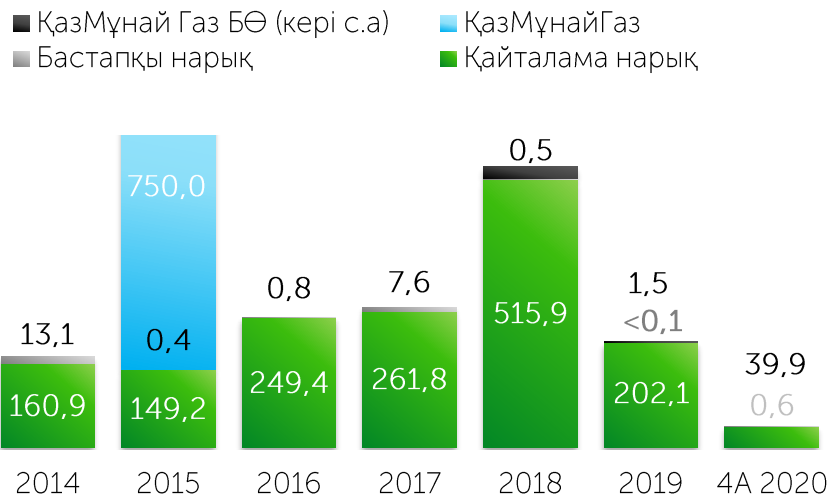
трлн KZT



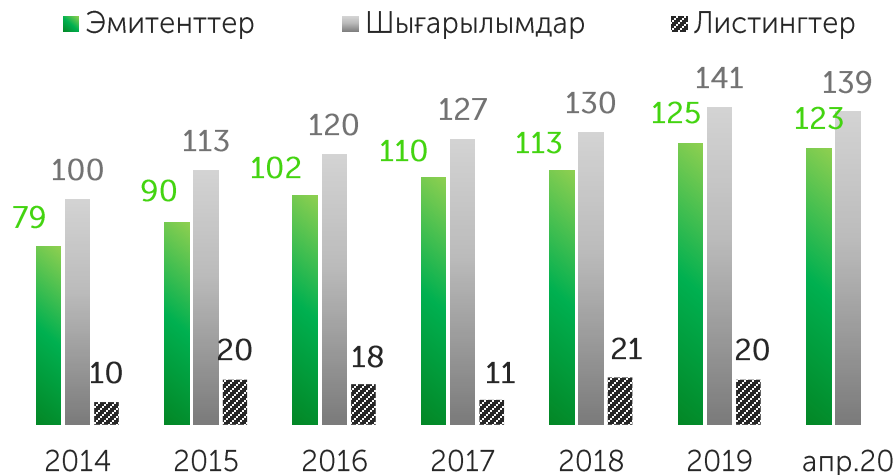
Ақша нарығы

2019	-7%
2018	-19%
2017	+64%
2016	+8%
2015	x3
2014	+39%

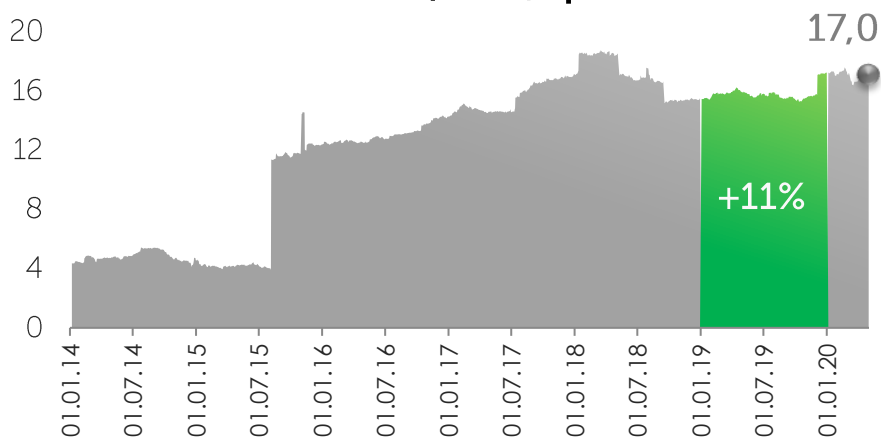
## Мәміле көлемі, млрд. KZT



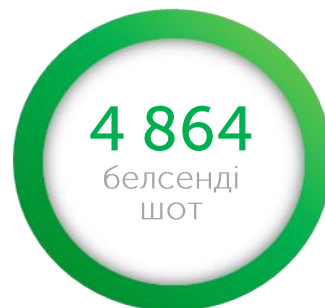
## Жаңа листингілер



## Акциялар нарығының капитализациясы, трлн KZT



## 2020 жылдық 4A негізгі көрсеткіштер



**-19,7%**  
2019 жылдың 4A салыстырғанда



**+21,4%**  
2019 жылдың 4A салыстырғанда

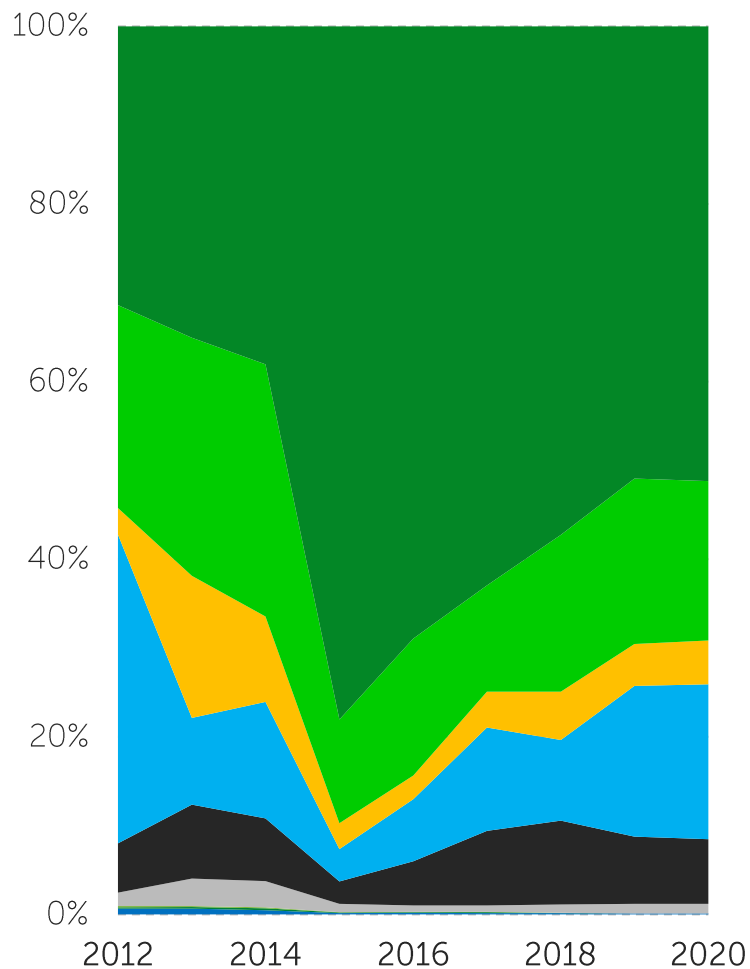


**+26,9%**  
2019 жылдың 4A салыстырғанда



# Акциялардың салалық құрылымы

Капитализациядағы үлесі, %

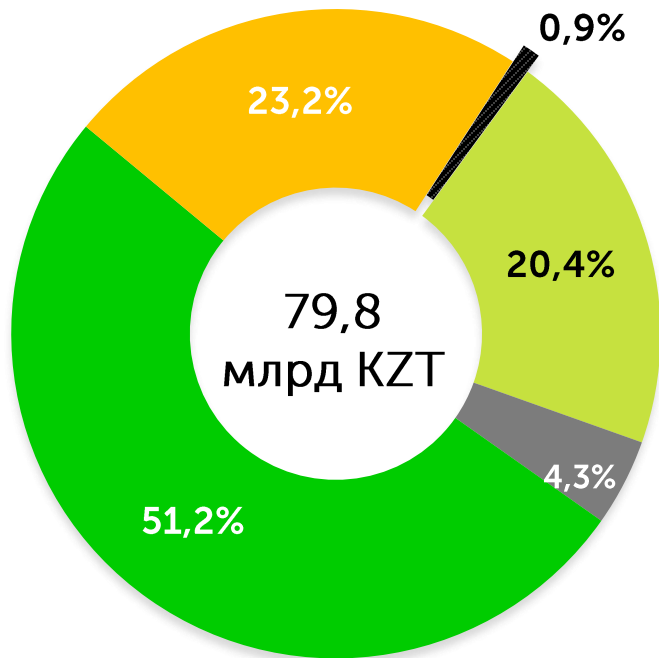


Энергетика	52,2
Қаржылар	18,4
Телекоммуникациялық қызметтер көрсету	5,0
материалдар	15,8
Өндіріс	7,5
Жаппай сұранысқа ие тауарлар	1,1
Коммуналдық қызметтер көрсету	<0,1
Ақпараттық технологиялар	0
Денсаулық сақтау	0
Негізгі емес тұтынушылық тауарлар	0,1

Ескерту: классификатор ретінде "Global Industry Classification Standard (GICS)®" қолданылған  
 Дереккөз: KASE

# Акциялар: инвесторлық база

Қайталама нарықтағы инвесторлардың негізгі санаттарының 2020 жылдың 4А үлестері\*

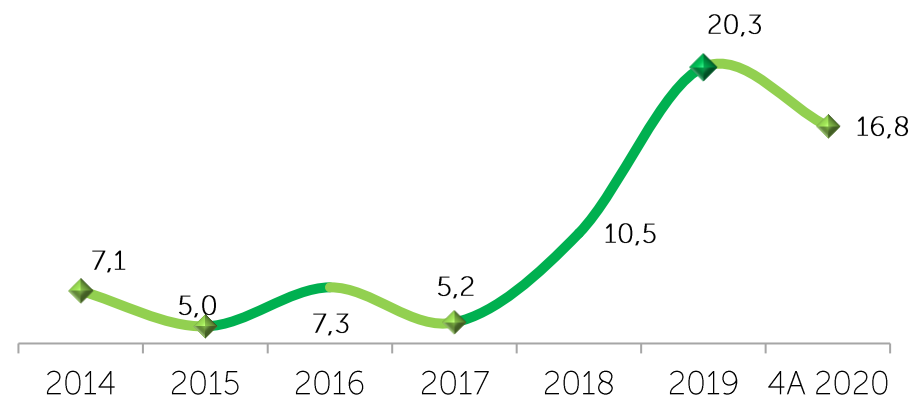


- ЕДБ
- Брокерлер
- Өзге институционалдық инвесторлар
- Жеке тұлғалар
- Басқа да заңды тұлғалар

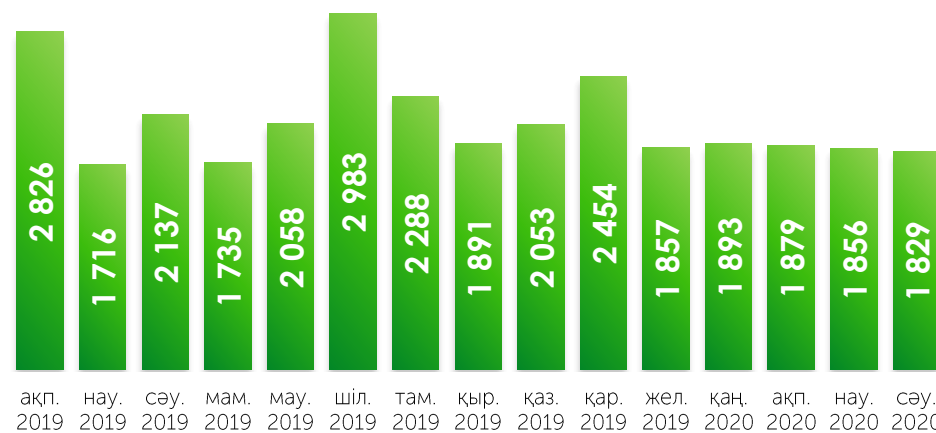
\* қайталама нарықтағы акциялардың сауда-саттықтарының жалпы брутто-айналымынан

Дереккөз: KASE

Резидент еместердің брутто-айналымындағы үлесі, %

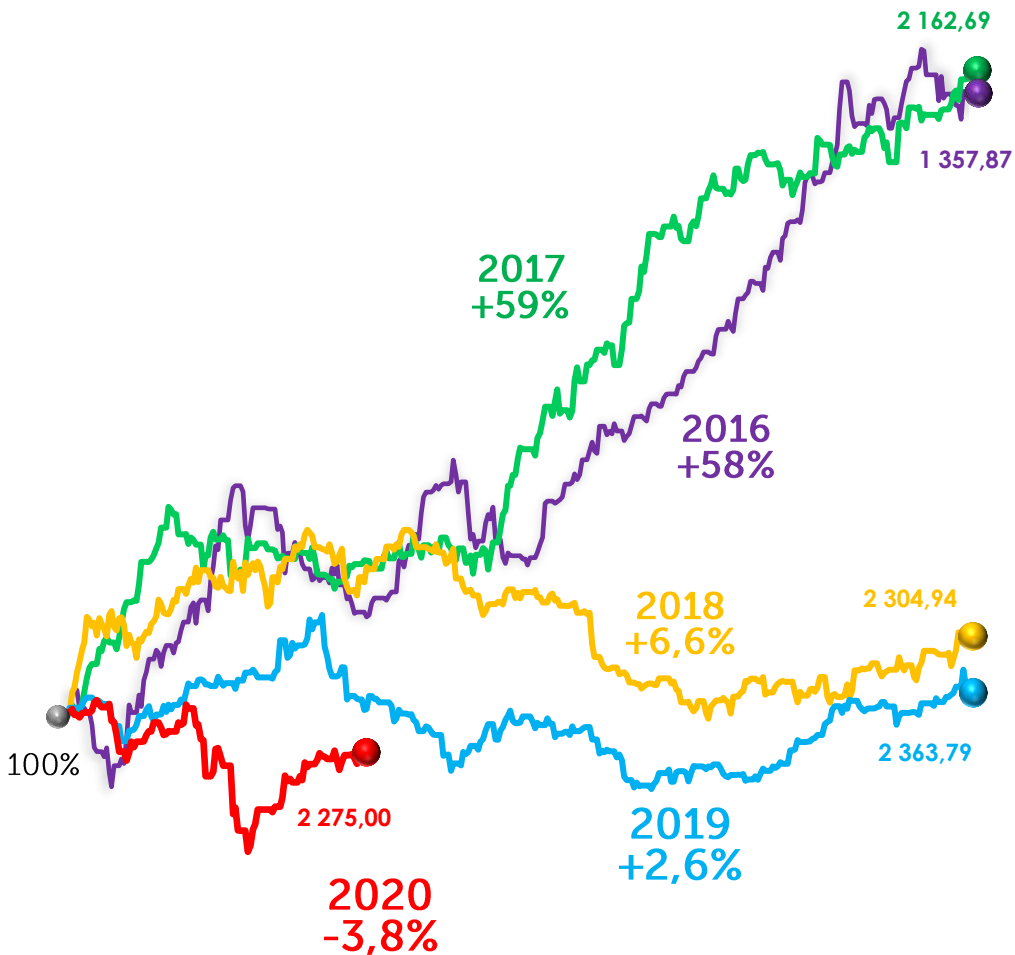


Акциялар нарығындағы бөлшек инвесторлардың белсенді шоттарының динамикасы

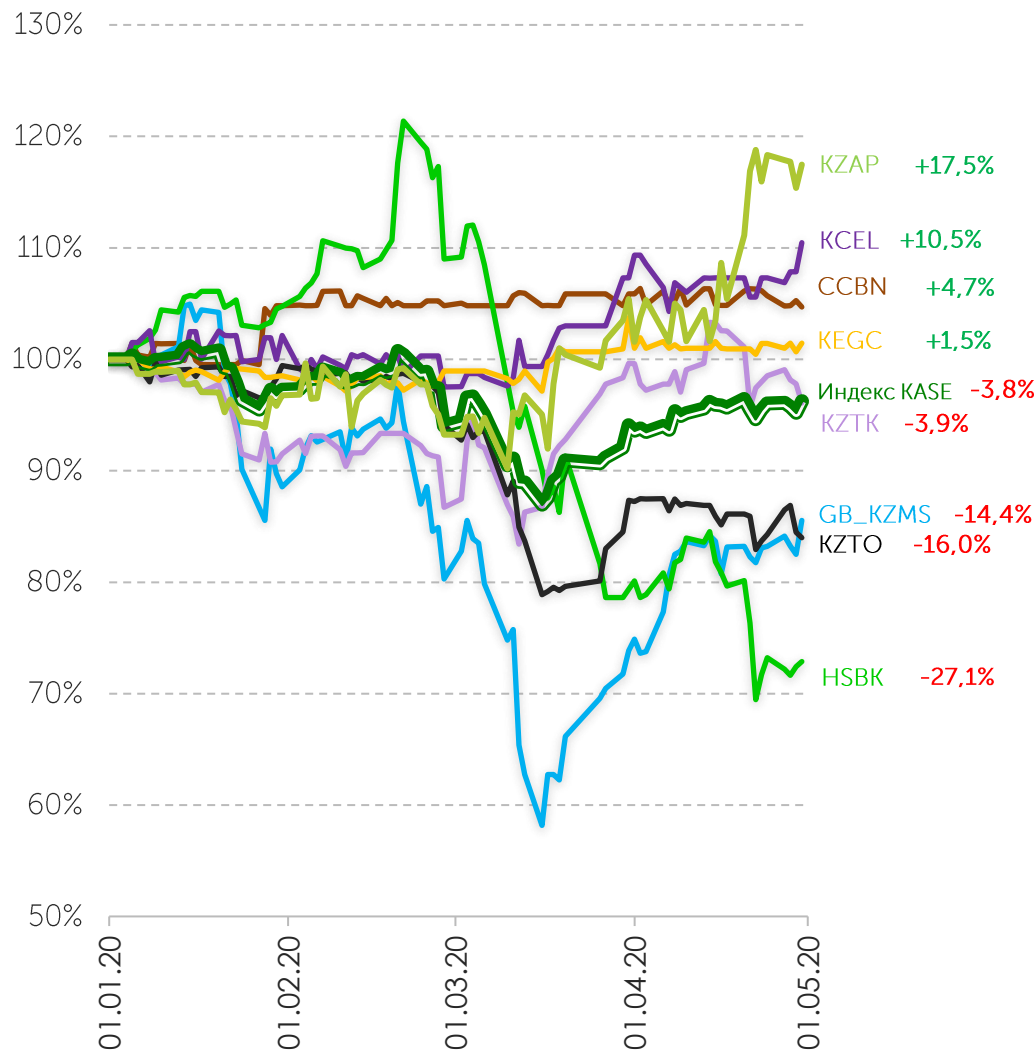


# KASE Индексінің динамикасы

## KASE Индексі 2016-4А 2020



## KASE Индексін құраушылардың динамикасы

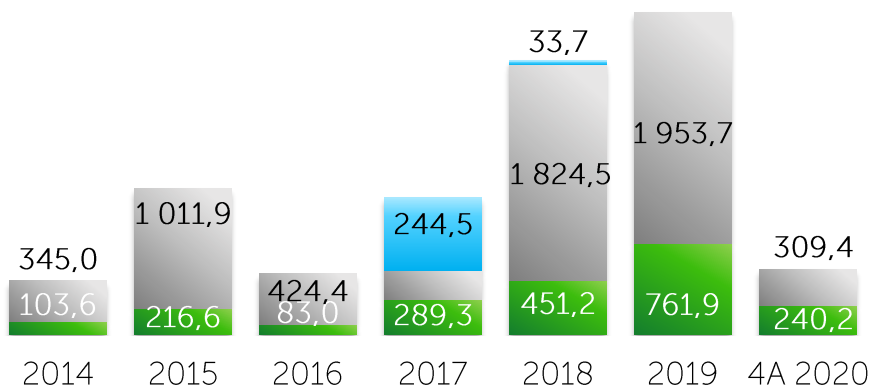


Дереккөз: KASE, Bloomberg

# Корпоративтік облигациялар

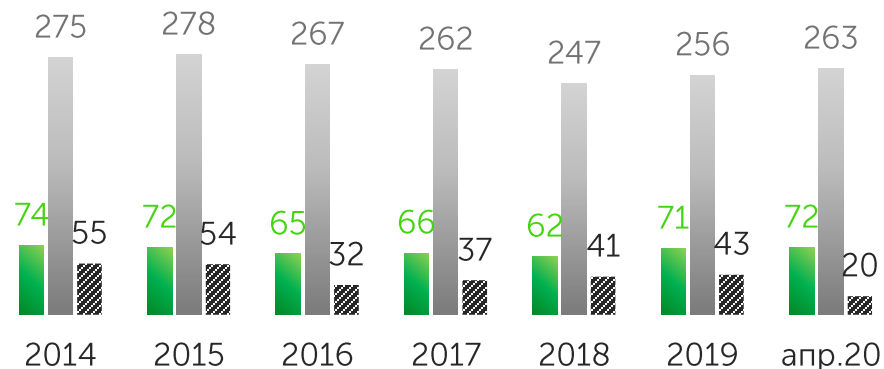
## Мәміле көлемі, млрд KZT

- Банктік секторды қаржылай қолдау бағдарламасы
- Бастапқы нарық
- Қайталама нарық

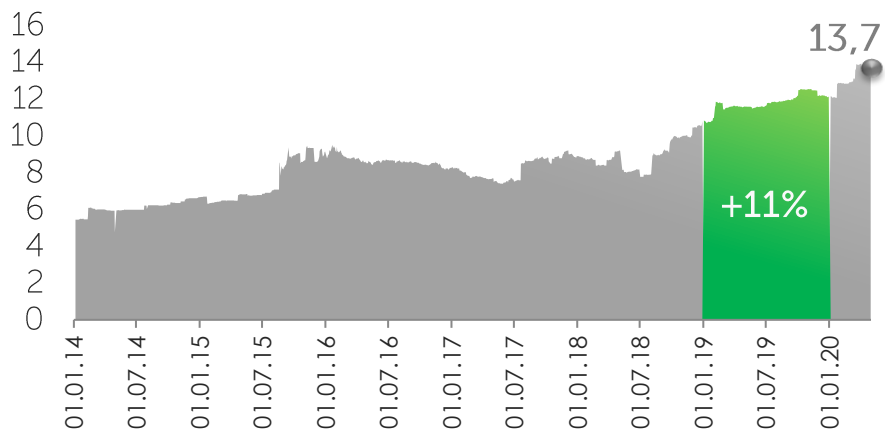


## Жаңа листингілер

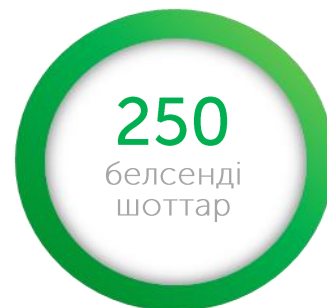
- Эмитенттер
- Шығарылымдар
- Листингтер



## Айналымдағы корпоративтік борыштың көлемі, трлн KZT



## 2020 жылдық 4А негізгі көрсеткіштер



**-36,1%**  
2019 жылдың 4А салыстырғанда

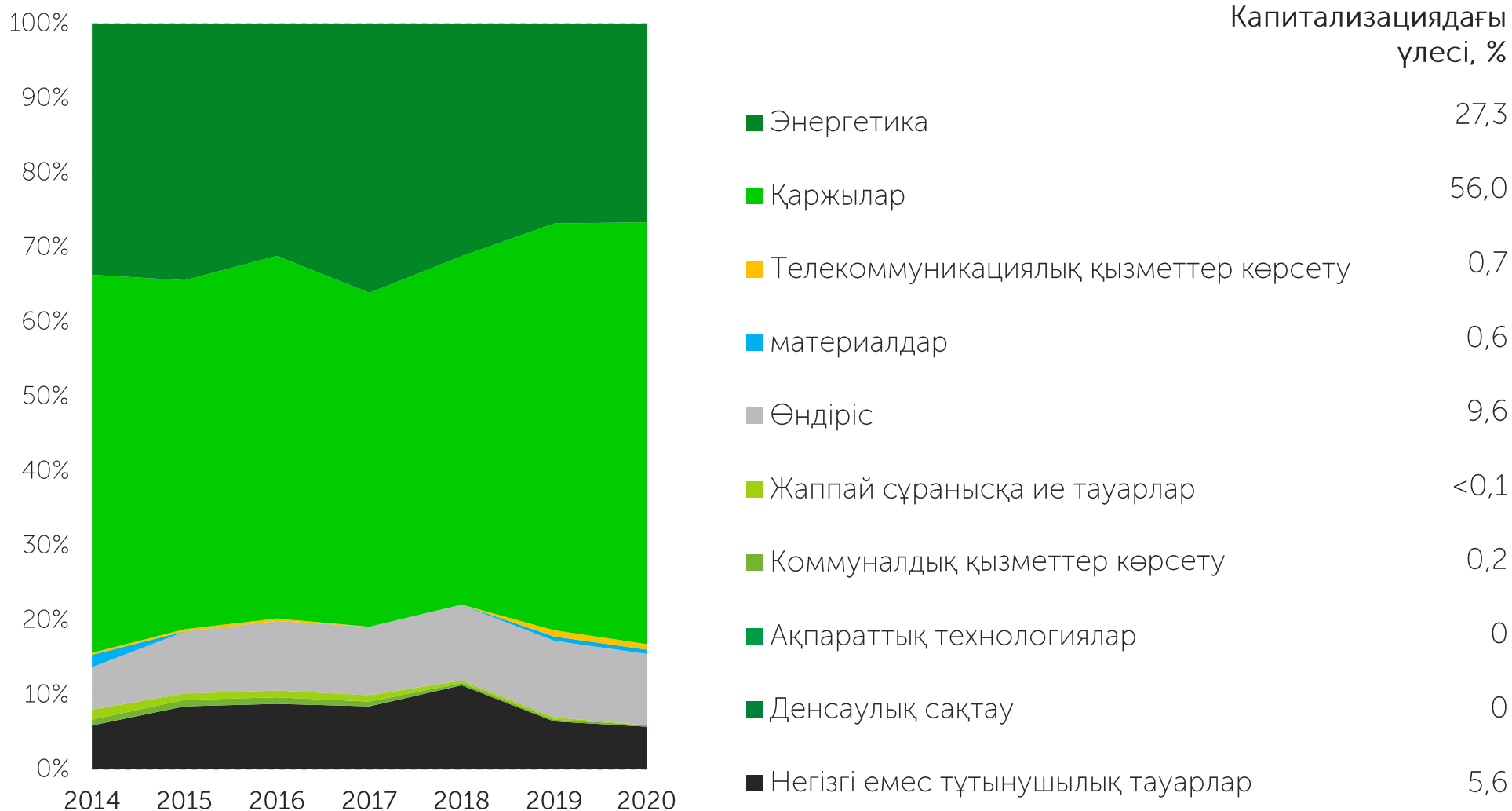


**-58,4%**  
2019 жылдың 4А салыстырғанда



**-34,3%**  
2019 жылдың 4А салыстырғанда

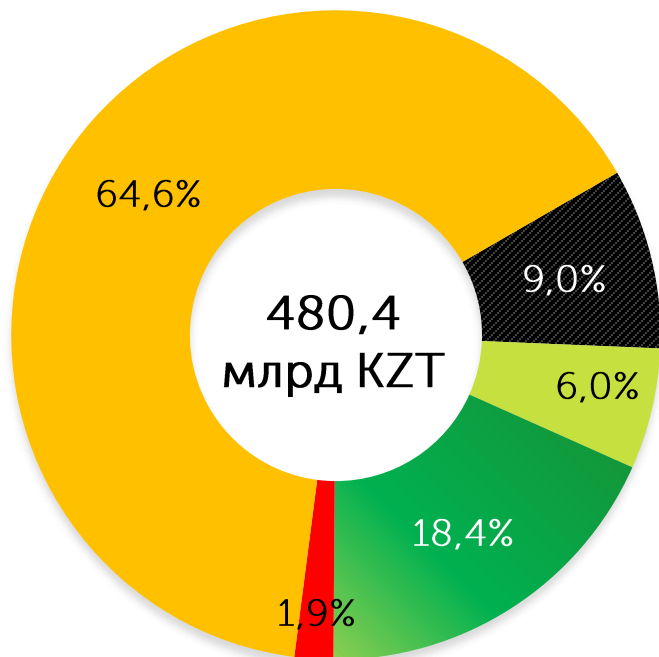
# Облигациялар тізімдерінің салалық құрылымы



Классификатор ретінде "Global Industry Classification Standard (GICS)<sup>®</sup>" қолданылған

# Корпоративтік облигациялар: инвесторлық база

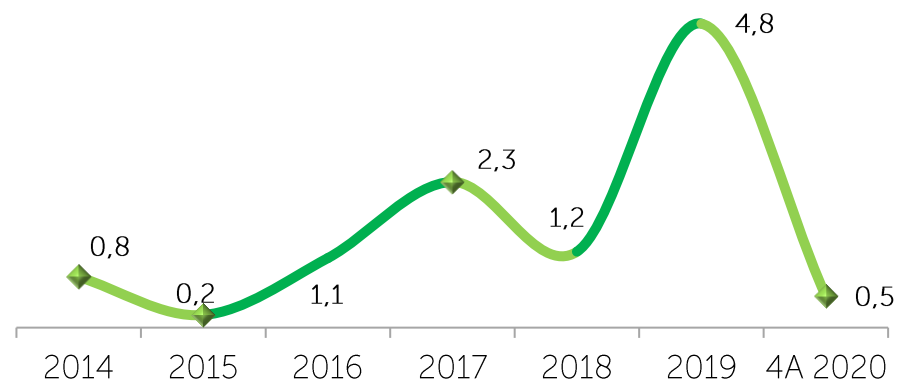
Қайталама нарықтағы инвесторларың негізгі санаттарының 2020 жылдың 4А үлестері\*



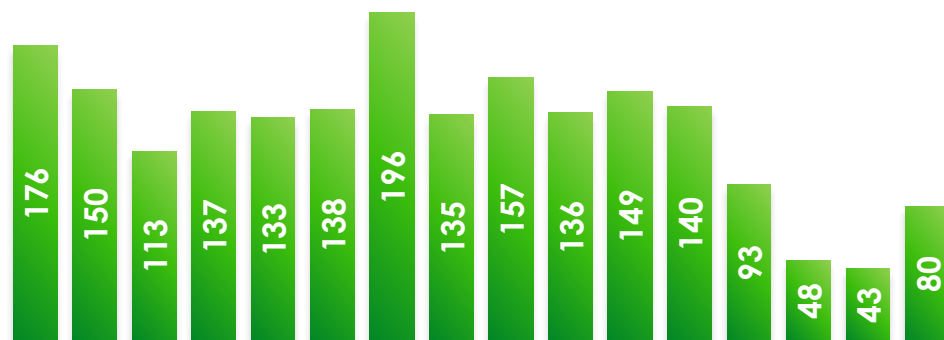
- ЕДБ
- Брокерлер
- Басқа институционалдық инвесторлар
- Жеке тұлғалар
- Басқа заңды тұлғалар

\* Қайталама нарығындағы корпоративтік облигациялар саудасаттықтарының жалпы брутто-айналымынан

Брутто-айналымдағы резидент еместердің үлесі, %



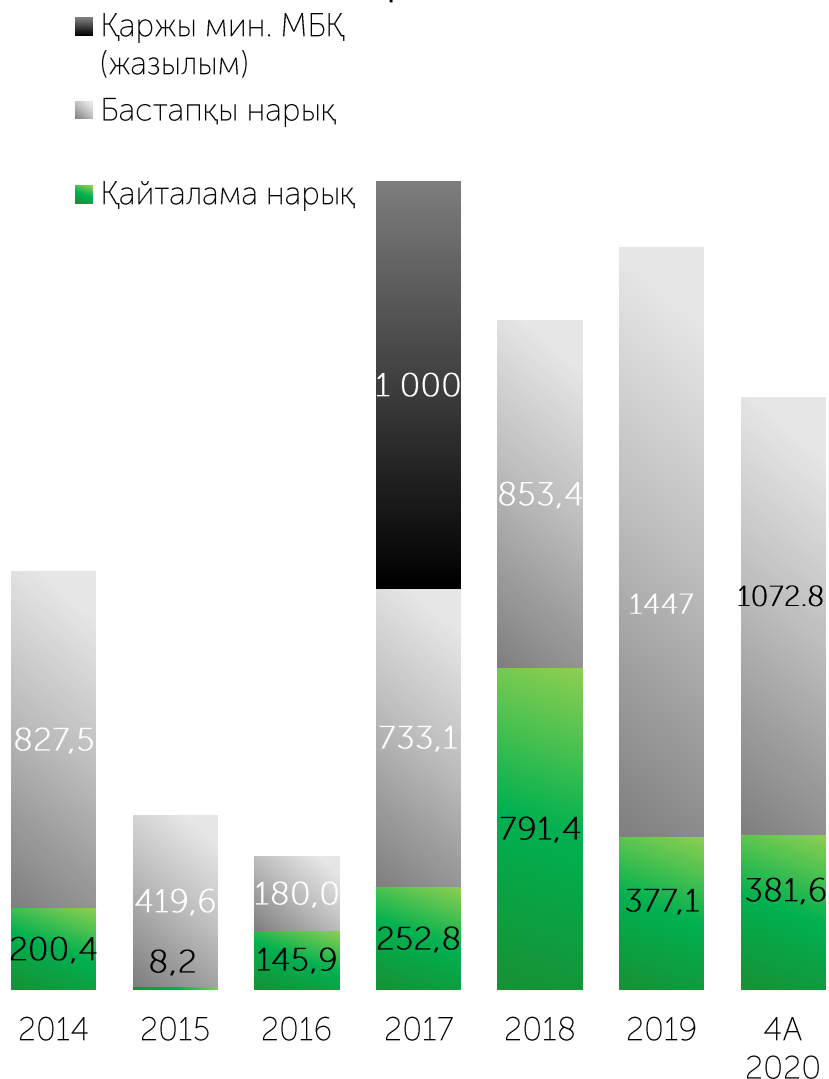
Корпоративтік облигациялар нарығындағы белсенді шоттардың динамикасы



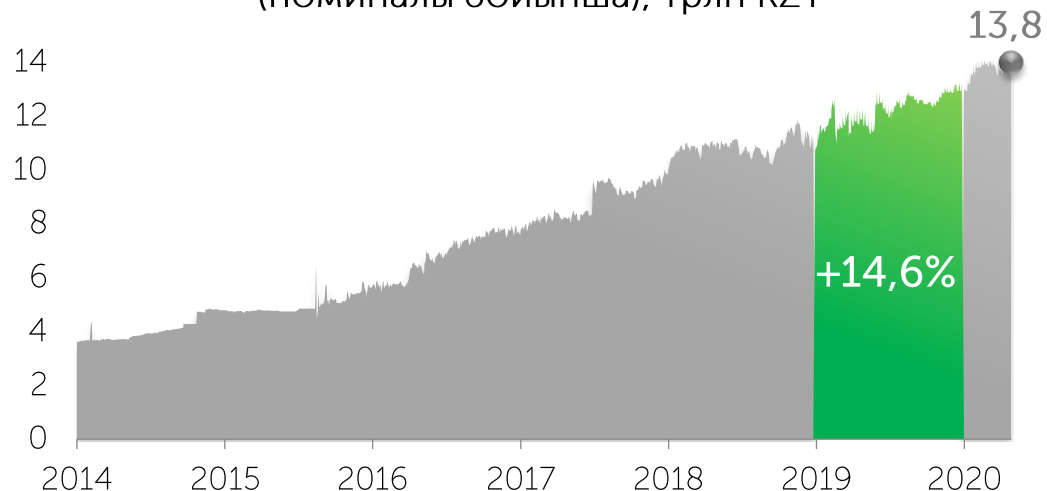
қаң. ақп. нау. сәу. мам. мау. шіл. там. қыр. қаз. қар. жел. қаң. ақп. нау. сәу. 2019 2019 2019 2019 2019 2019 2019 2019 2019 2019 2019 2019 2020 2020 2020 2020

# Мемлекеттік облигациялар

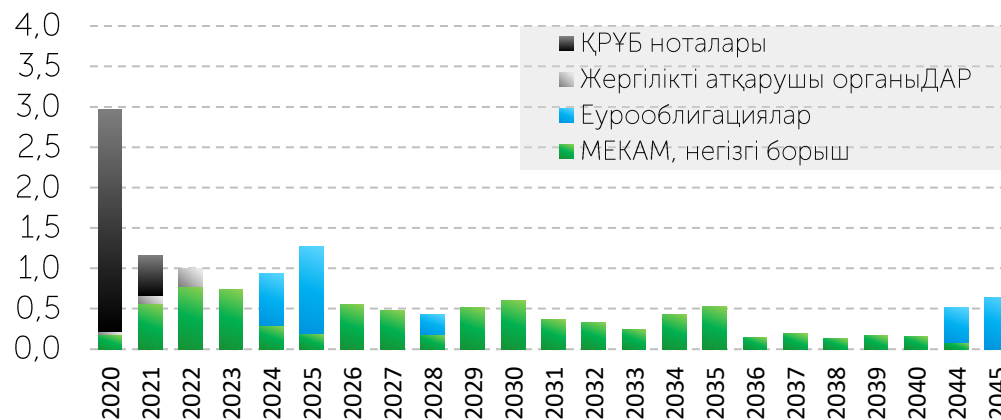
Сауда-саттық көлемінің динамикасы, млрд KZT



Биржада саудаланатын, мемлекеттік борыштың сомасы (номиналы бойынша), трлн KZT



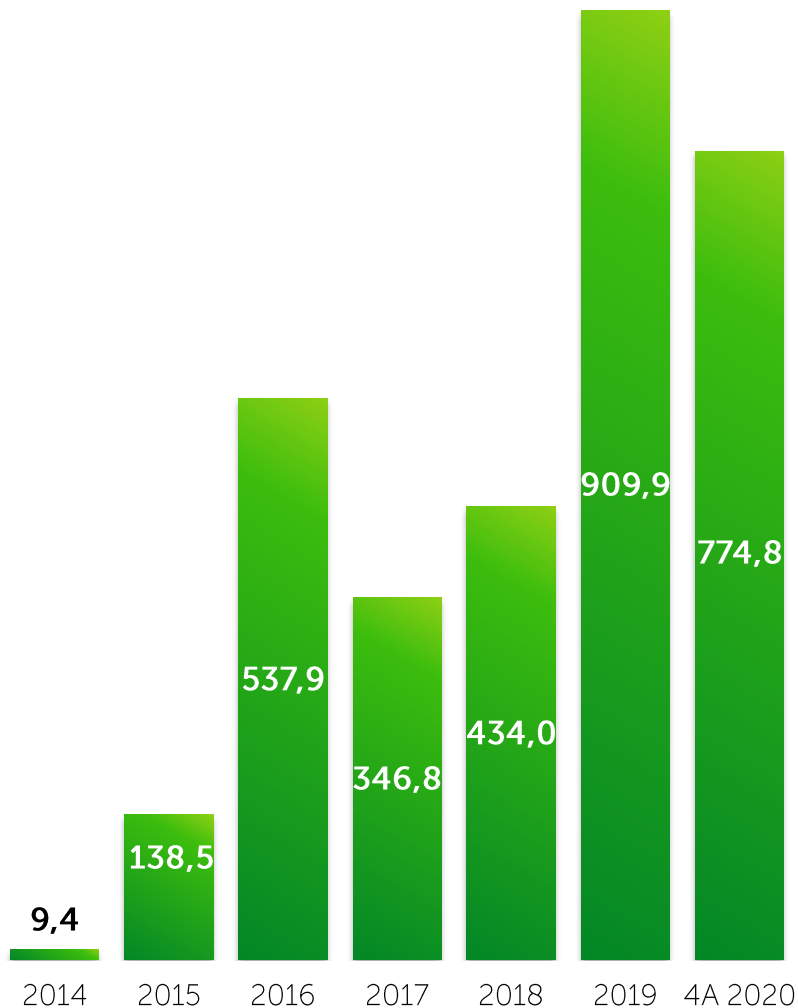
Мемлекеттік борыш бойынша төлемдер динамикасы, трлн KZT



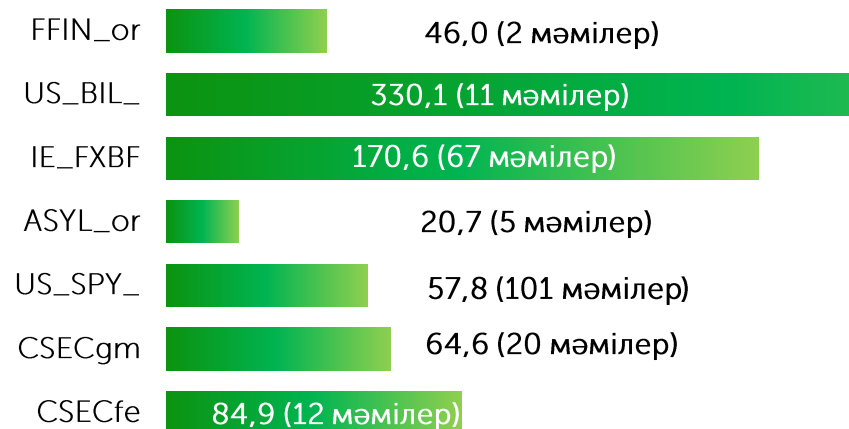
Дереккөз: KASE

# Инвестициялық қорлардың бағалы қағаздары

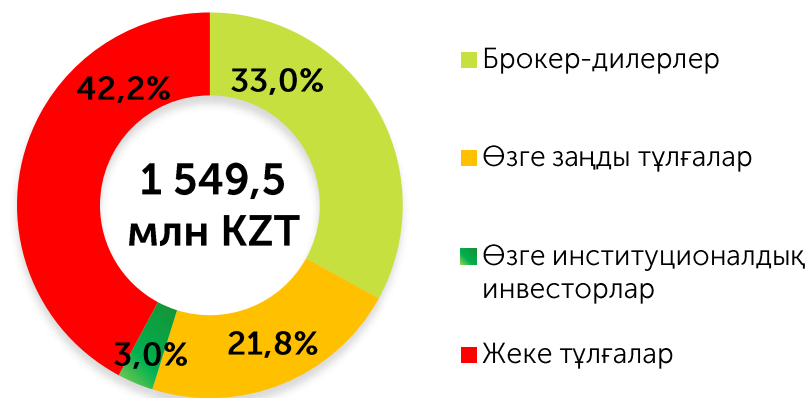
Мәмілелер көлемі, млн KZT



Қаржы құралдары бойынша 2020 жылдың 4А бойынша сауда-саттықтардың көлемі, млн KZT

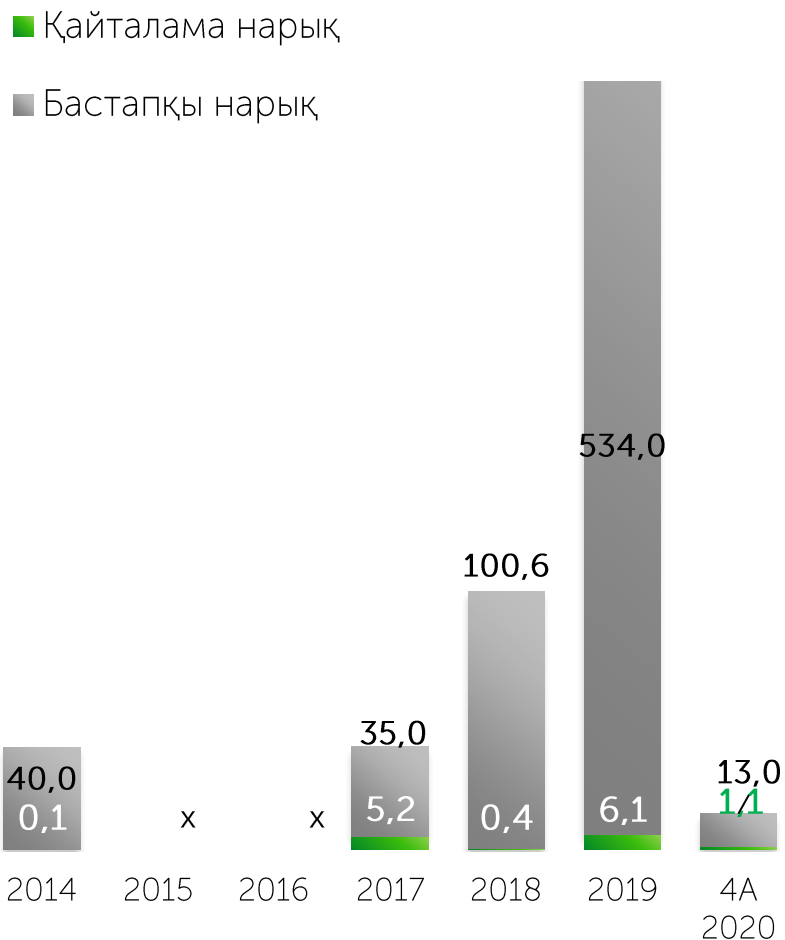


Доли основных категорий инвесторов за 4М 2020 год\*





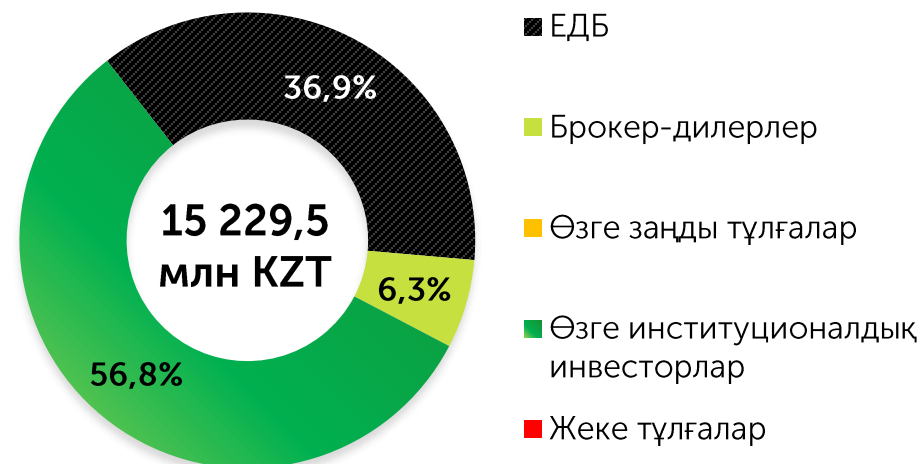
## Сауда-саттық көлемдері, млрд. KZT



2020 жылдың 01 мамырында KASE ресми тізімінде 31 шығарылым облигациялары 5 ұйымда орналастырылған:

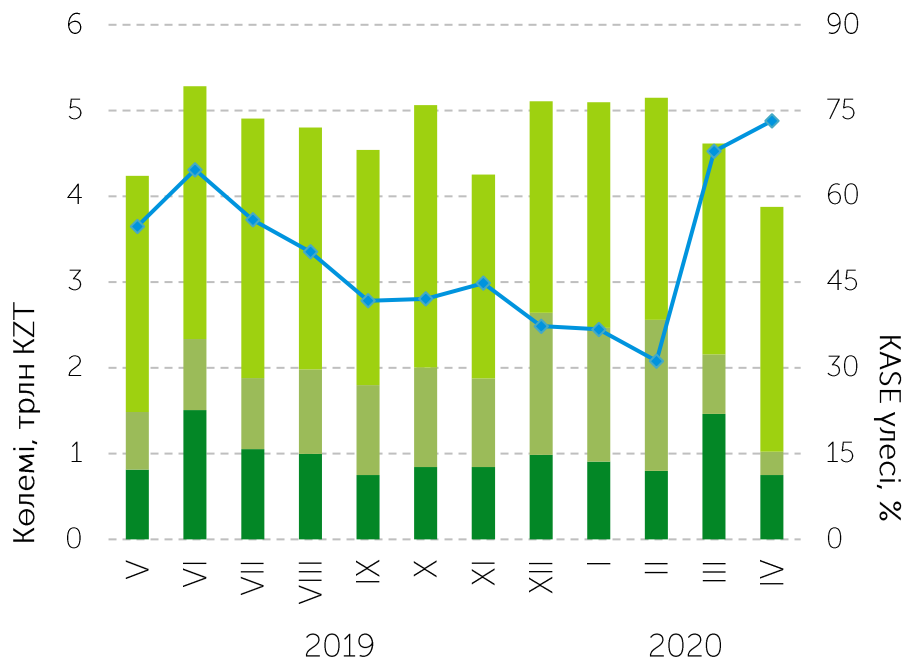
- Еуразиялық даму банкінің 12 шығарылымы
- Еуропалық қайта құру және даму банкінің 10 шығарылымы
- Халықаралық қаржы корпорациясының 5 шығарылымы
- Еуропа инвестициялық банкінің 1 шығарылымы
- Азия даму банкінің 3 шығарылымы

## Инвесторлардың негізгі санаттары бойынша 2020 жылдың 4А үлесі\*

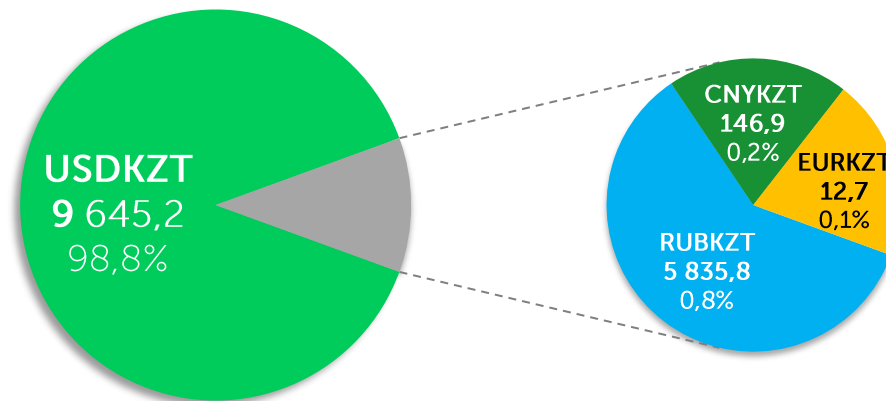


## Биржалық және биржадан тыс валюталық операциялардың өзара қатынасы

- ҚР резидент-банктері мен ҚР резидент емес-банктерінің арасындағы биржадан тыс операциялары
- ҚР резидент-банктері арасындағы биржадан тыс операциялары
- KASE спот-нарығындағы операциялар
- ◆ ҚР резидент-банктері арасында сатып алу бойынша валюталық операциялардың жалпы көлеміндегі KASE спот-нарығындағы операциялардың үлесі



## Сауда-саттық көлеміндегі биржалық нарықтың 2020 жылдың 4А құрылымы. Көлемдер валютаның млн бірлігімен көрсетілген



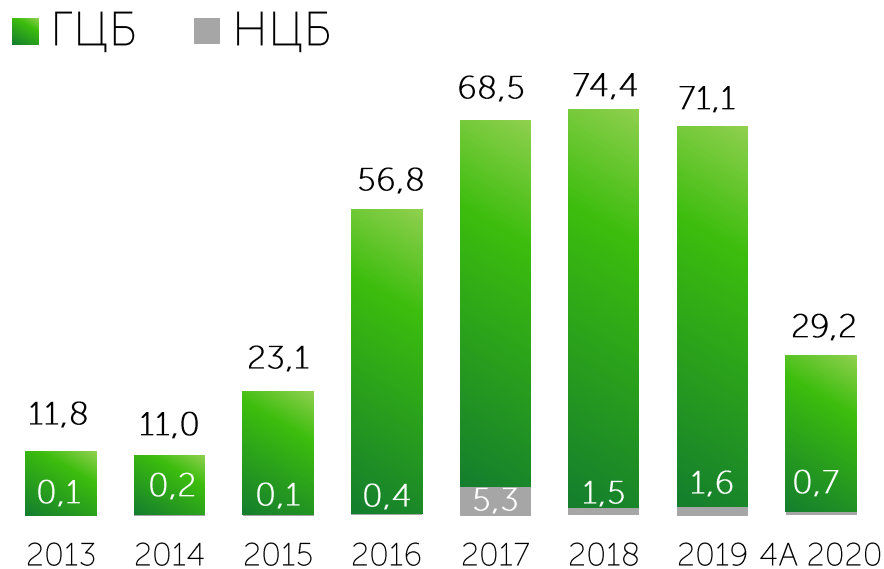
Ескерту: үлестер сауда-саттық көлемінен KZT-мен есептелген

## Спот-нарығындағы сауда-саттық көлемі, трлн KZT



# Репо операцияларының нарығы

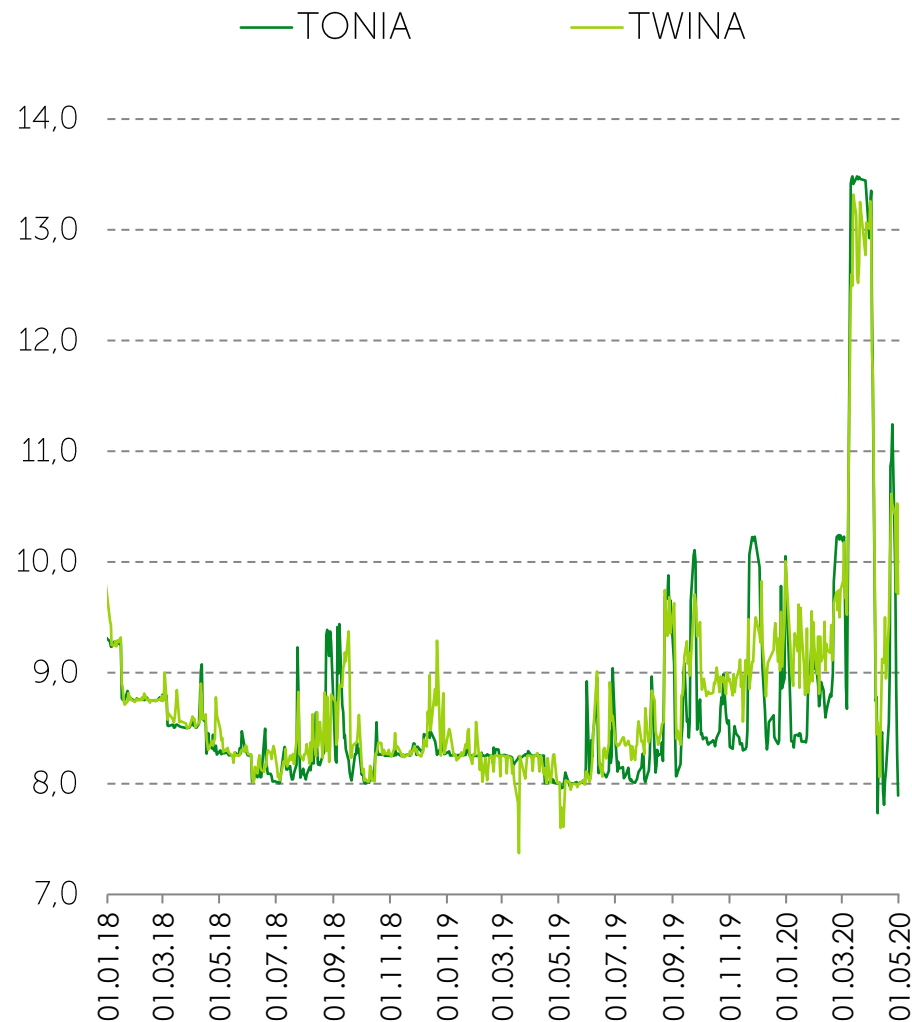
## Сауда-саттық көлемі, трлн KZT



Репо нарығының қаржы құралдары (2020 жылдың 4А көлемі / үлесі):

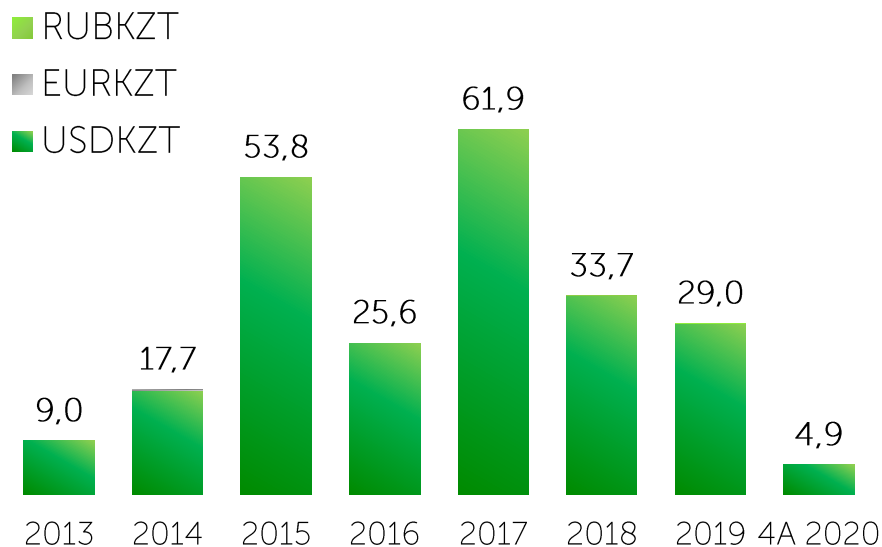
- **МБҚ-мен авторепо** (29 440,7 млрд KZT / 97,77 %)
- ББҚ қоржынымен авторепо (24,5 млрд KZT / 0,08 %)
- МҚҰО қоржынымен авторепо (44,0 млрд KZT / 0,15 %)
- ББҚ қоржынымен авторепо (198,6 млрд KZT / 0,66 %)
- ОК-мен авторепо (384,5 млрд KZT / 1,28 %)
- ББҚ-мен тікелей репо (7,5 млрд KZT / 0,02 %)
- ОК-мен тікелей репо (12,5 млрд KZT / 0,04 %)

## Репо индикаторлары, жылдық %



# Валюталық своп операциялары

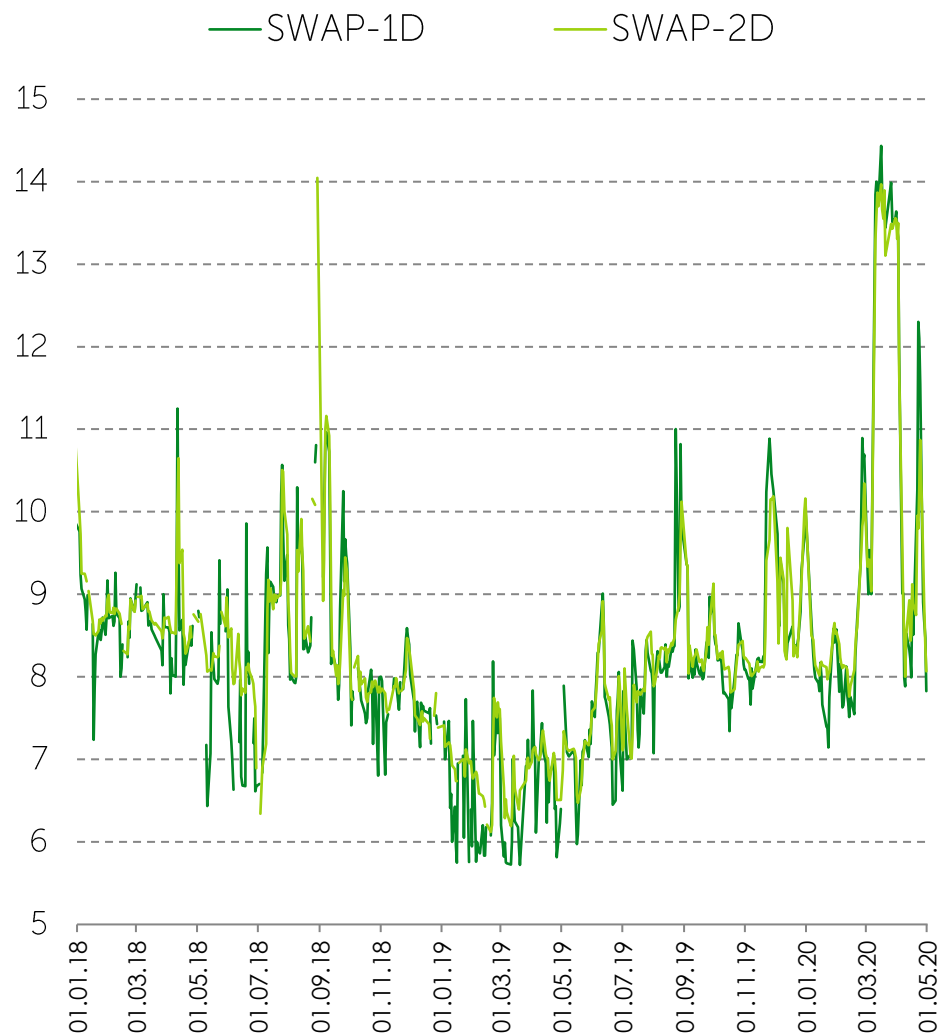
## Сауда-саттық көлемі, млрд KZT




Валюталық своп операцияларының қаржы құралдары (4М 2020 жылдағы көлемі / үлесі):

- USDKZT\_0\_001 (1 657,6 млрд KZT / 33,6 %)
- **USDKZT\_0\_002 (3 209,4 млрд KZT / 65,1 %)**
- USDKZT\_0\_01W (3,8 млрд KZT / 0,1 %)
- USDKZT\_0\_01M (62,7 млрд KZT / 1,3 %)

## Своп-нарығының индикаторлары, жылдық %



# Назарыңызға рахмет!

 Kazakhstan Stock Exchange

 kase\_kz

 Kazakhstan.stock.exchange

 Қазақстан қор биржасы KASE

Қазақстан Республикасы, 050040  
Алматы қ., Байзақов көш., 280  
"Almaty Towers" Көпфункционалы кешешінің  
Солтүстік мұнарасы, 8-ші қабат  
Тел.: +7 (727) 237 5300  
e-mail: info@kase.kz  
[www.kase.kz](http://www.kase.kz)