



Қазақстан қор биржасы
Казахстанская фондовая биржа
Kazakhstan Stock Exchange

Типтік презентация

2020 жылдың 01 желтоқсанына



"Қазақстан қор биржасы" АҚ

49,1% - ҚРҰБ

3,4% – МОЕХ

44,4% - қаржылық ұйымдар

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

■ Ұлттық Банк

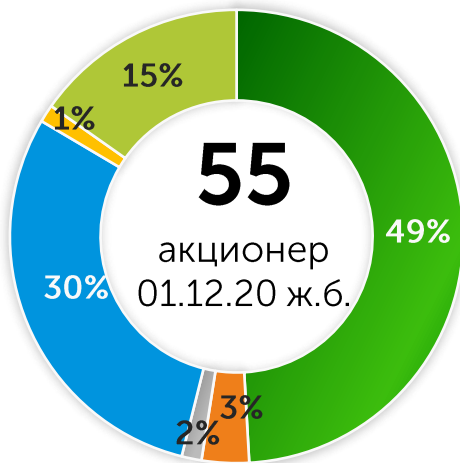
■ МОЕХ

■ Брокерлер

■ Банктер

■ Бөлшек инвесторлар

■ Басқасы

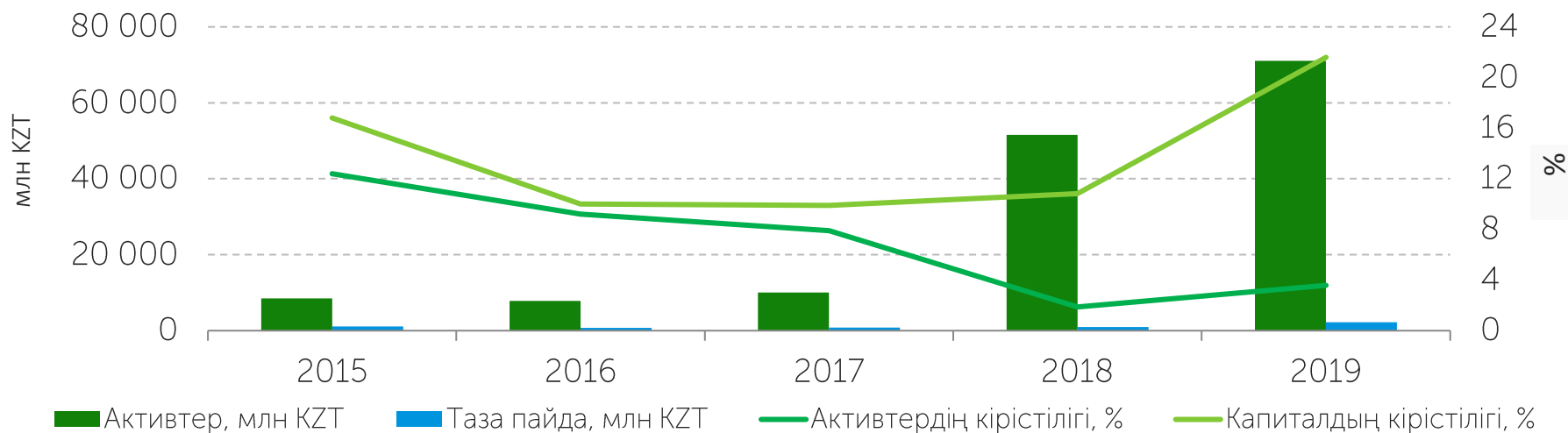


2020 жылдың 01 қазанындағы жағдай бойынша::

меншікті капитал	13 376,5 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	12 918,7 KZT

KASE кірістілігінің көрсеткіштері

	Активтер, млн KZT	Таза пайда, млн KZT	Активтердің кірістілігі, %	Капиталдың кірістілігі, %
2019	71 041,1	2 192,7	3,6	21,6
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



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

42

Қор

32

Валюта

24

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:

2020

- "ForteFinace" АҚ / қор және деривативтер
- "Заман-Банк" Ислам банкі" АҚ / валюта

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 он бір 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
Бағалы қағаздар нарығы	6 951,1	16 588,6	796	30 757,3	38,6
Акциялар	213,2	513,1	760	943,4	1,2
Корпоративтік борыштық БҚ	2 005,4	4 762,4	12	8 873,5	712,4
Қазақстандық МБҚ	4 500,6	10 766,8	8	19 914,1	2 555,7
ХҚҰ облигациялары	212,6	500,5	1	940,5	1 756,6
Инвестициялық қорлардың БҚ	16,0	37,9	15	70,8	4,7
Туынды бағалы қағаздар	3,4	8,0	<0,1	15,0	116,9
Шетел валюталарының нарығы	10 484,0	25 421,6	397	46 389,2	116,7
Ақша нарығы	88 252,1	214 989,4	449	390 496,2	869,4
Репо операциялары	79 246,0	192 754,5	434	350 646,1	807,5
Валюталық своп операциялары	9 006,1	22 234,9	15	39 850,1	2 672,4
Деривативтер нарығы	<0,1	<0,1	<0,1	<0,1	0,4
БАРЛЫҒЫ	105 687,2	256 999,6	1 642	467 642,7	284,7

Нарықтың көлемі мен құрылымы

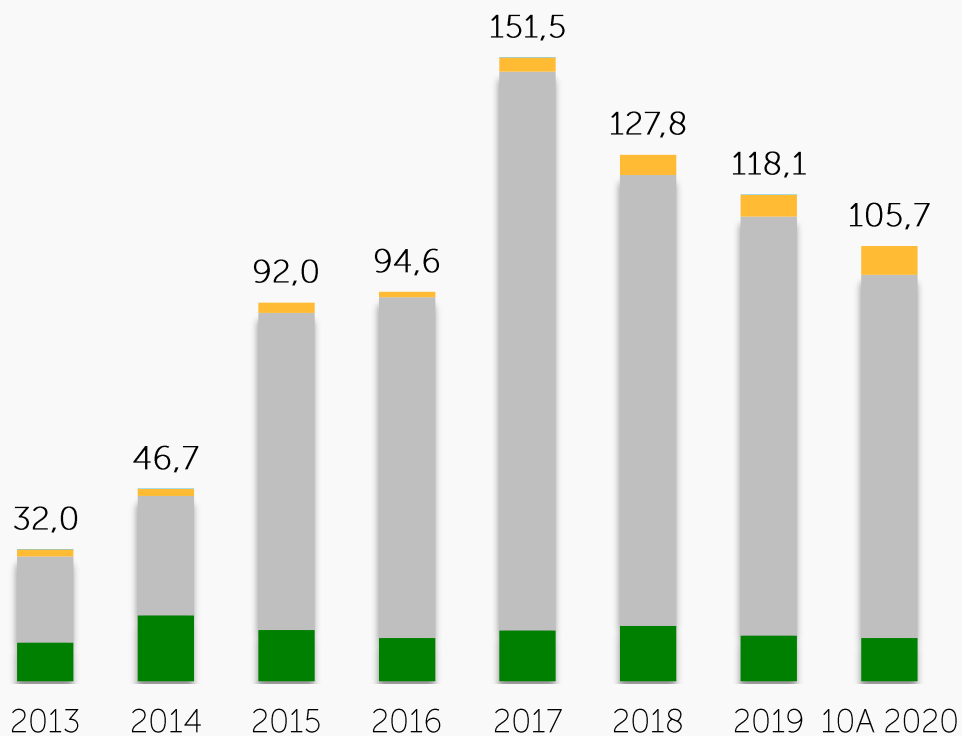
Шетел валюталарының нарығы

Ақша нарығы

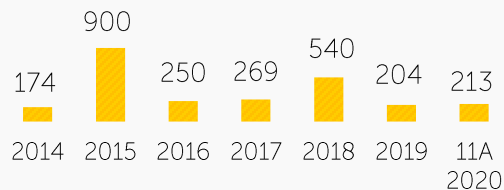
Бағалы қағаздар нарығы

Деривативтер нарығы

Сауда-саттық көлемінің секторлар бойынша динамикасы, трлн KZT



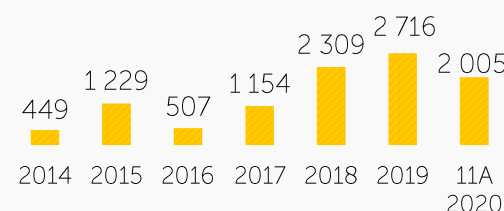
млрд KZT



Акциялар

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

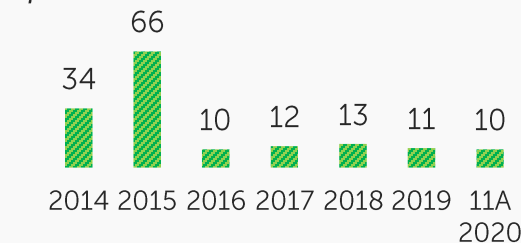
млрд KZT



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%

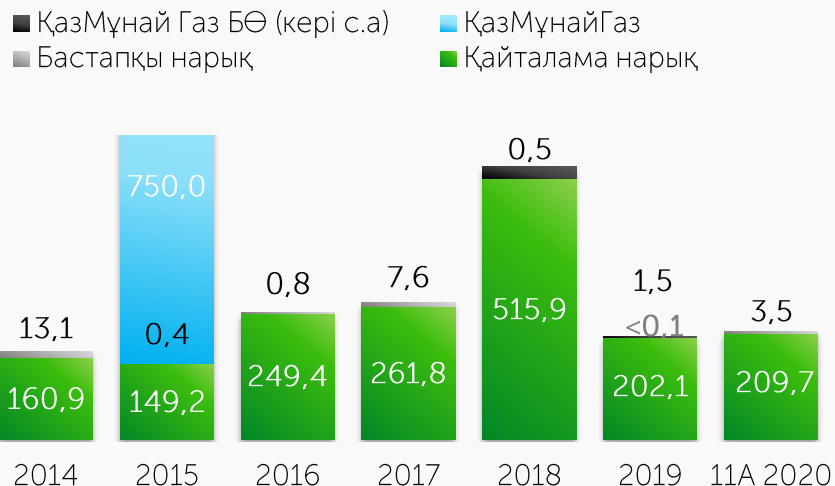
трлн KZT



Ақша нарығы

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

Мәміле көлемі, млрд. KZT

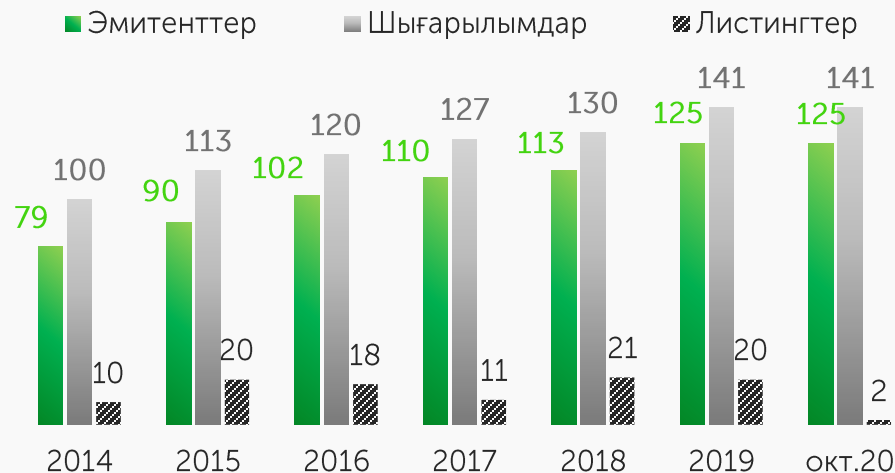


Акциялар нарығының капитализациясы, трлн KZT



Дереккөз: KASE

Жаңа листингілер



2020 жылдық 11А негізгі көрсеткіштер



+13,0%
2019 жылдың 11А салыстырғанда



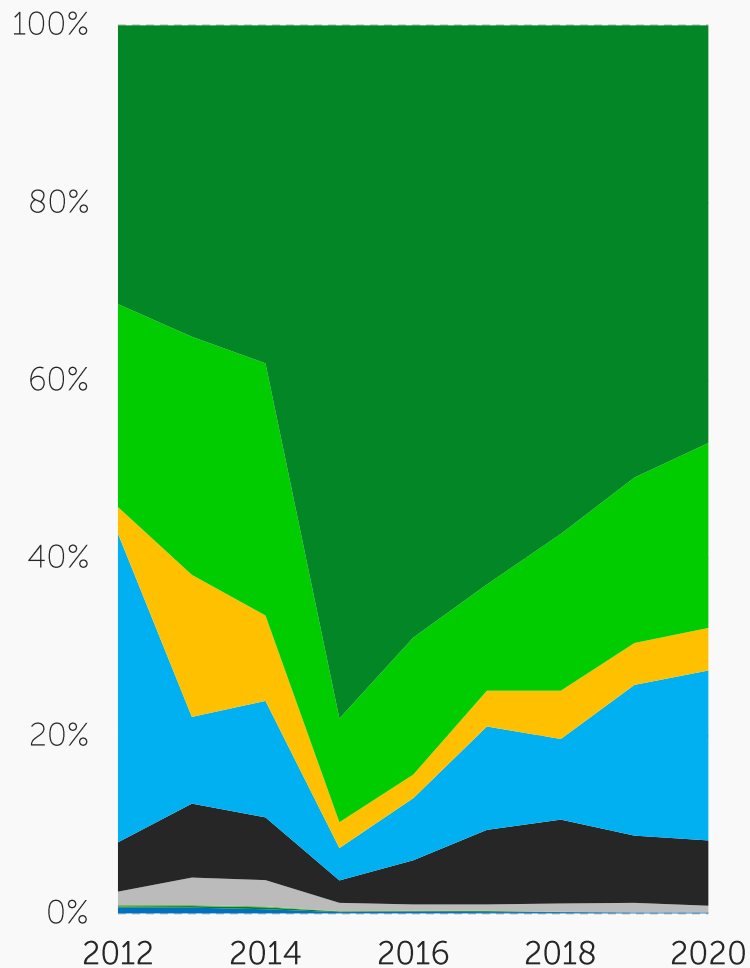
+13,3%
2019 жылдың 11А салыстырғанда



+79,2%
2019 жылдың 11А салыстырғанда

Акциялардың салалық құрылымы

Капитализациядағы үлесі, %

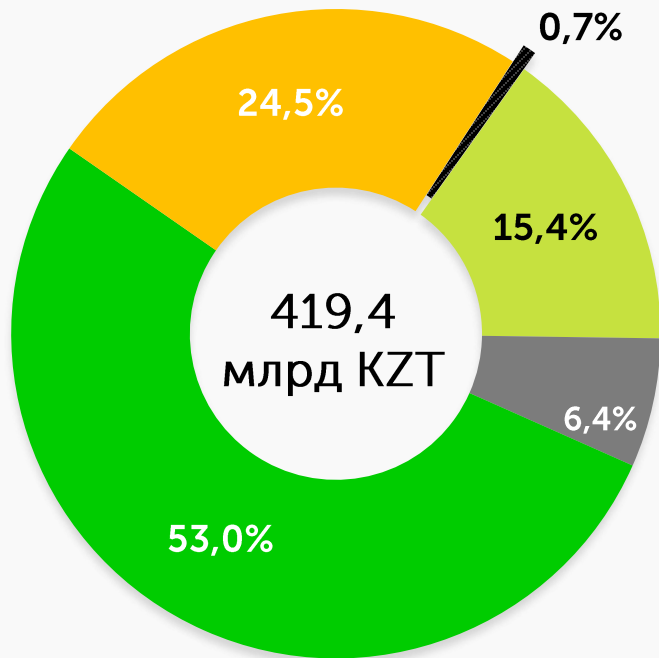


Энергетика	47,0
Қаржылар	20,8
Телекоммуникациялық қызметтер көрсету	4,8
Материалдар	19,1
Өндіріс	7,4
Жаппай сұранысқа ие тауарлар	0,8
Коммуналдық қызметтер көрсету	<0,1
Ақпараттық технологиялар	0
Денсаулық сақтау	0
Негізгі емес тұтынушылық тауарлар	0,1

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

Акциялар: инвесторлық база

Қайталама нарықтағы инвесторлардың негізгі санаттарының 2020 жылдың 11А үлестері*

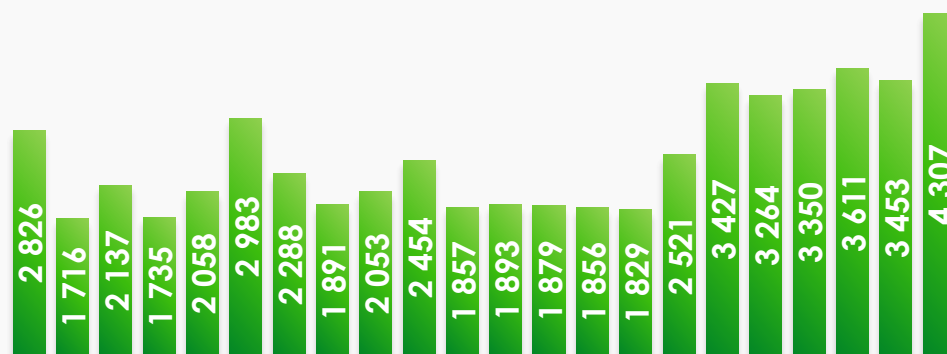


- ЕДБ
- Брокерлер
- Өзге институционалдық инвесторлар
- Жеке тұлғалар
- Басқа да заңды тұлғалар

Резидент еместердің брутто-айналымындағы үлесі, %



Акциялар нарығындағы бөлшек инвесторлардың белсенді шоттарының динамикасы

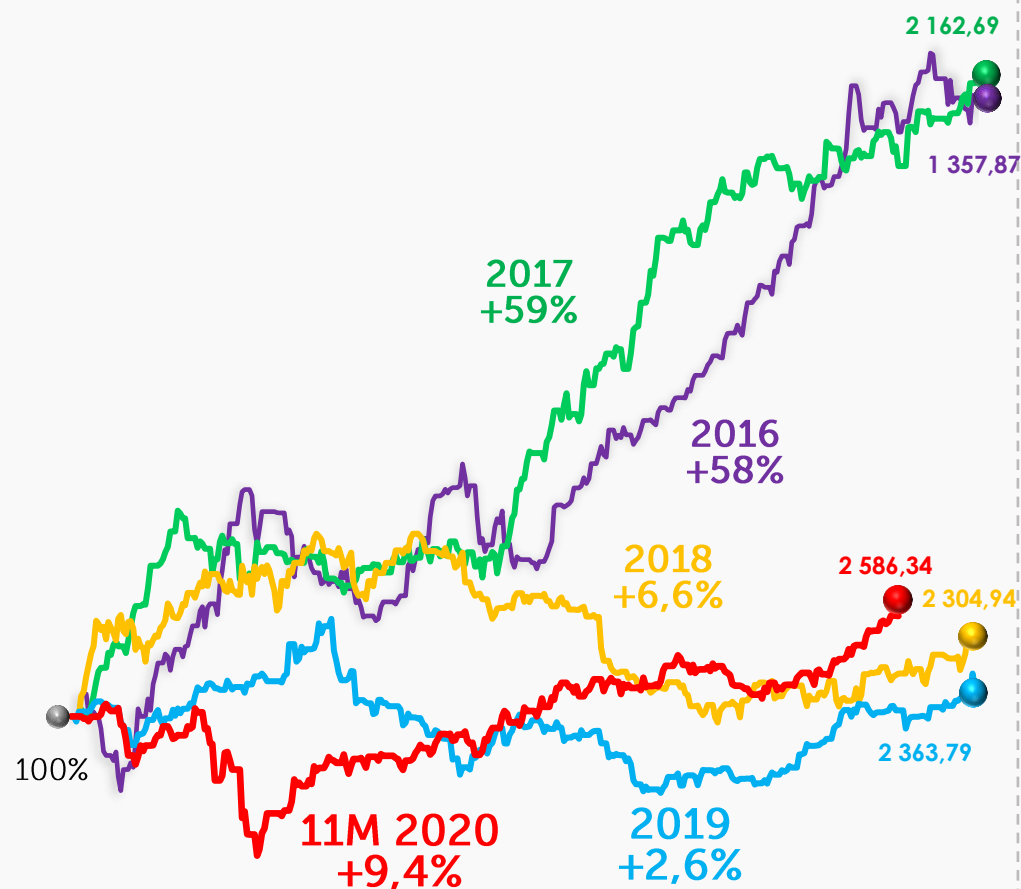


ақп. нау. сәу. мам. мау. шіл. там. қыр. қаз. қар. жел. қаң. ақп. нау. сәу. мам. мау. шіл. там. қыр. қаз. қар. 2019 2019 2019 2019 2019 2019 2019 2019 2019 2019 2020 2020 2020 2020 2020 2020 2020 2020 2020 2020 2020 2020 2020 2020

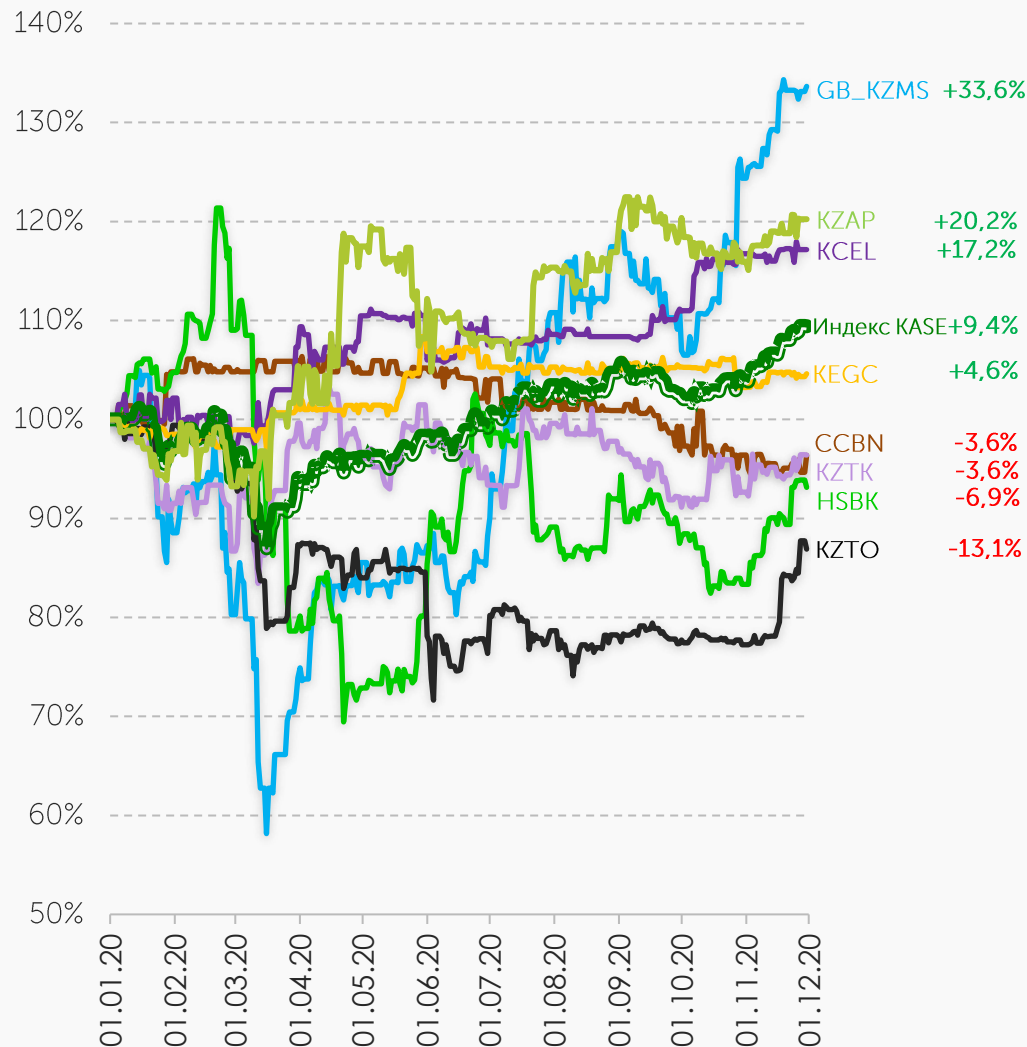
* қайталама нарықтағы акциялардың сауда-саттықтарының жалпы брутто-айналымынан

KASE Индексінің динамикасы

KASE Индексі 2016-11А 2020



KASE Индексінің құраушылардың динамикасы

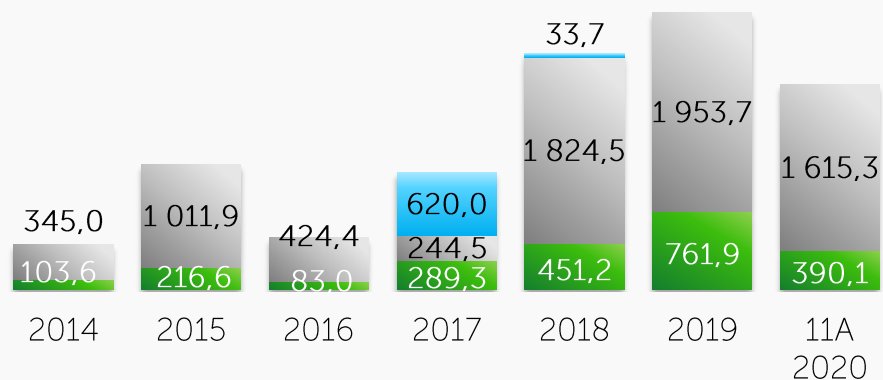


Дереккөз: KASE, Bloomberg

Корпоративтік облигациялар

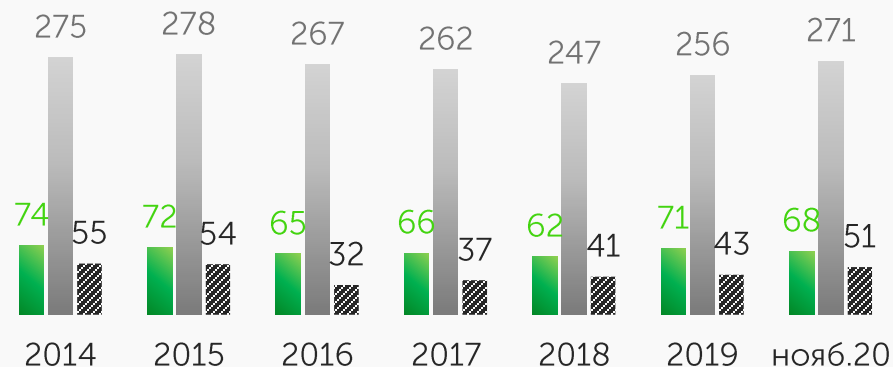
Мәміле көлемі, млрд KZT

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

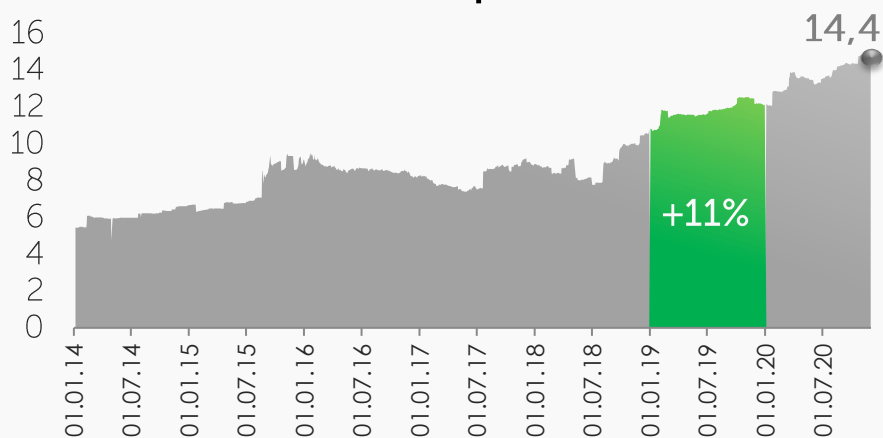


Жаңа листингілер

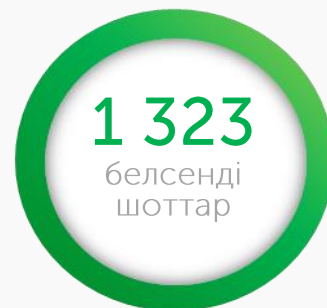
- Эмитенттер
- Шығарылымдар
- Листингтер



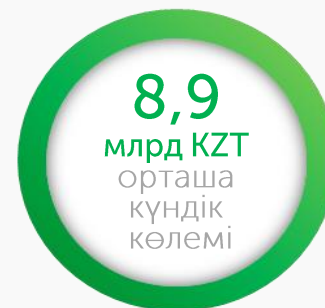
Айналымдағы корпоративтік борыштың көлемі, трлн KZT



2020 жылдық 11А негізгі көрсеткіштер



+63,5%
2019 жылдың 11А салыстырғанда

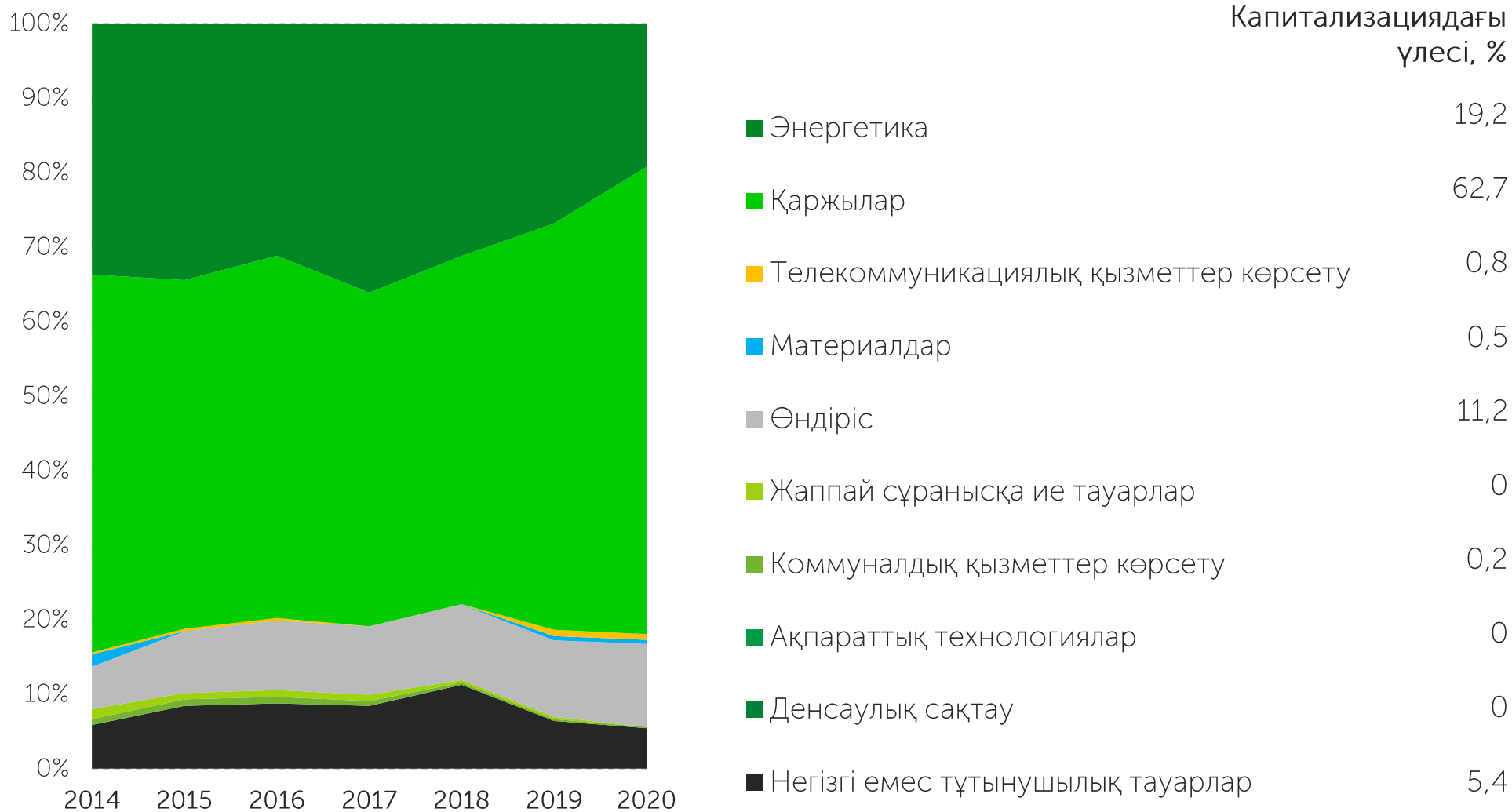


- 22,8 %
2019 жылдың 11А салыстырғанда



+13,9 %
2019 жылдың 11А салыстырғанда

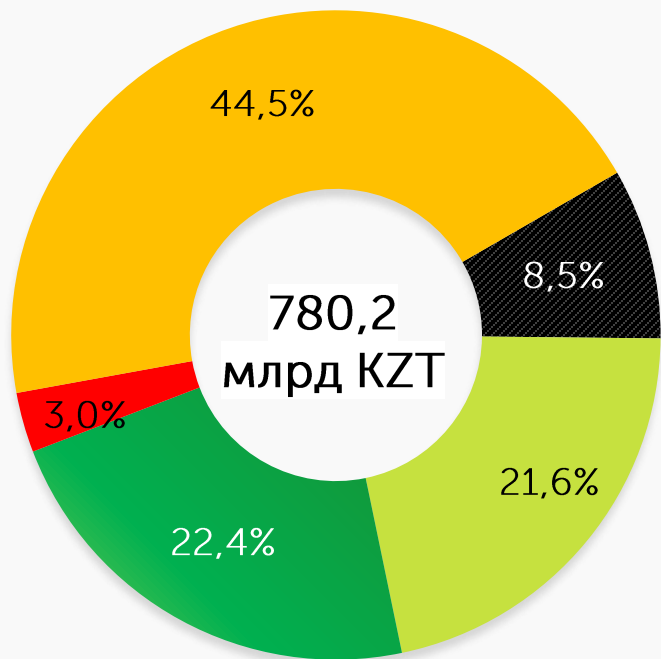
Облигациялар тізімдерінің салалық құрылымы



Классификатор ретінде "Global Industry Classification Standard (GICS)[®]" қолданылған

Корпоративтік облигациялар: инвесторлық база

Қайталама нарықтағы инвесторларың негізгі санаттарының 2020 жылдың 11А үлестері*

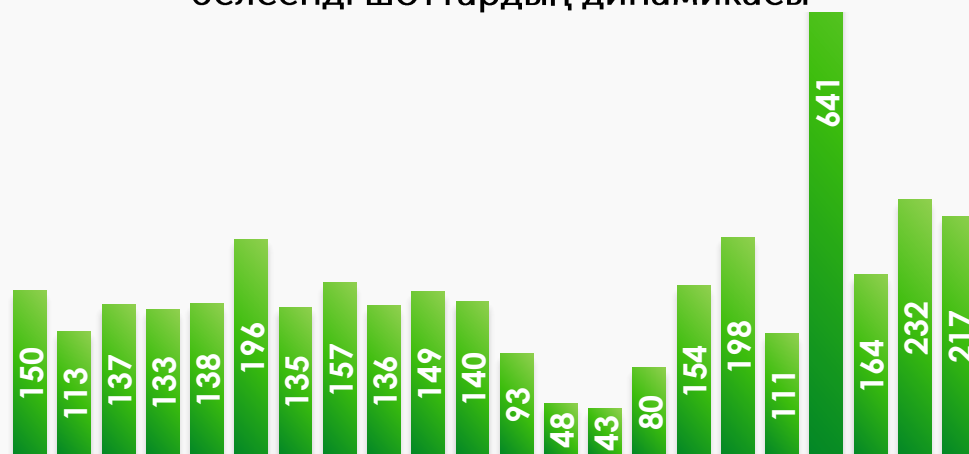


- ЕДБ
- Брокерлер
- Басқа институционалдық инвесторлар
- Жеке тұлғалар
- Басқа заңды тұлғалар

Брутто-айналымдағы резидент еместердің үлесі, %



Корпоративтік облигациялар нарығындағы белсенді шоттардың динамикасы



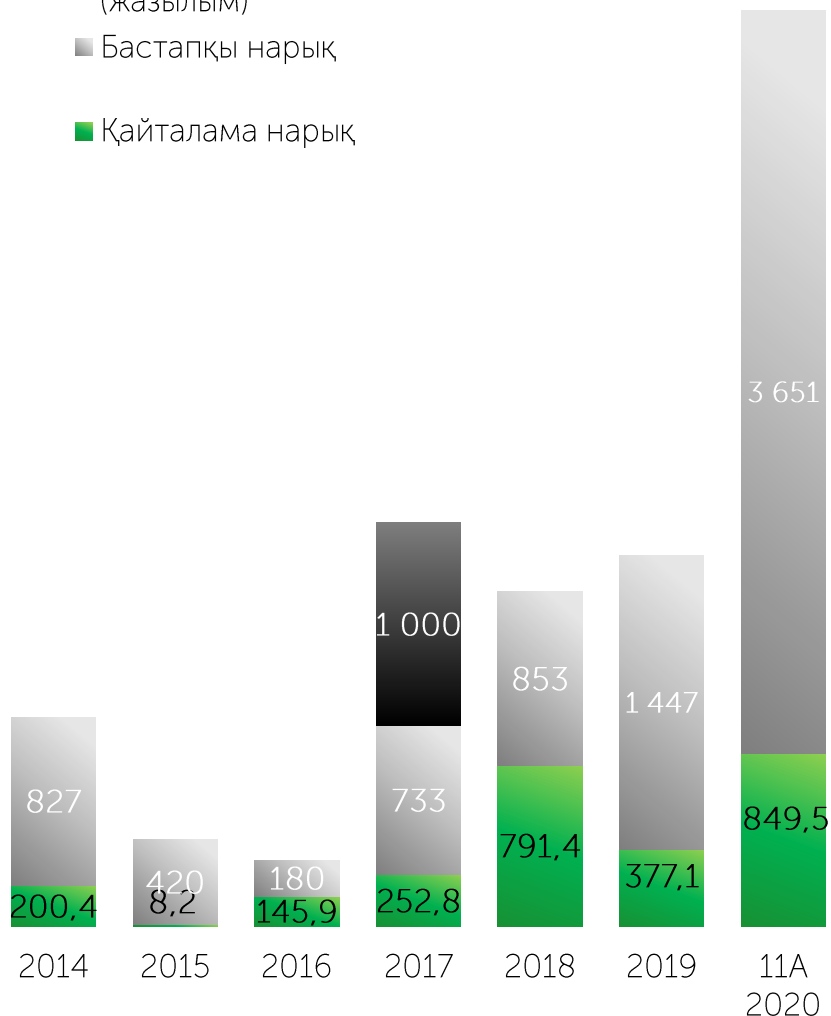
ақп. нау. сәу. мам. мау. шіл. там. қыр. қаз. қар. жел. қаң. ақп. нау. сәу. мам. мау. шіл. там. қыр. қаз. қар.
2019 2019 2019 2019 2019 2019 2019 2019 2019 2019 2020 2020 2020 2020 2020 2020 2020 2020 2020 2020 2020 2020 2020 2020

* Қайталама нарығындағы корпоративтік облигациялар саудасаттықтарының жалпы брутто-айналымынан

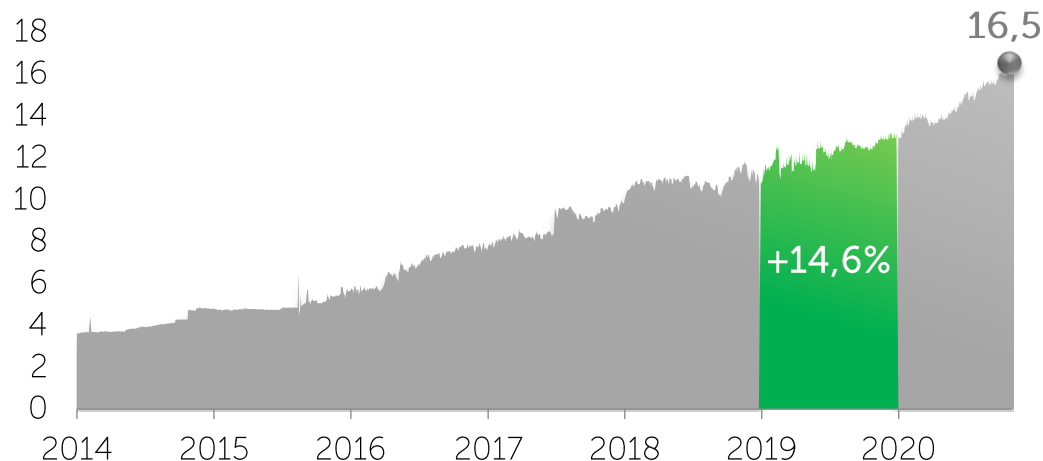
Мемлекеттік облигациялар

Сауда-саттық көлемінің динамикасы, млрд KZT

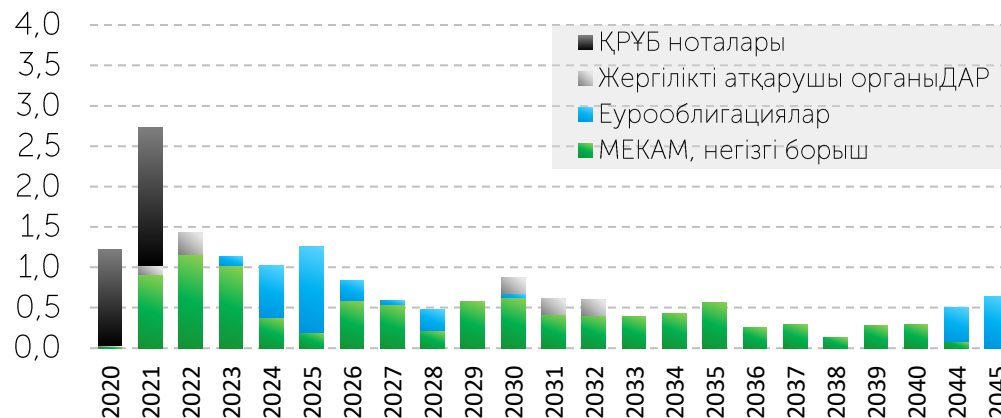
- Қаржы мин. МБҚ (жазылым)
- Бастапқы нарық
- Қайталама нарық



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



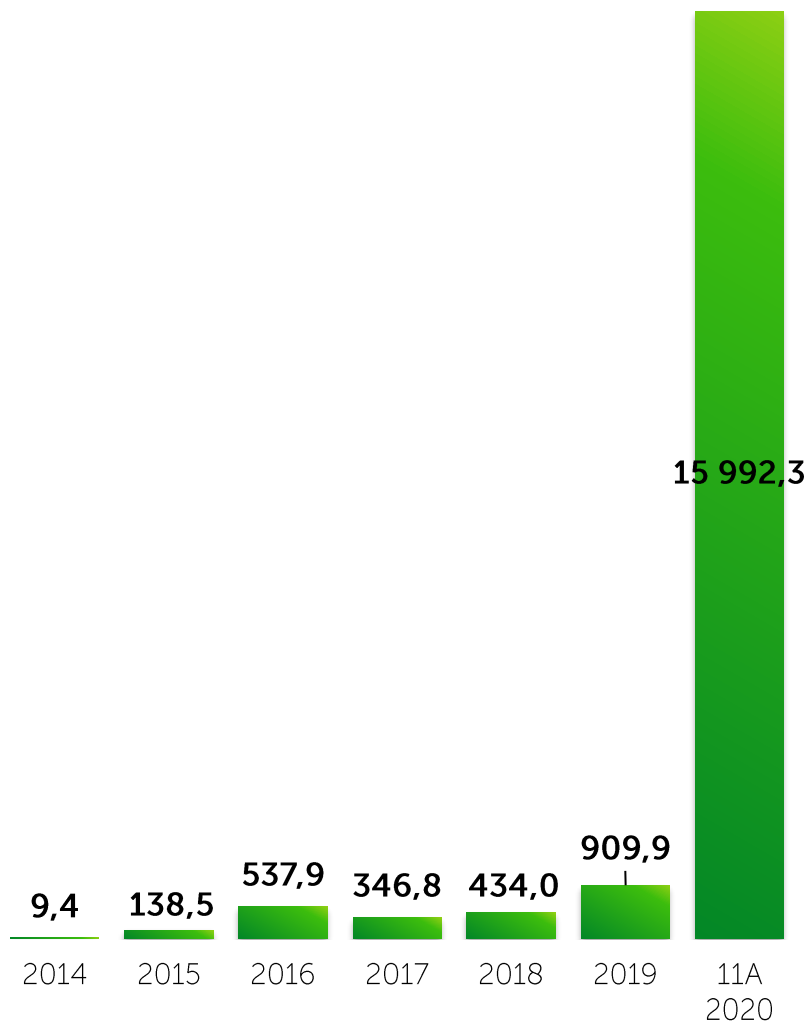
Мемлекеттік борыш бойынша төлемдер динамикасы, трлн KZT



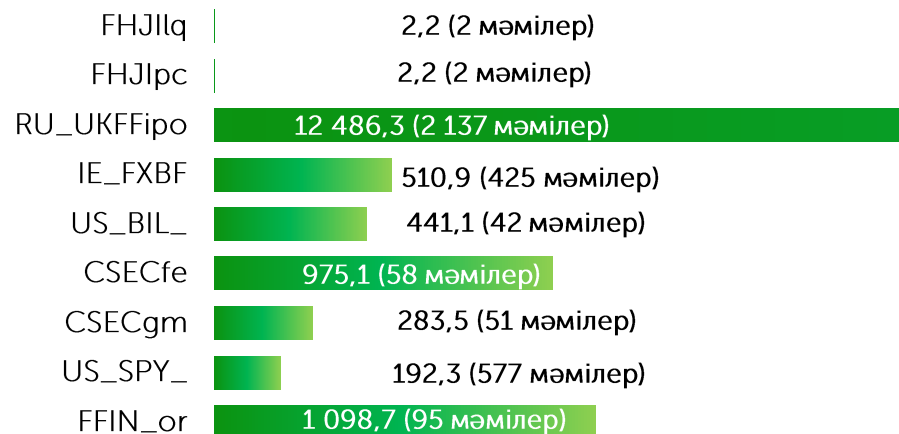
Дереккөз: KASE

Инвестициялық қорлардың бағалы қағаздары

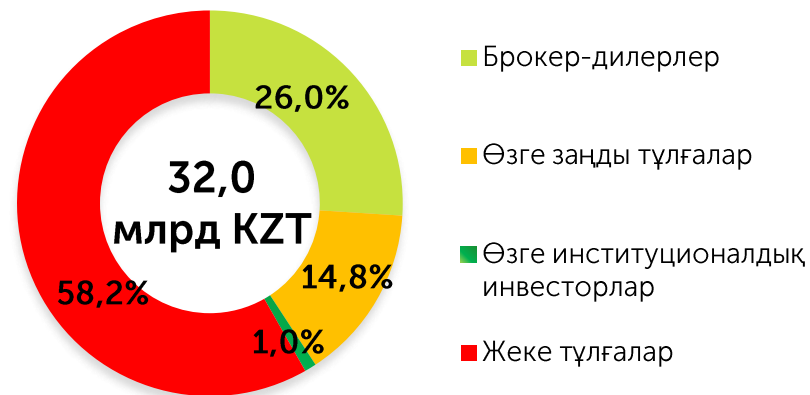
Мәмілелер көлемі, млн KZT



Қаржы құралдары бойынша 2020 жылдың 11А бойынша сауда-саттықтардың көлемі, млн KZT

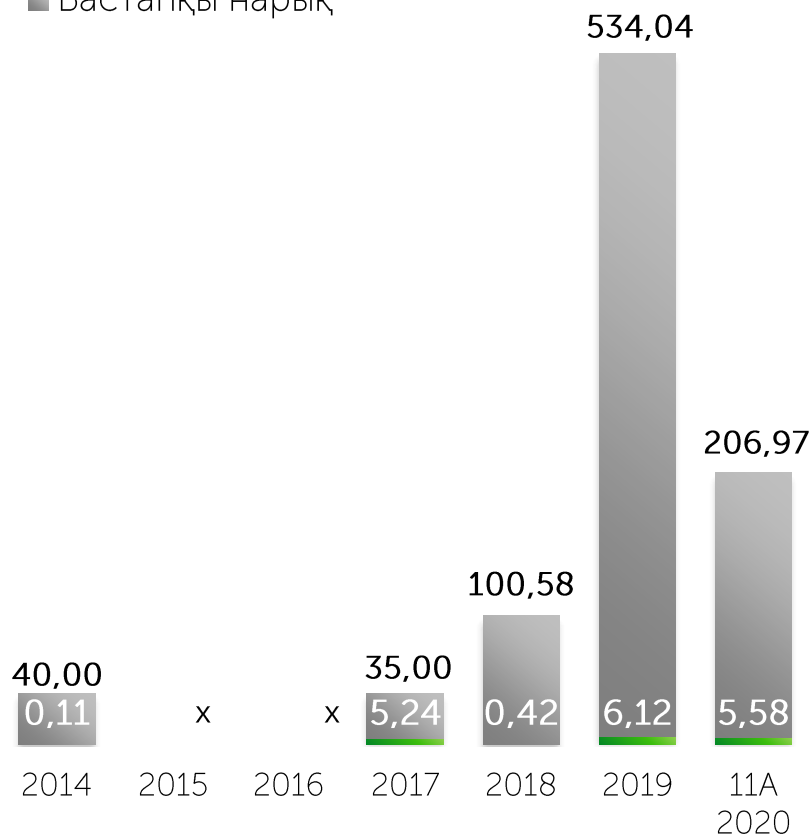


Инвесторлардың негізгі санаттары бойынша 2020 жылдың 11А үлесі*



Сауда-саттық көлемдері, млрд. KZT

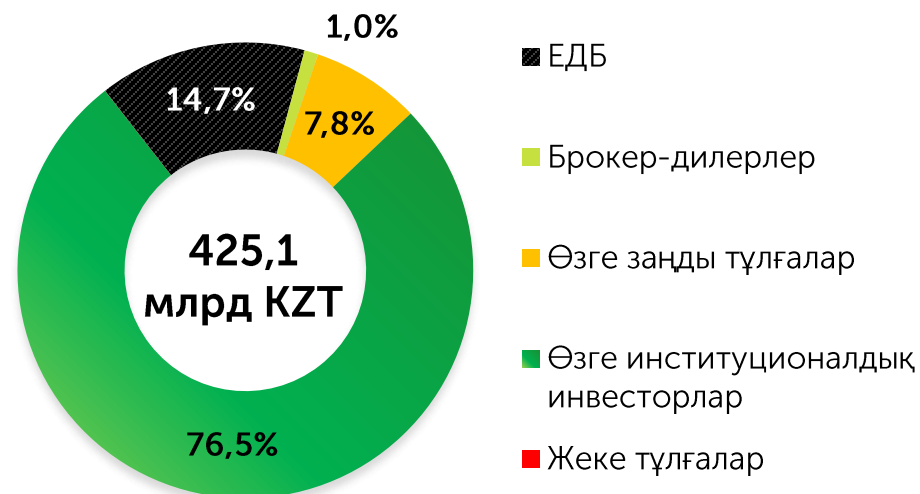
- Қайталама нарық
- Бастапқы нарық



2020 жылдың 01 желтоқсанында KASE ресми тізімінде 32 шығарылым облигациялары 4 ұйымда орналастырылған:

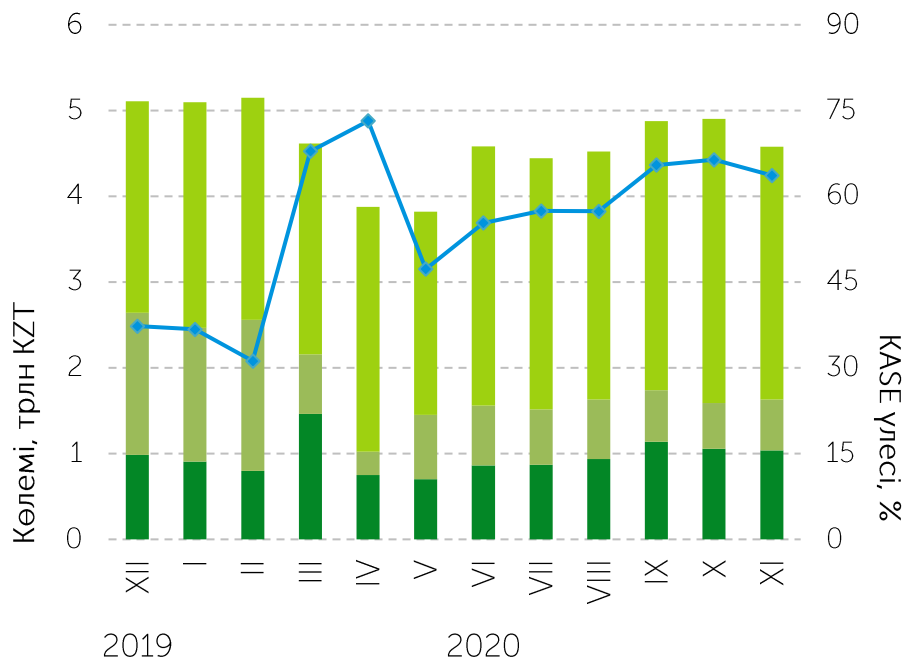
- Еуразиялық даму банкінің 11 шығарылымы
- Еуропалық қайта құру және даму банкінің 11 шығарылымы
- Халықаралық қаржы корпорациясының 5 шығарылымы
- Азия даму банкінің 5 шығарылымы

Инвесторлардың негізгі санаттары бойынша 2020 жылдың 11А үлесі*

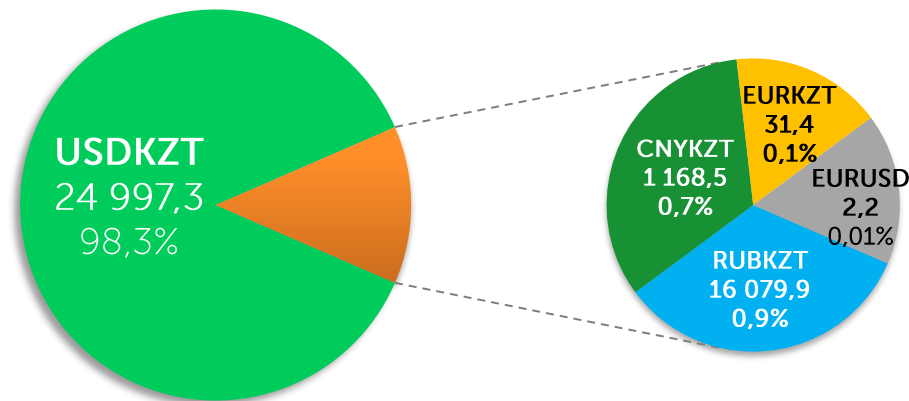


Биржалық және биржадан тыс валюталық операциялардың өзара қатынасы

- 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 11А құрылымы. Көлемдер валютаның млн бірлігімен көрсетілген



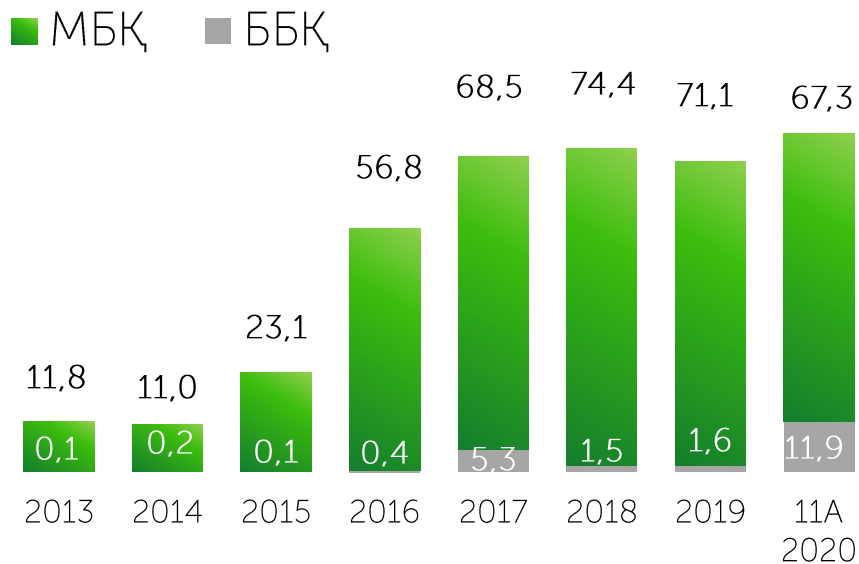
Ескерту: үлестер сауда-саттық көлемінен KZT-мен есептелген

Спот-нарығындағы сауда-саттық көлемі, трлн KZT



Репо операцияларының нарығы

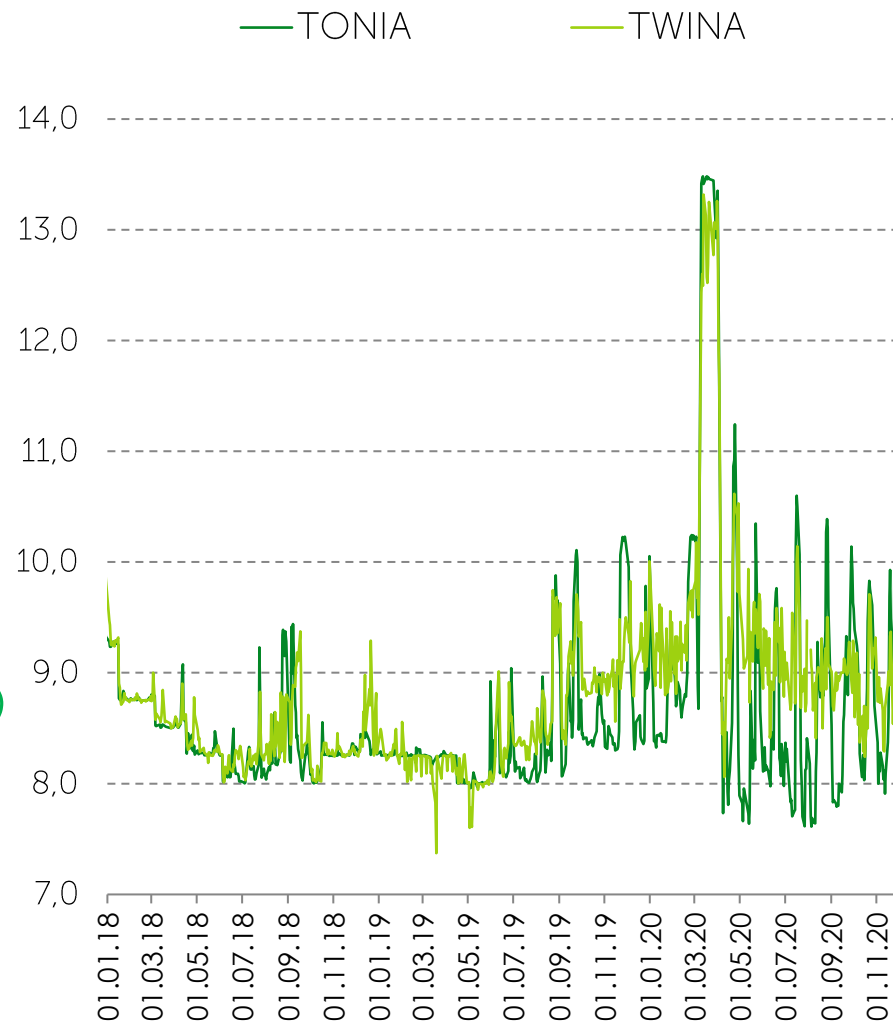
Сауда-саттық көлемі, трлн KZT



Репо нарығының қаржы құралдары (2020 жылдың 11А көлемі / үлесі):

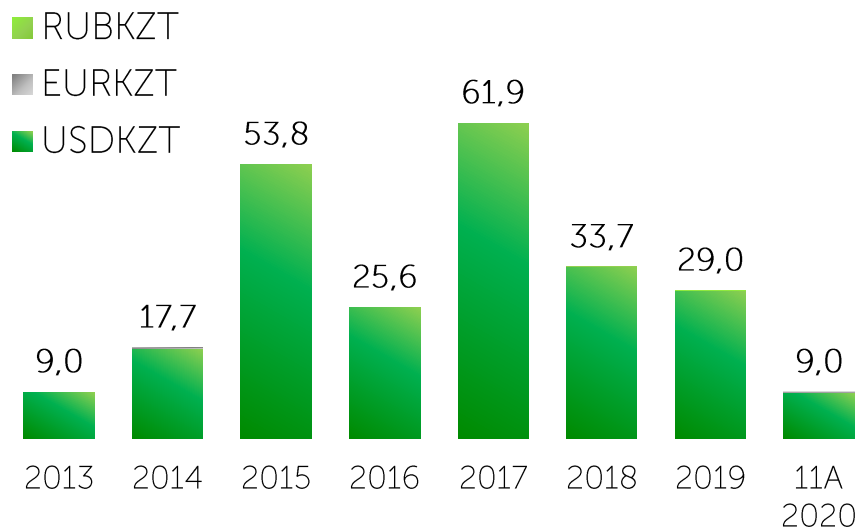
- **МБҚ-мен авторепо** (74 926,5 млрд KZT / 94,55 %)
- ББҚ қоржынымен авторепо (24,5 млрд KZT / 0,03 %)
- МҚҰО қоржынымен авторепо (1 785,8 млрд KZT / 2,25 %)
- ББҚ қоржынымен авторепо (2 446,9 млрд KZT / 3,09 %)
- ББҚ-мен тікелей репо (62,3 млрд KZT / 0,08 %)

Репо индикаторлары, жылдық %



Валюталық своп операциялары

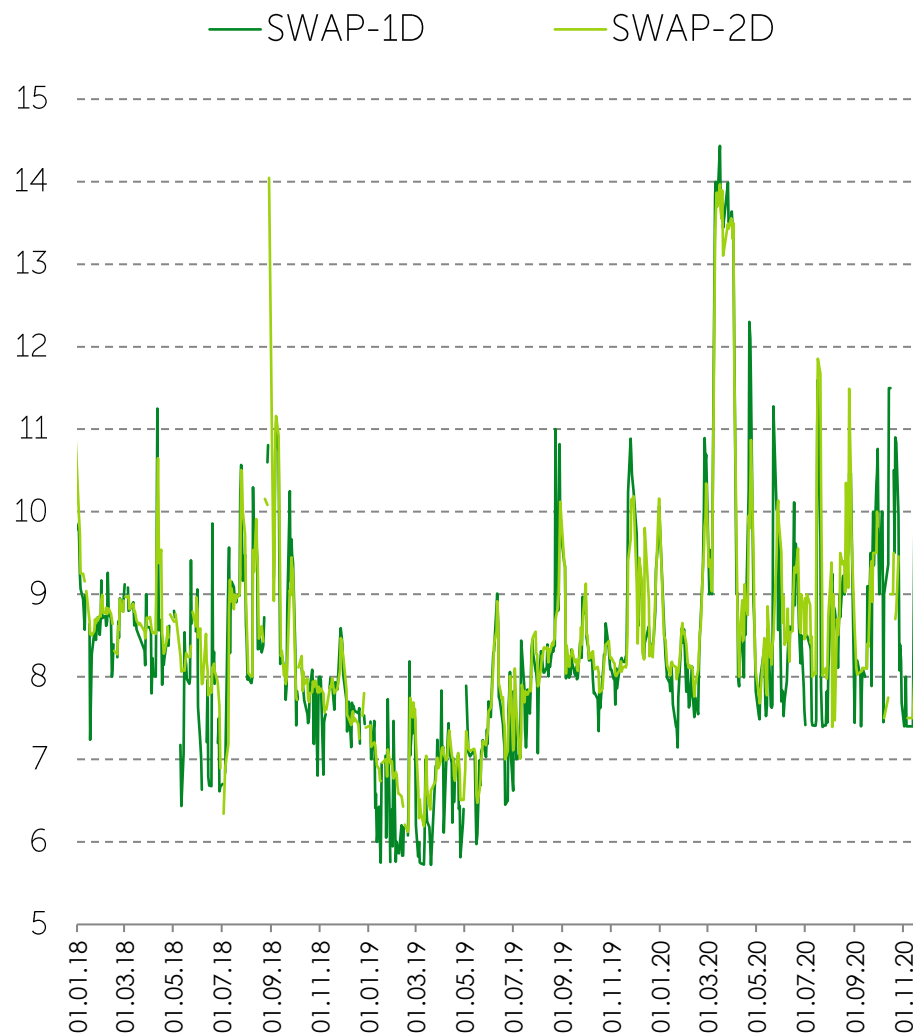
Сауда-саттық көлемі, млрд KZT



Валюталық своп операцияларының қаржы құралдары (11A 2020 жылдағы көлемі / үлесі):

- 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 %)

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