



Қазақстан қор биржасы
Казахстанская фондовая биржа
Kazakhstan Stock Exchange

Типовая презентация

на 01 апреля 2021 года

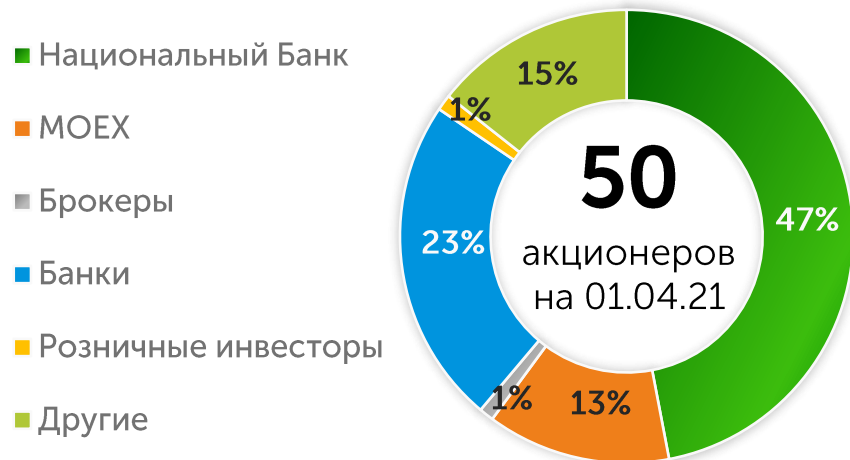


АО "Казахстанская фондовая биржа"

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

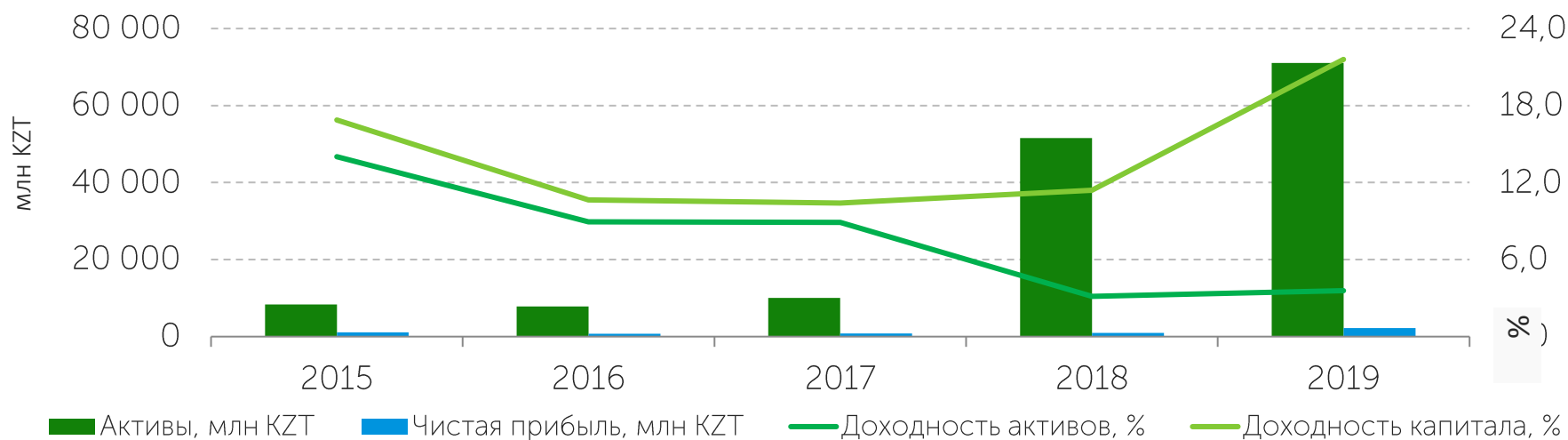
Акции и капитал KASE

На 01 января 2021 года:

собственный капитал	16 024,5 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	14 903,3 KZT

Показатели доходности KASE

	Активы, млн KZT	Чистая прибыль, млн KZT	Доходность активов, %	Доходность капитала, %
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
2015	8 331,3	979,2	14,0	16,9



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

41

Фондовая

32

Валютная

23

Деривативы

51

всего участников рынка

25

банков второго уровня (из 26)
резиденты РК

20

брокерских компаний (из 20)
резиденты РК

47

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

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

2017

- ООО "УНИВЕР Капитал" / фондовая и деривативы
- АО "АТФБанк" / деривативы
- АО "Евразийский Капитал" / деривативы

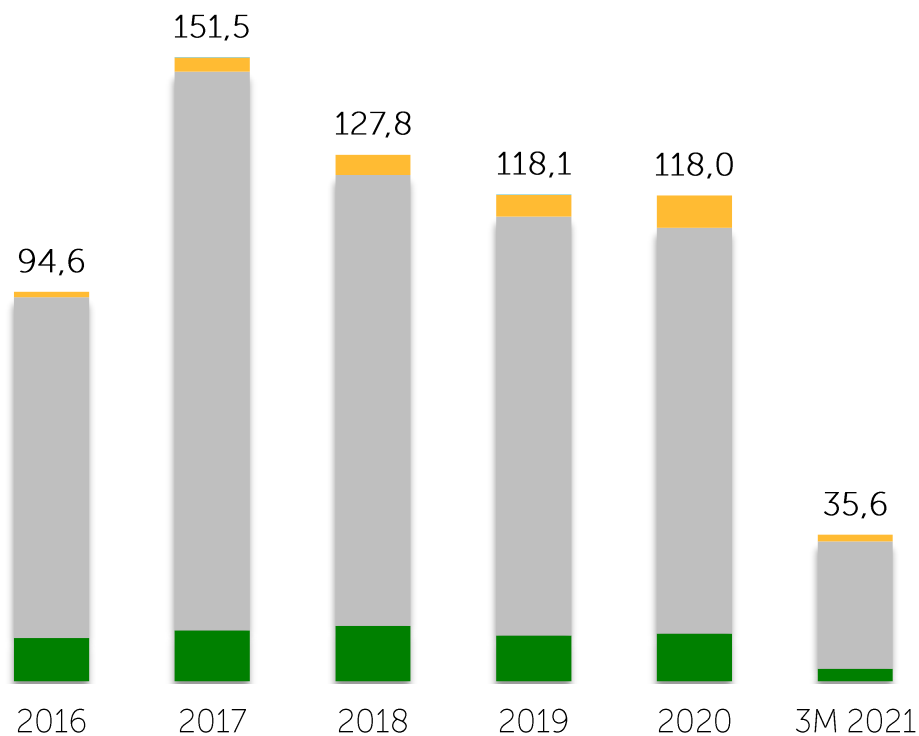
Показатели биржевого рынка за три месяца 2021 года

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	1 626,7	3 874,6	1 505	28 538,5	19,0
Акции	46,4	110,4	1 381	814,5	0,6
Корпоративные долговые ЦБ	574,8	1 371,3	21	10 085,0	485,9
ГЦБ	924,7	2 200,2	9	16 222,9	1 725,2
Облигации МФО	31,9	76,1	1	559,4	1 099,5
ЦБ инвестиционных фондов	17,3	41,3	93	303,4	3,3
Производные ценные бумаги	31,5	75,3	1	553,3	901,0
Рынок иностранных валют	3 065,5	7 300,9	384	53 779,9	140,2
Рынок денег	30 866,8	73 578,9	445	541 522,6	1 218,0
Операций репо	27 669,1	65 957,4	433	485 422,5	1 121,0
Операций валютного свопа	3 197,7	7 621,5	12	56 100,1	4 837,7
Деривативы	–	–	–	–	–
Итого	35 558,9	84 754,5	2 334	623 841,0	267,3

Объем и структура рынка

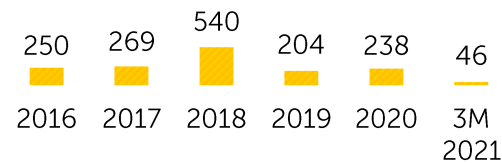


Динамика объема торгов по секторам, трлн KZT



Рынок акций

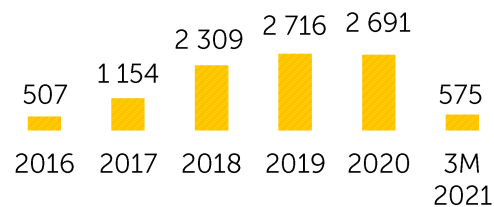
млрд KZT



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

Рынок корпоративных облигаций

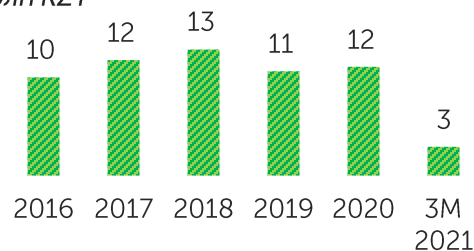
млрд KZT



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

Рынок иностранных валют

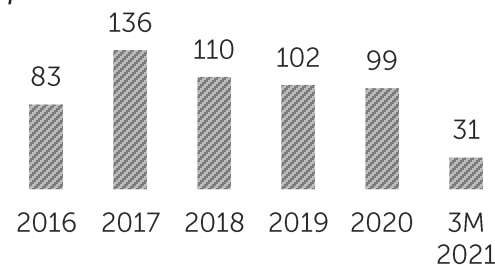
трлн KZT



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

Рынок денег

трлн KZT

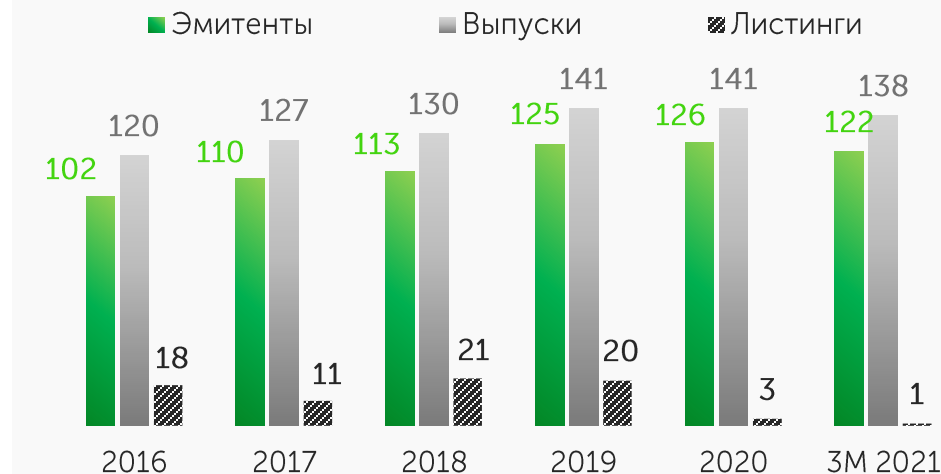


2020	+3%
2019	-7%
2018	-19%
2017	+64%
2016	+8%

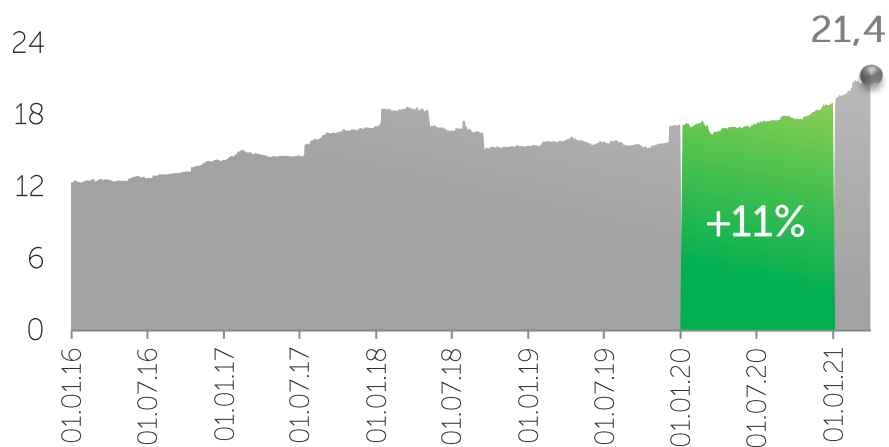
Объем сделок, млрд KZT



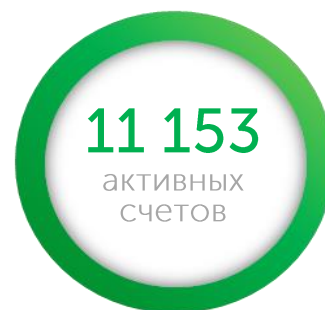
Новые листинги



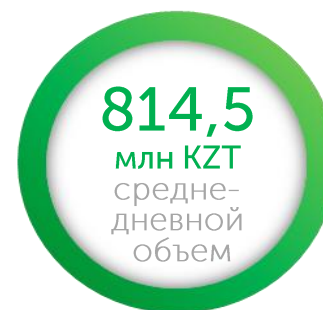
Капитализация рынка акций, трлн KZT



Основные показатели за 3М 2021 года



x2,8
к 3М 2020 года



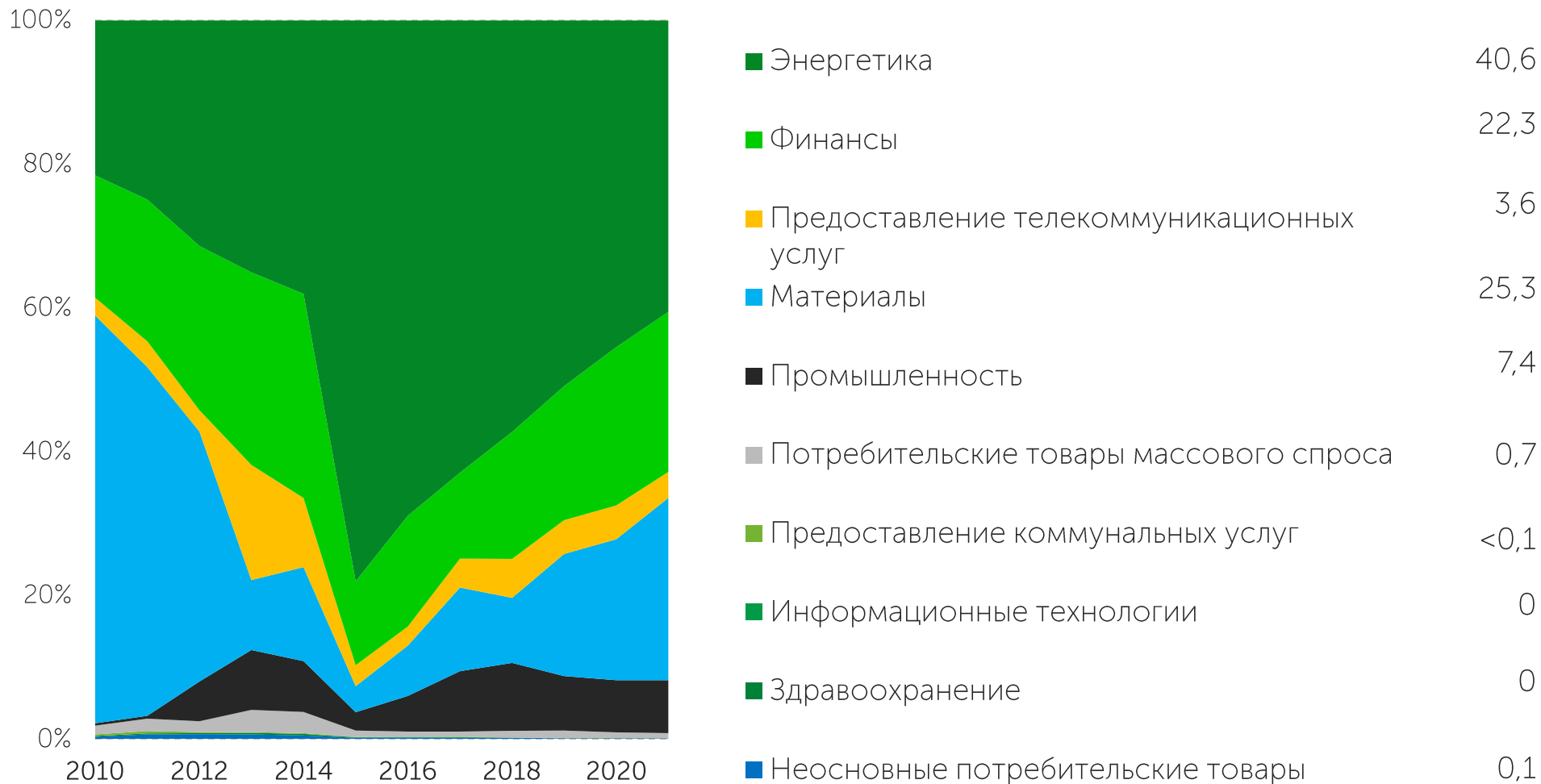
86,1%
к 3М 2020 года



x2,5
к 3М 2020 года

Отраслевая структура списков акций

Доля от капитализации, %

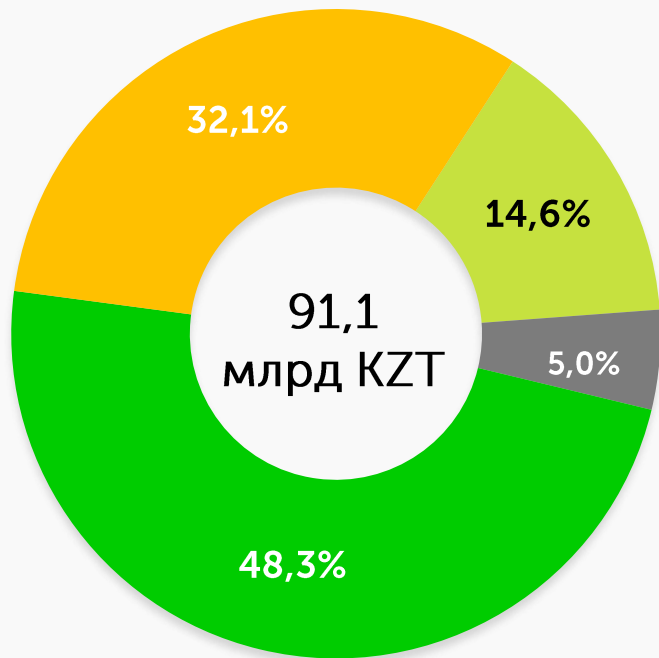


Примечание: в качестве классификатора используется "Global Industry Classification Standard (GICS)®"

Источник: KASE

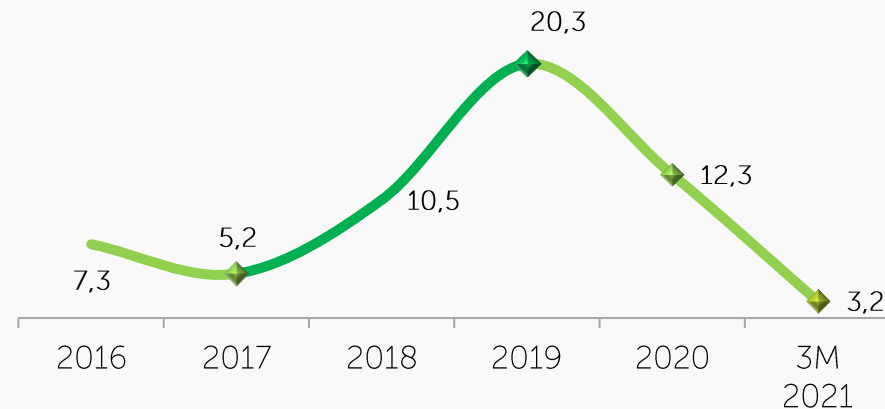
Рынок акций: инвесторская база

Доли основных категорий инвесторов на вторичном рынке за 3М 2021 года*

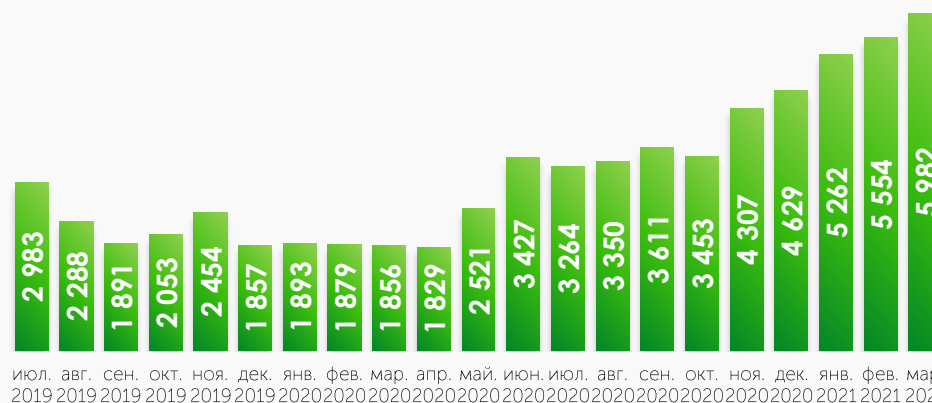


- Банки
- Брокеры-дилеры
- Др. институциональные инвесторы
- Физические лица
- Прочие юридические лица

Доля нерезидентов в брутто-обороте, %



Динамика активных счетов розничных инвесторов на рынке акций

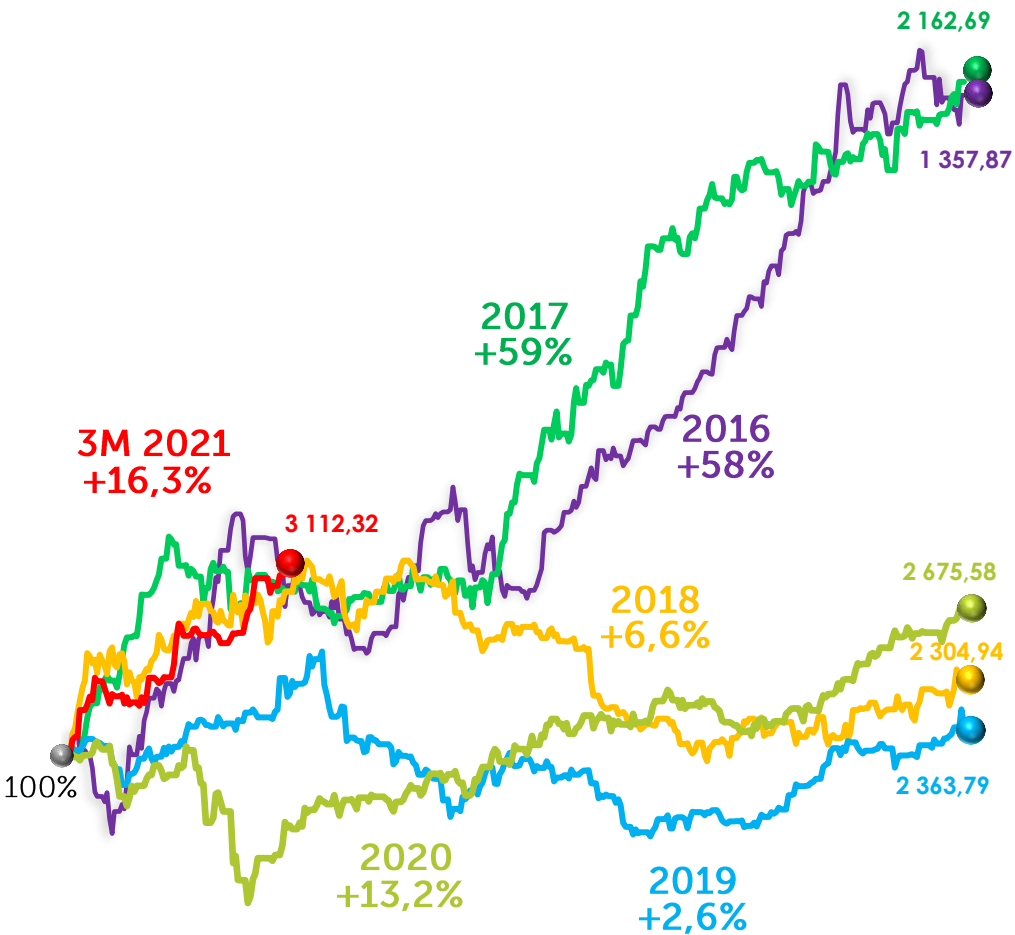


* от общего брутто-оборота торгов акциями на вторичном рынке без учета крупных сделок

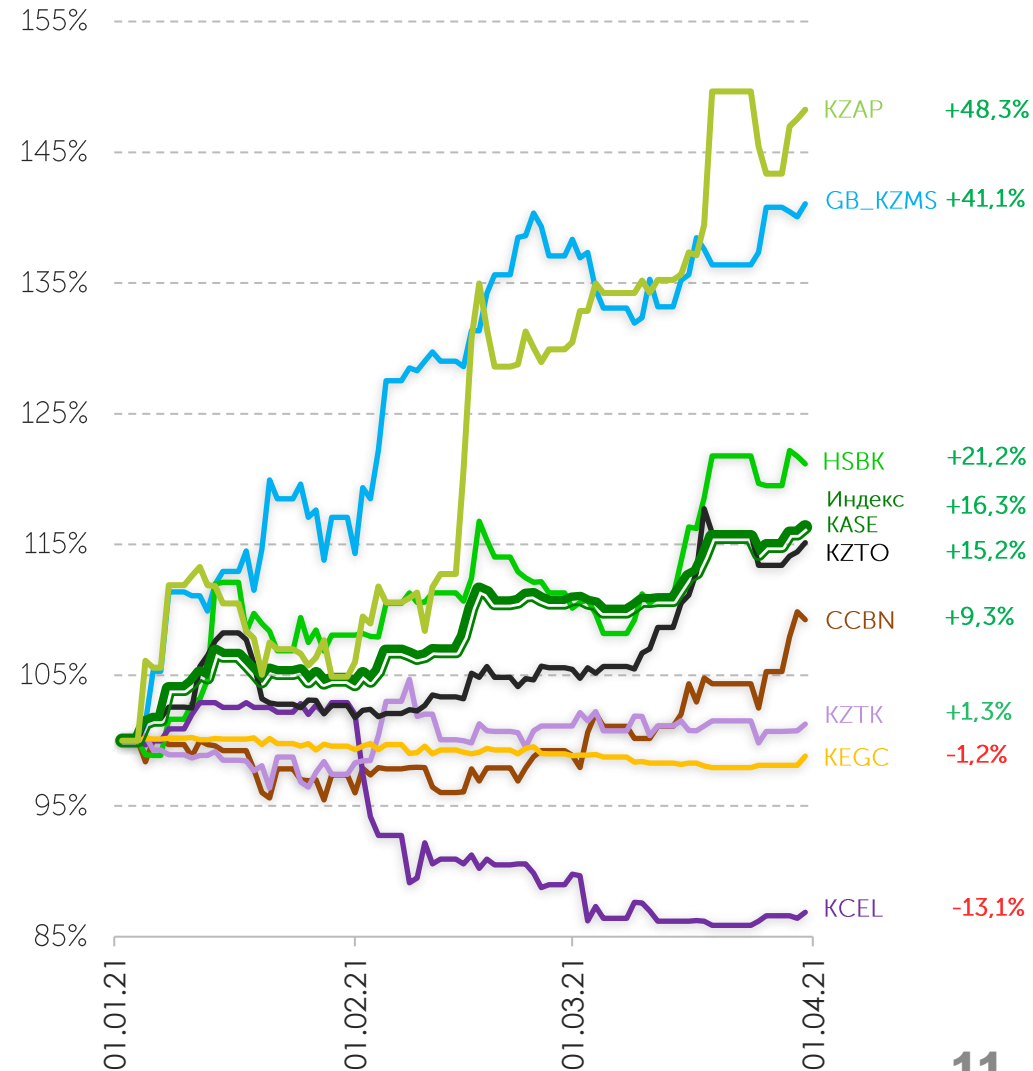
Источник: KASE

Динамика Индекса KASE

Индекс KASE в 2016 – 3М 2021



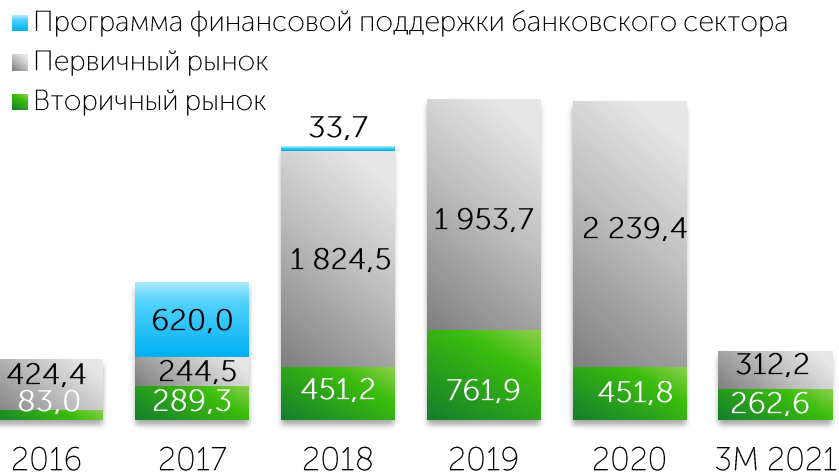
Динамика составляющих Индекса KASE



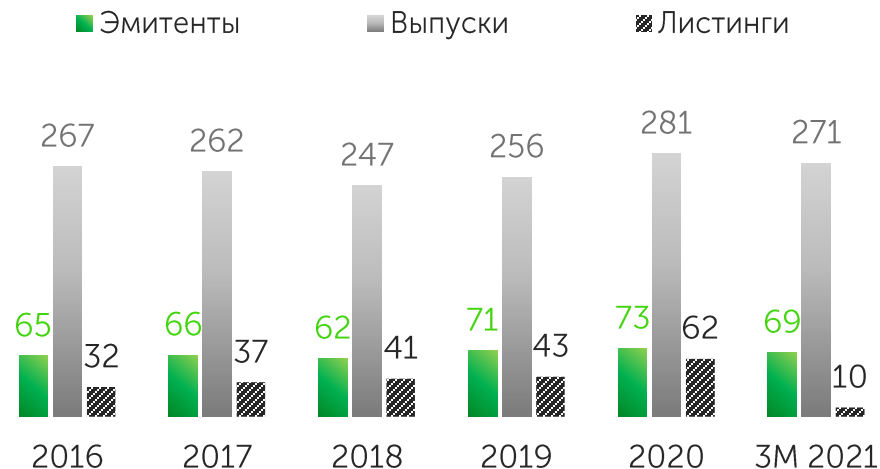
Источник: KASE, Bloomberg

Рынок корпоративных облигаций

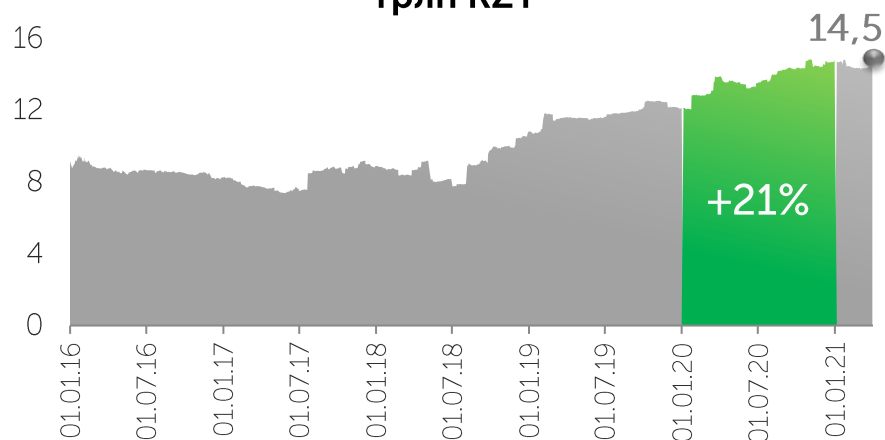
Объем сделок, млрд KZT



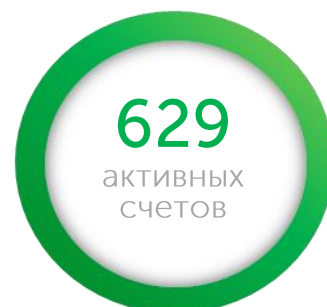
Новые листинги



Объем корпоративного долга в обращении, трлн KZT



Основные показатели за 3М 2021 года



х3,0
к 3М 2020 года

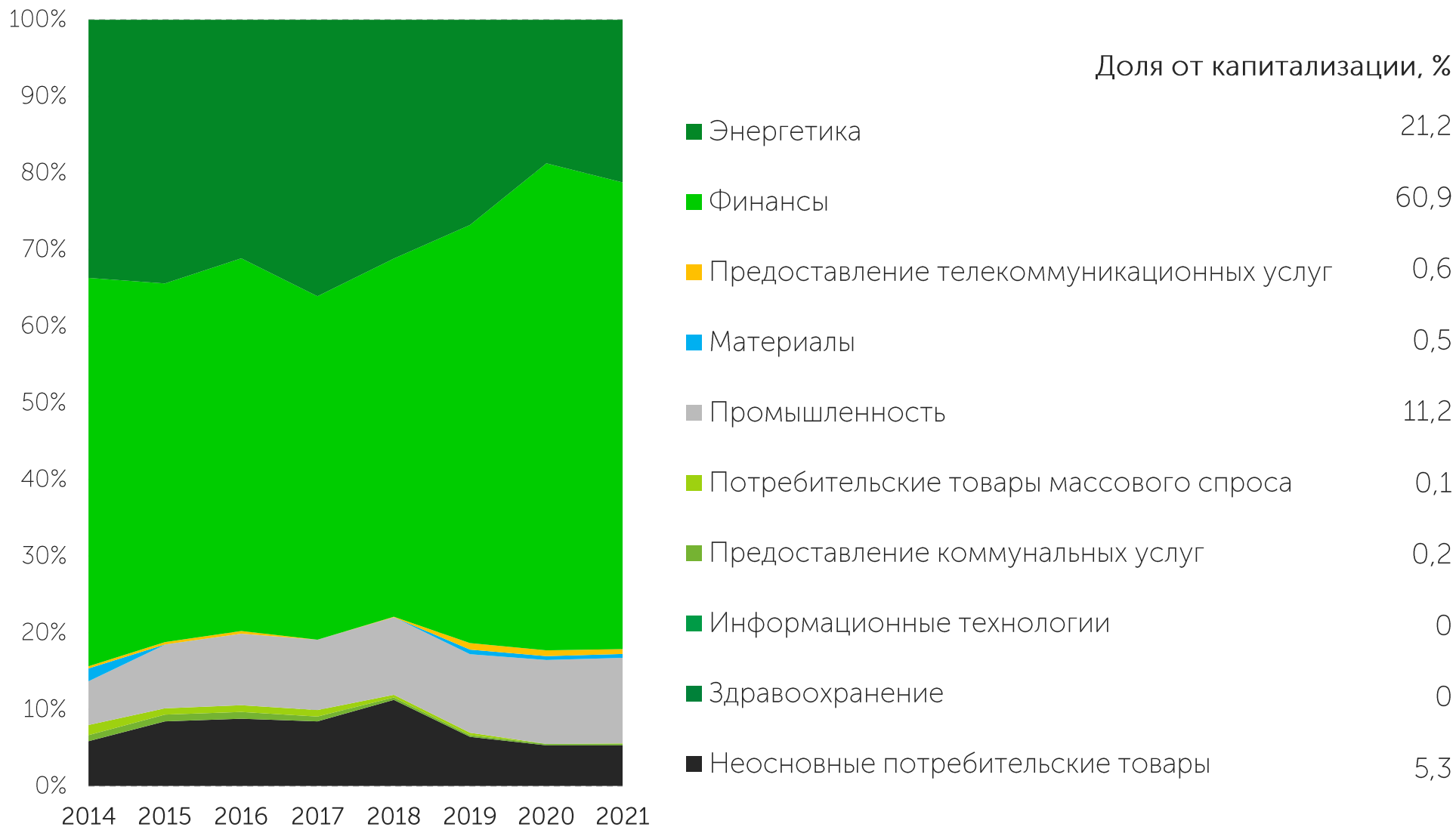


х2,0
к 3М 2020 года



х3,1
к 3М 2020 года

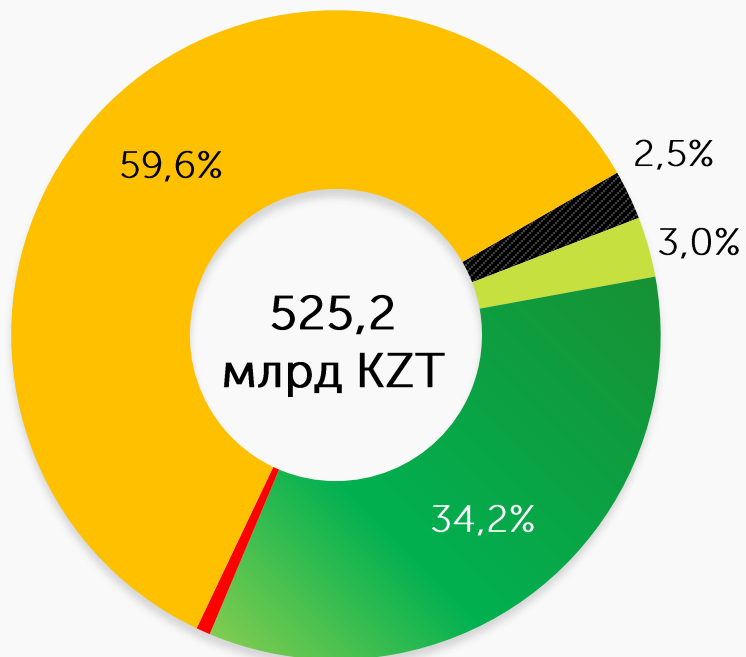
Отраслевая структура списков облигаций KASE



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

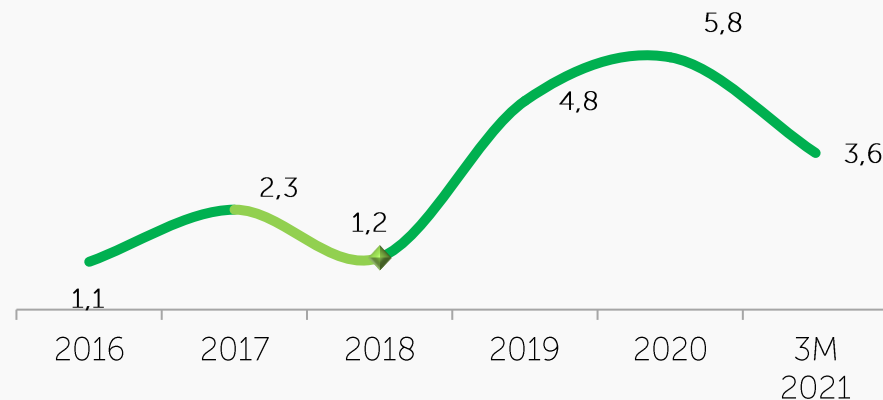
Инвесторская база рынка корпоративных облигаций KASE

Доли основных категорий инвесторов на вторичном рынке за 3М 2021 года*

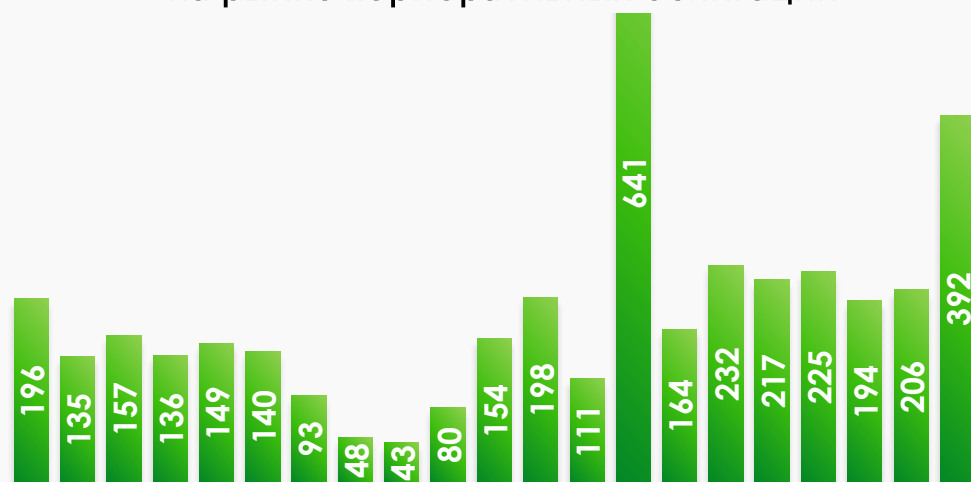


- Банки
- Брокеры-дилеры
- Др. институциональные инвесторы
- Физические лица
- Прочие юридические лица

Доля нерезидентов в брутто-обороте, %



Динамика активных счетов на рынке корпоративных облигаций



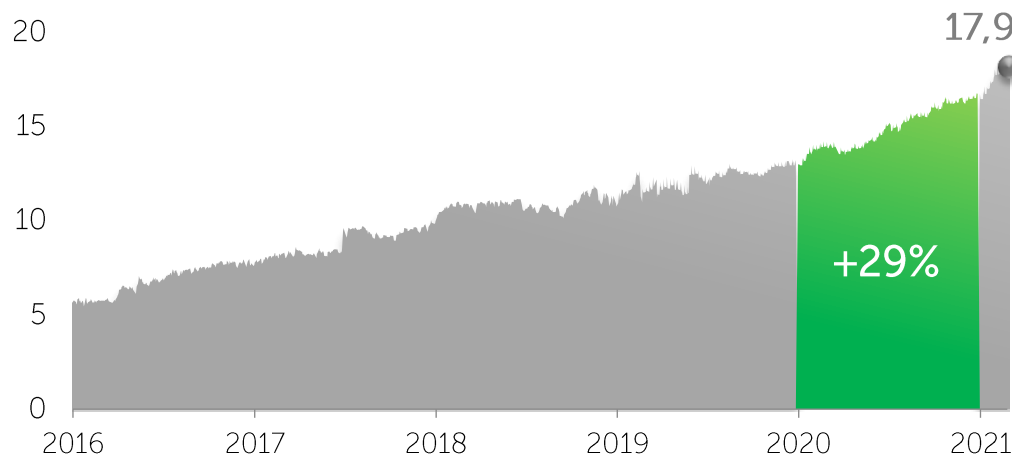
* от общего брутто-оборота торгов корпоративными облигациями на вторичном рынке

июл. 2019, авг. 2019, сен. 2019, окт. 2019, ноя. 2019, дек. 2019, янв. 2020, фев. 2020, мар. 2020, апр. 2020, май. 2020, июн. 2020, июл. 2020, авг. 2020, сен. 2020, окт. 2020, ноя. 2020, дек. 2020, янв. 2021, фев. 2021, мар. 2021

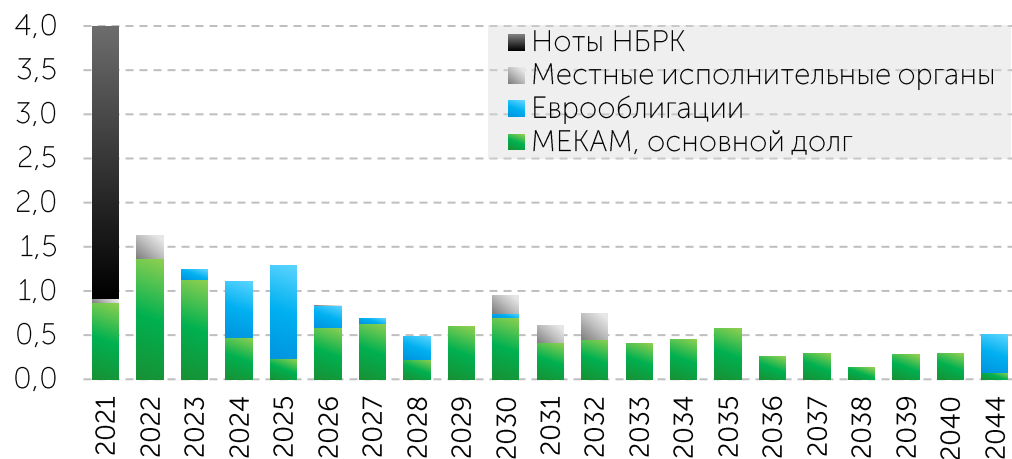
Динамика объема торгов, млрд KZT



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

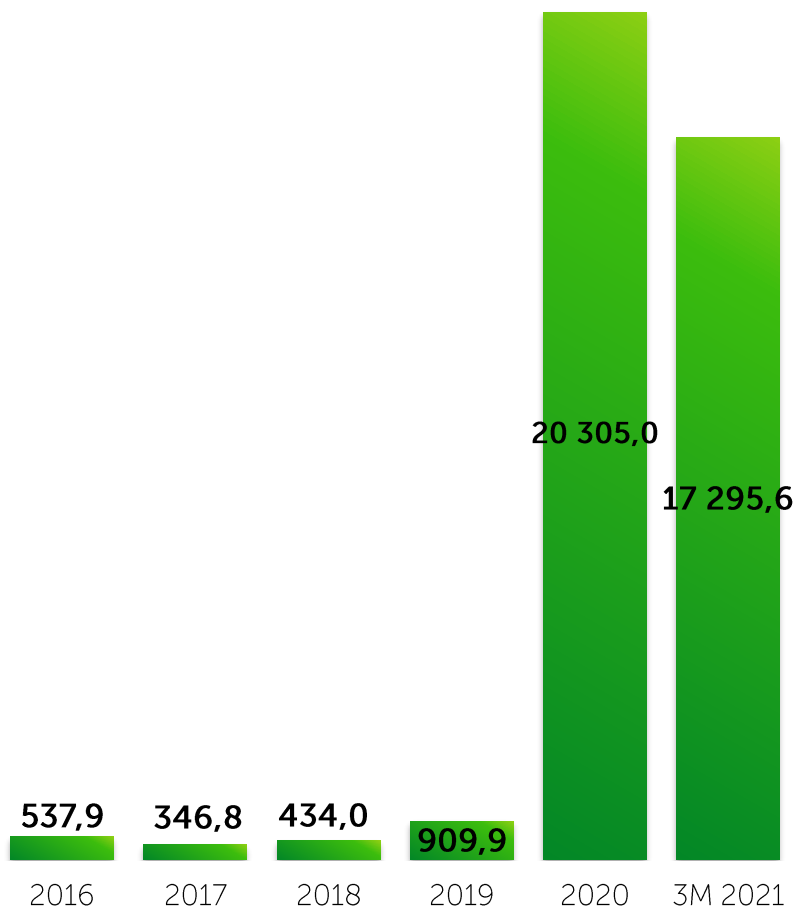


Динамика выплат по госдолгу, трлн KZT

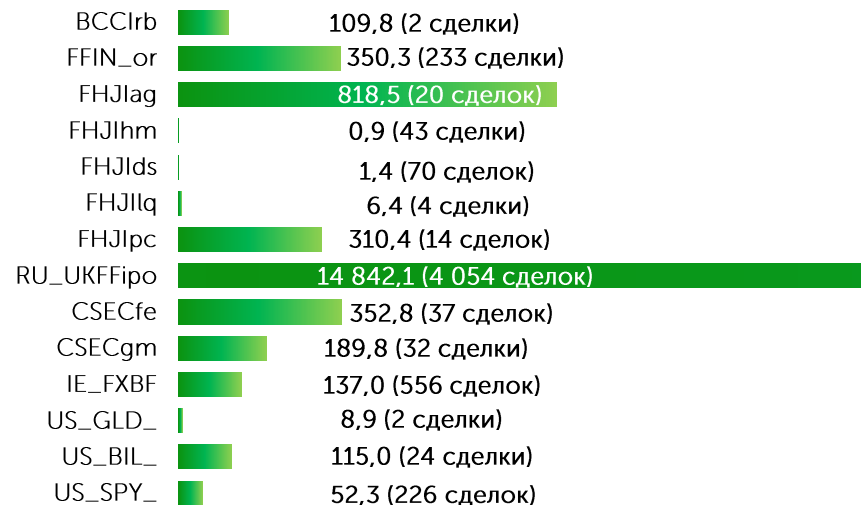


Источник: KASE

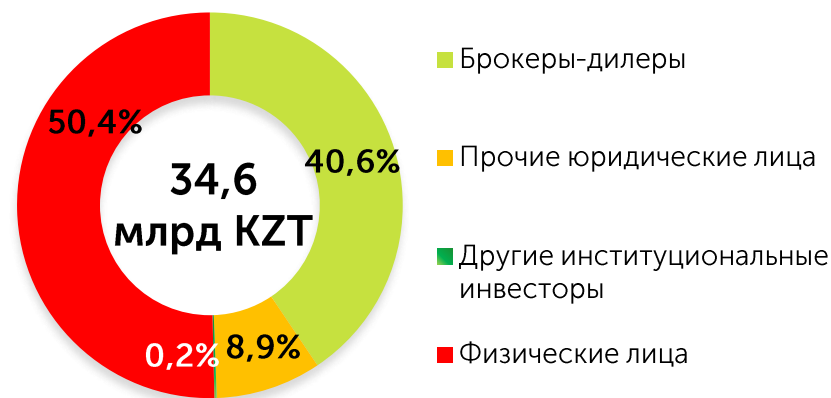
Объем сделок, млн KZT



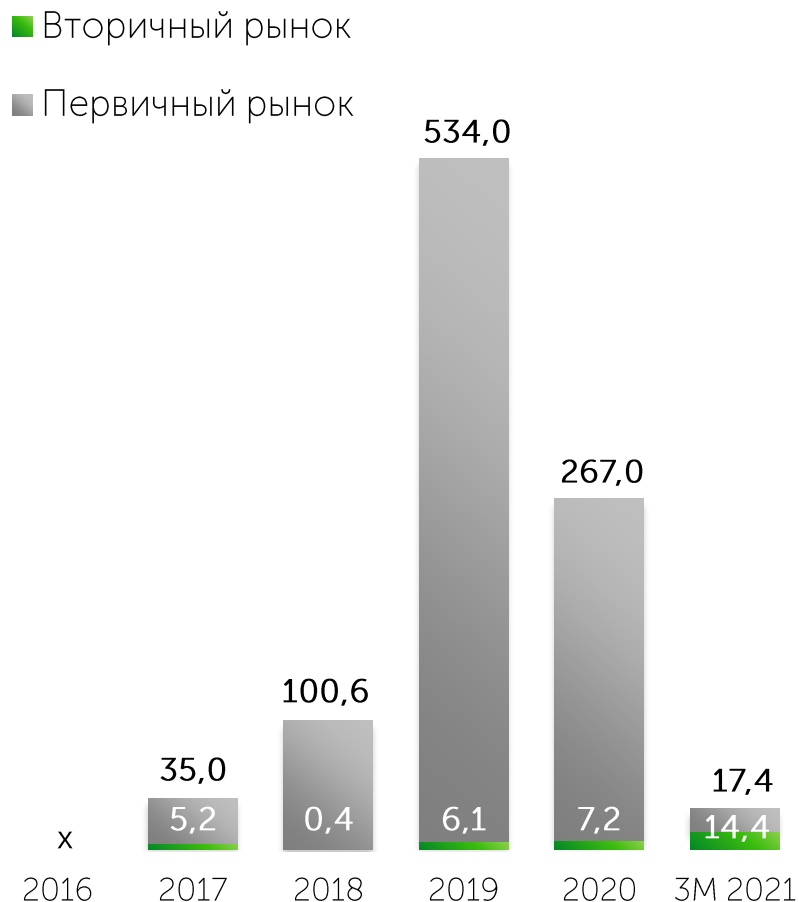
Объем торгов в разбивке по инструментам за 3М 2021 год, млн KZT



Доли основных категорий инвесторов за 3М 2021 год*



Объемы торгов, млрд KZT

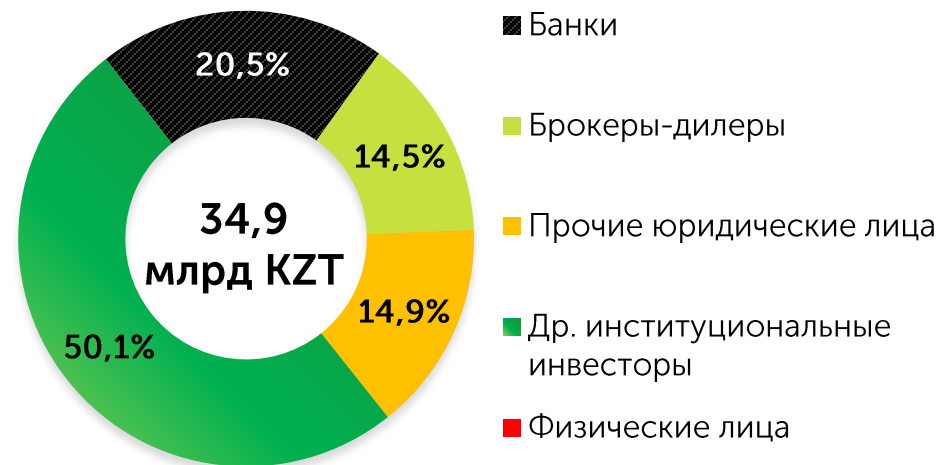


На 01 апреля 2021 года в официальном списке KASE находятся **35 выпуска облигаций**

4 организаций:

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

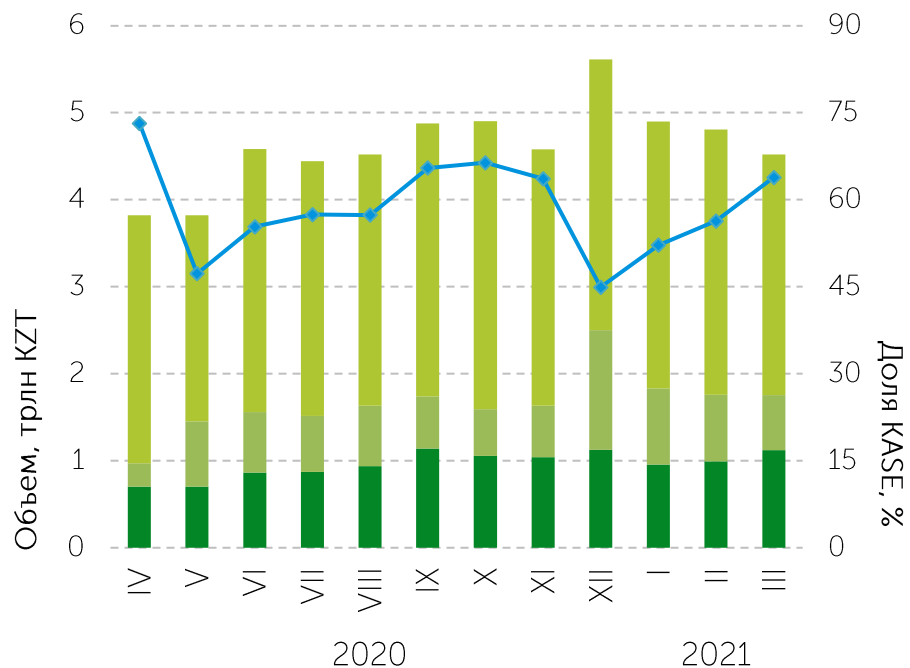
Доли основных категорий инвесторов за 3М 2021 года*



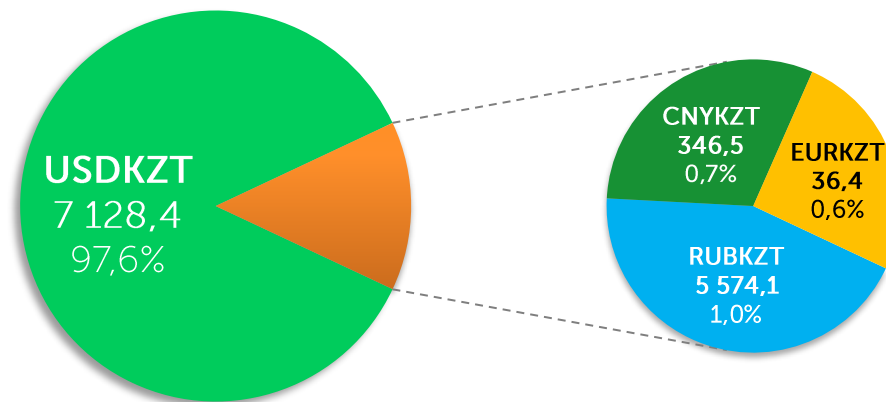
* от общего брутто-оборота торгов облигациями МФО, из расчета исключена позиция инициатора специализированных торгов

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

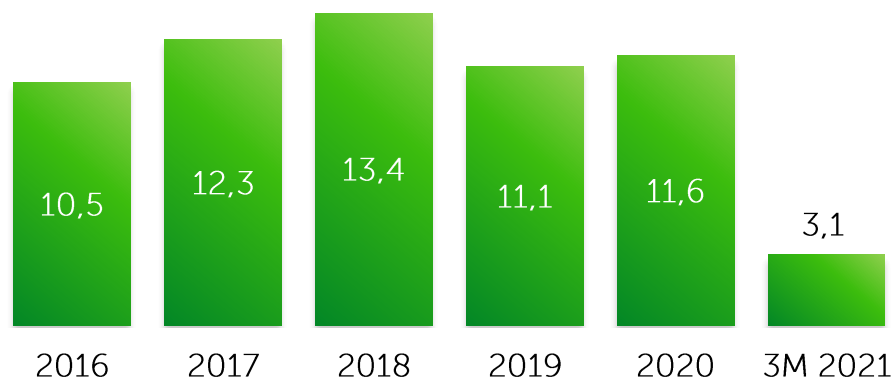


Структура биржевого рынка за 3М 2021 года в объеме торгов. Объем в млн единиц валюты



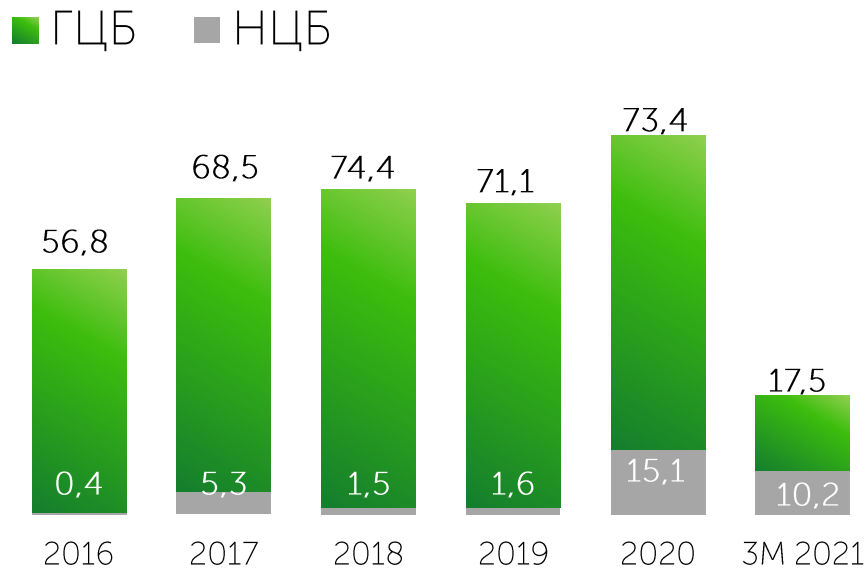
Примечание: доли рассчитаны от объема торгов в KZT

Объем торгов на спот-рынке, трлн KZT



Рынок операций репо

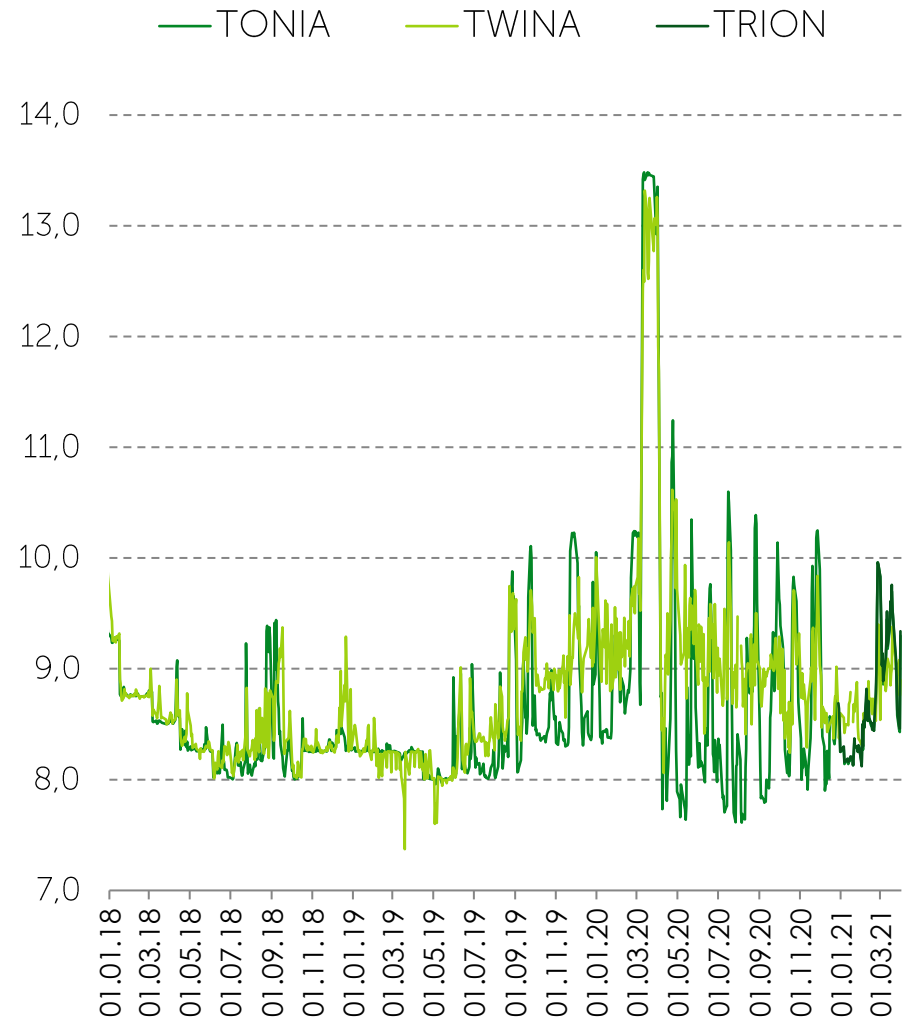
Объем торгов, трлн KZT



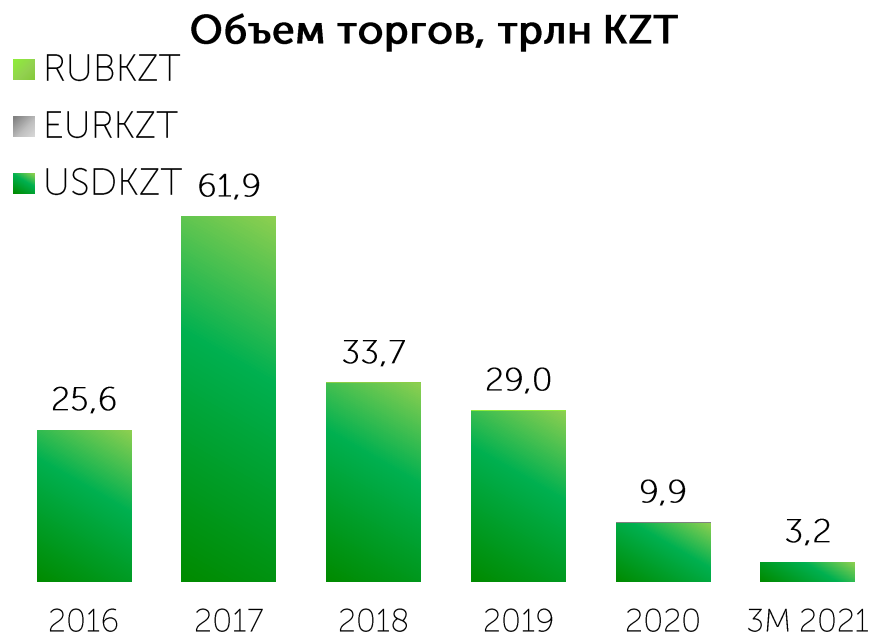
Инструменты рынка репо (объем за 3М 2021 / доля):

- Авторепо с корзиной ГЦБ (24 723,4 млрд KZT / 89,35 %)
- Авторепо с корзиной ОДГУ (639,5 млрд KZT / 2,31 %)
- Авторепо с НЦБ (2 288,1 млрд KZT / 8,27 %)
- Прямое репо с НЦБ (18,1 млрд KZT / 0,07 %)
- Прямое репо с ГЦБ (6,6 млн KZT / <0,01%)

Индикаторы репо, % годовых



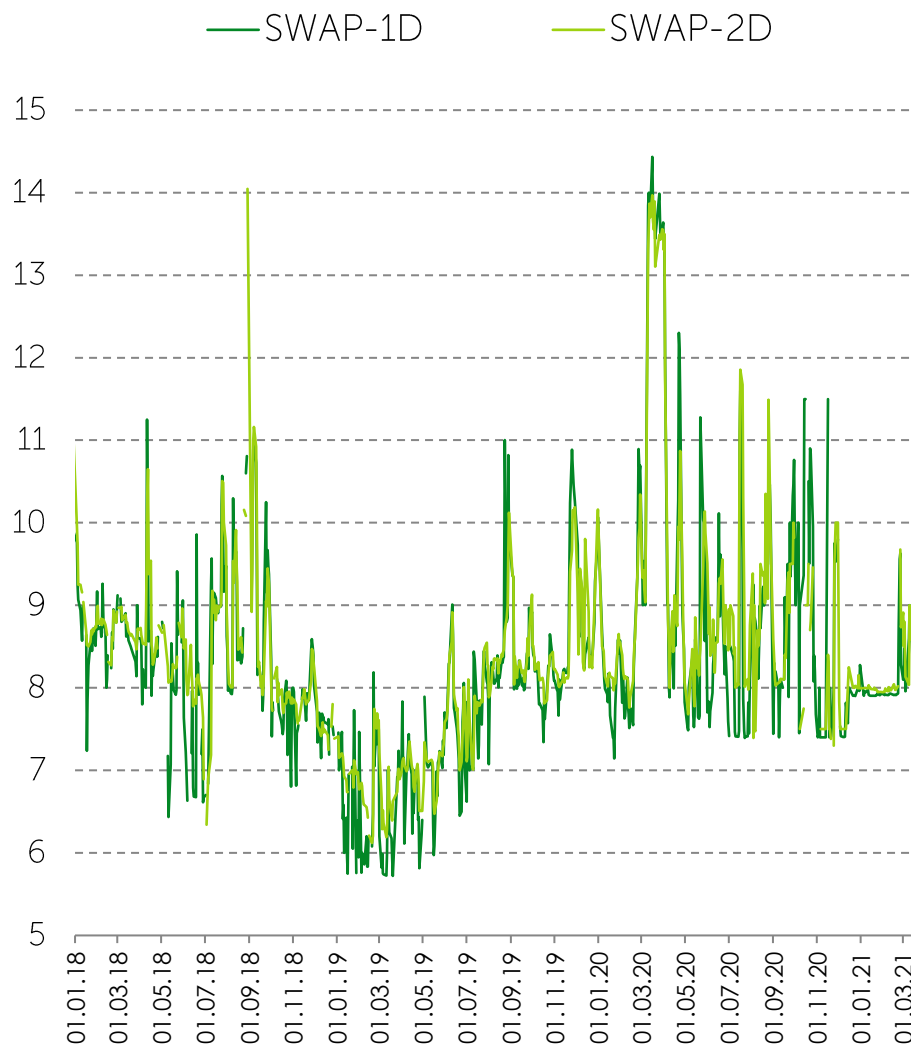
Рынок операций валютного свопа



Инструменты рынка операций валютного свопа
(объем за 3М 2021/ доля):

- **USDKZT_0_001** (1 820,8 млрд KZT / 56,94 %)
- USDKZT_0_002 (1 244,8 млрд KZT / 38,93 %)
- USDKZT_0_01W (12,6 млрд KZT / 0,39 %)
- USDKZT_0_01M (119,6 млрд KZT / 3,74 %)

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
e-mail: info@kase.kz
www.kase.kz