

# Типовая презентация

*на 01 ноября 2021 года*



## АО "Казахстанская фондовая биржа"

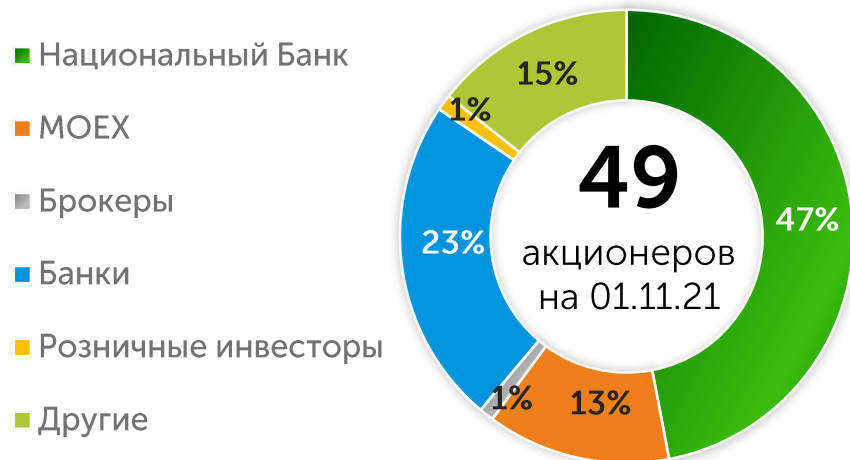
47,0% - НБРК

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



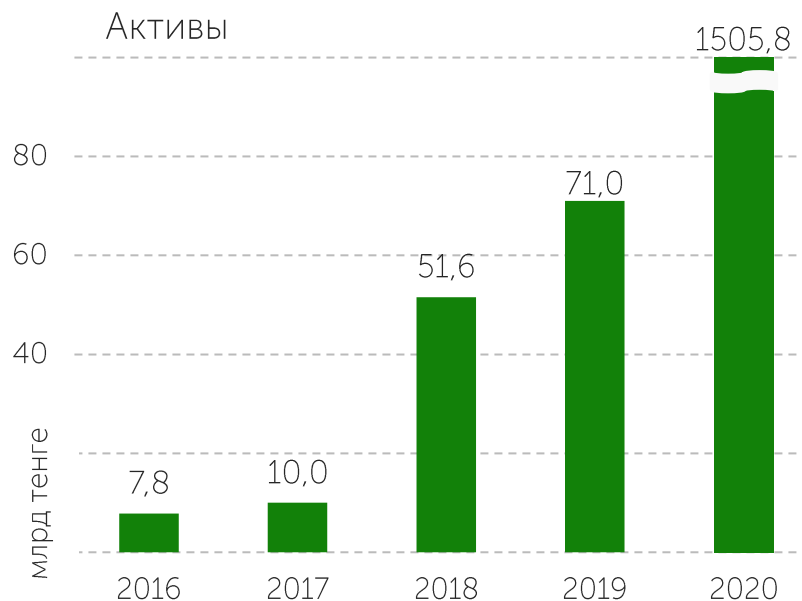
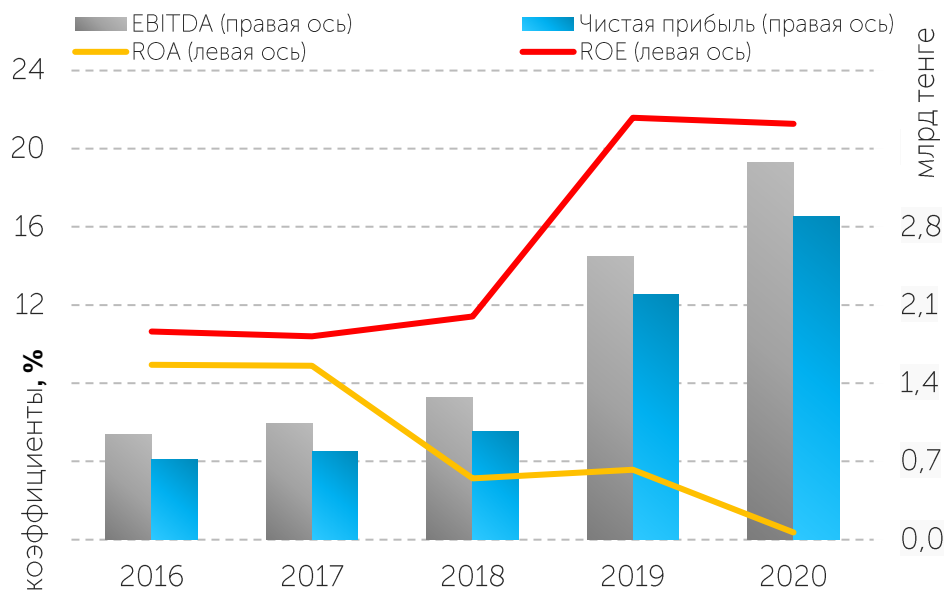
# Акции и капитал KASE

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

31

Валютная

23

Деривативы

49

всего участников рынка

22

банков второго уровня (из 22)  
*резиденты РК*

20

брокерских компаний (из 20)  
*резиденты РК*

44

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

### 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

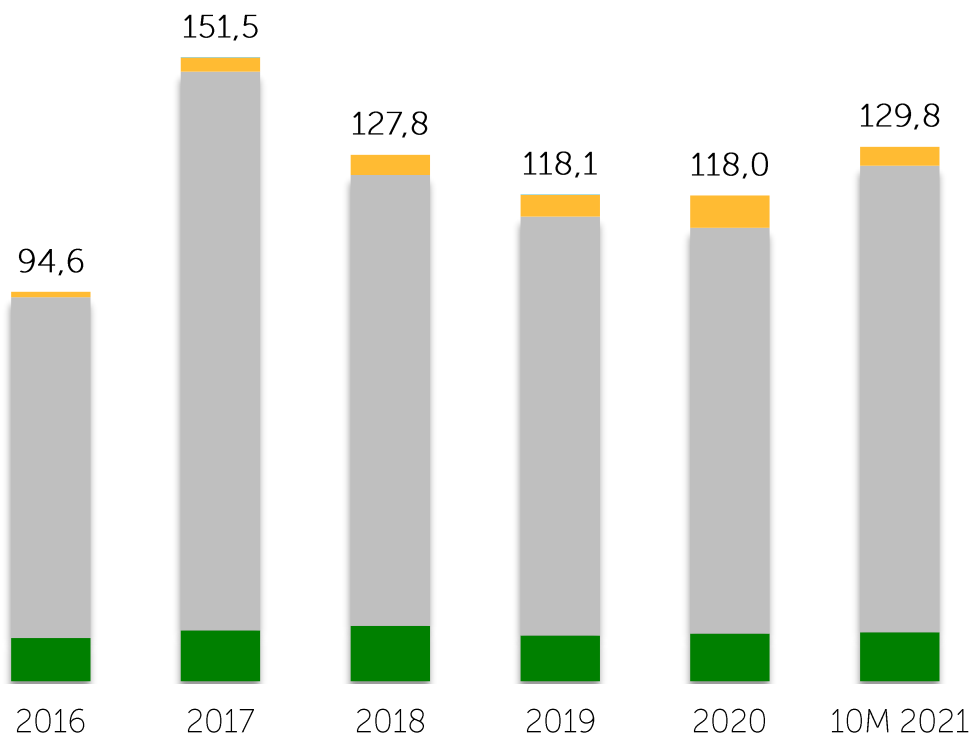
## Показатели биржевого рынка за десять месяцев 2021 года

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	4 639,4	10 937,6	1 890	22 854,0	12,1
Акции	197,4	464,4	1 750	972,5	0,6
Корпоративные долговые ЦБ	1 540,8	3 637,9	32	7 590,1	239,8
ГЦБ	2 708,5	6 379,8	10	13 342,5	1 310,4
Облигации МФО	121,0	285,3	<1	595,8	1 025,0
ЦБ инвестиционных фондов	33,9	80,3	97	167,2	1,7
Производные ценные бумаги	37,7	89,7	<1	185,8	327,9
Рынок иностранных валют	11 910,3	28 024,5	402	58 671,6	145,9
Рынок денег	113 270,9	266 727,3	539	557 984,6	1 035,9
Операций репо	104 799,0	246 748,6	527	516 251,3	980,1
Операций валютного свопа	8 471,9	19 978,8	12	41 733,3	3 500,8
Деривативы	<0,1	<0,1	<1	<0,1	0,2
Итого	129 820,6	305 689,5	2 831	639 510,1	225,9

# Объем и структура рынка

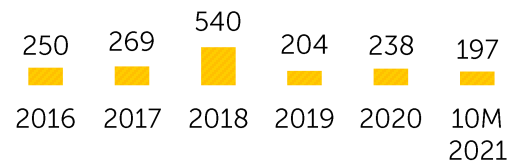


Динамика объема торгов по секторам, трлн KZT



## Рынок акций

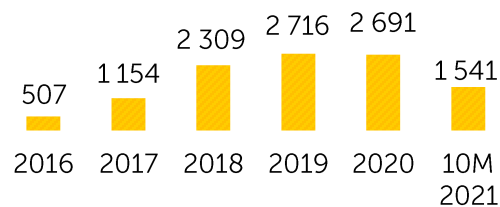
млрд KZT



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

## Рынок корпоративных облигаций

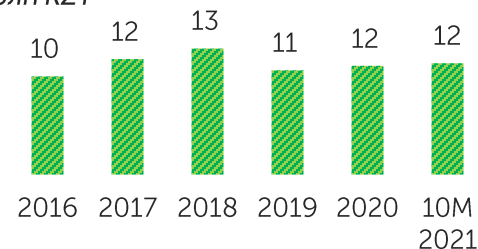
млрд KZT



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

## Рынок иностранных валют

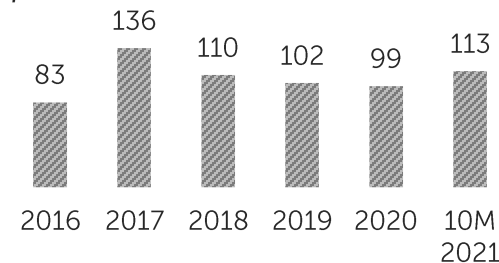
трлн KZT



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

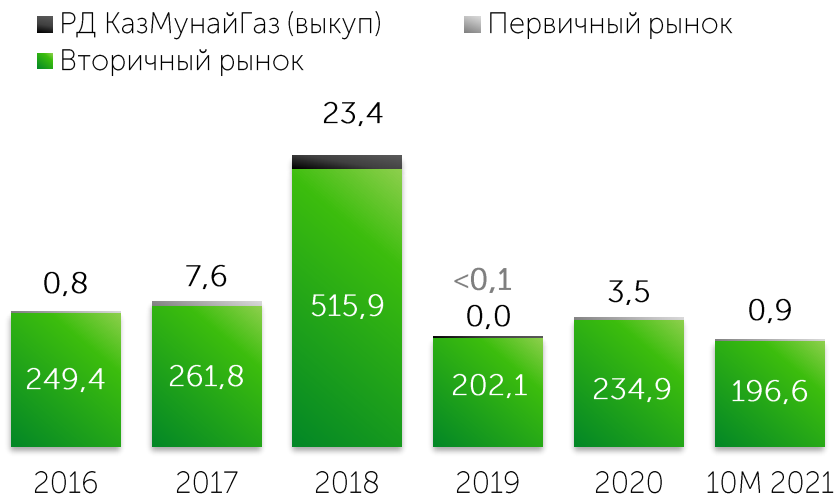
## Рынок денег

трлн KZT

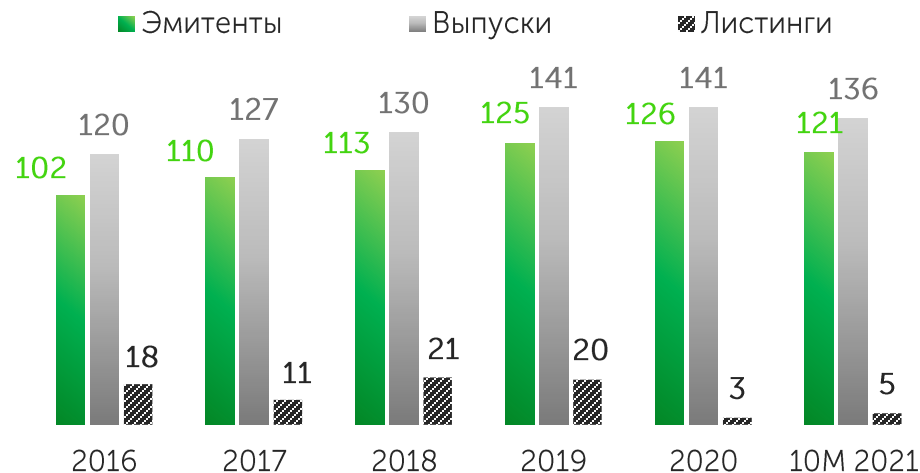


2020	-3%
2019	-7%
2018	-19%
2017	+64%
2016	+8%

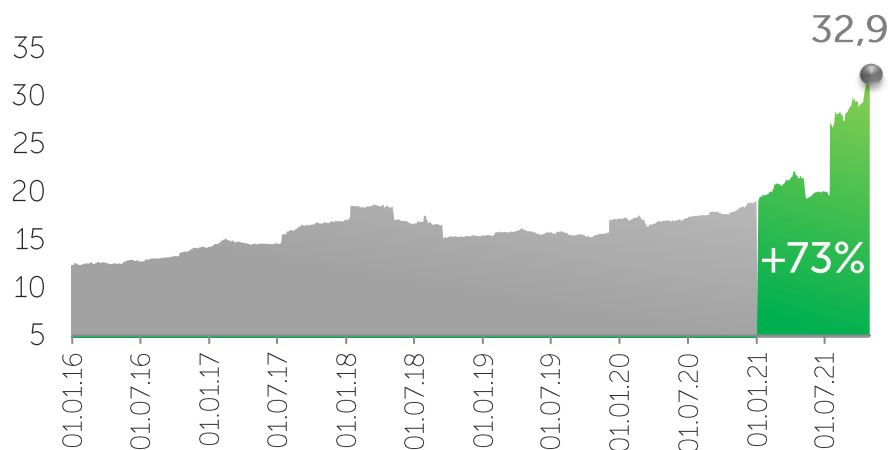
## Объем сделок, млрд KZT



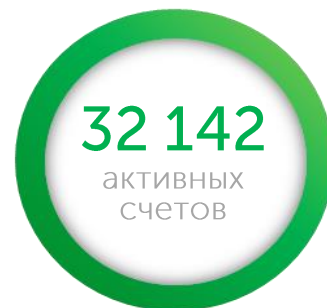
## Новые листинги



## Капитализация рынка акций, трлн KZT



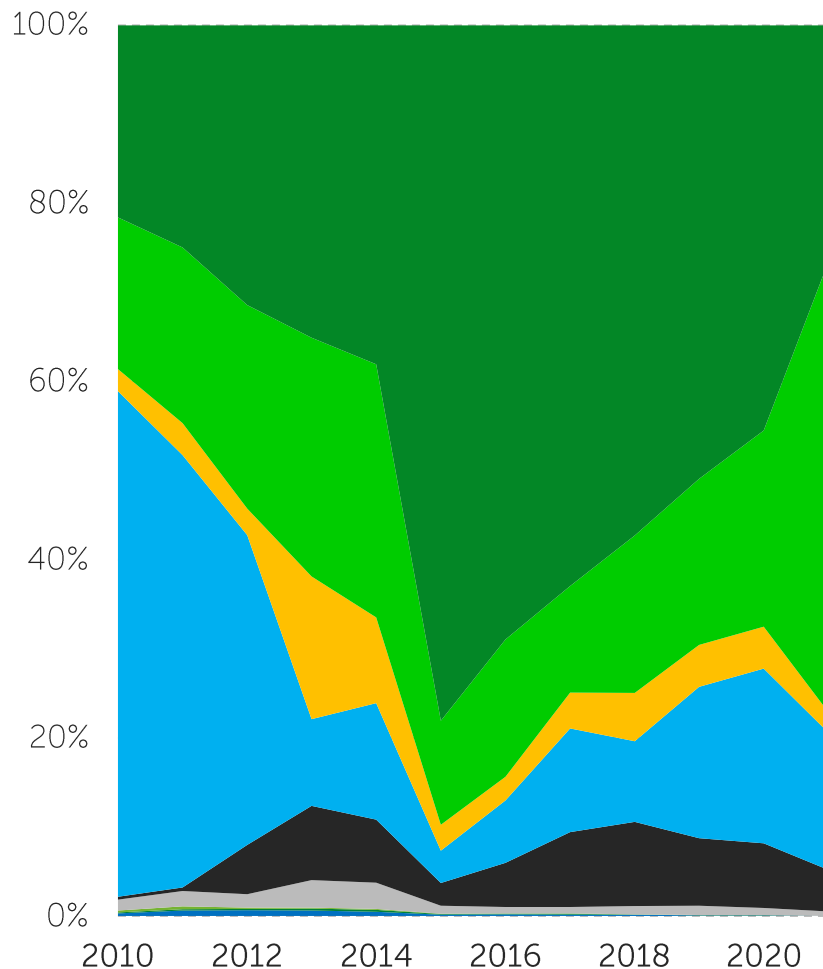
## Основные показатели за 10М 2021 года





# Отраслевая структура списков акций

Доля от капитализации, %



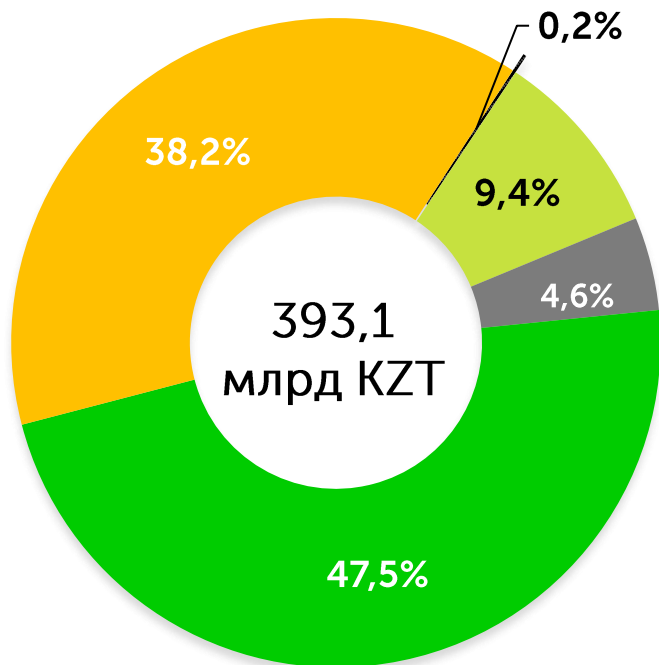
■ Энергетика	26,6
■ Финансы	50,5
■ Предоставление телекоммуникационных услуг	2,3
■ Материалы	15,4
■ Промышленность	4,7
■ Потребительские товары массового спроса	0,5
■ Предоставление коммунальных услуг	<0,1
■ Информационные технологии	0
■ Здравоохранение	0
■ Неосновные потребительские товары	0

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

Источник: KASE

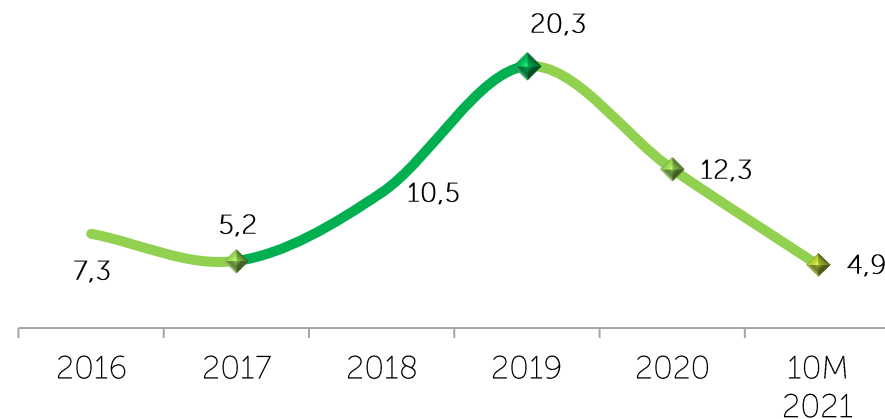
# Рынок акций: инвесторская база

Доли основных категорий инвесторов на вторичном рынке за 10М 2021 года\*

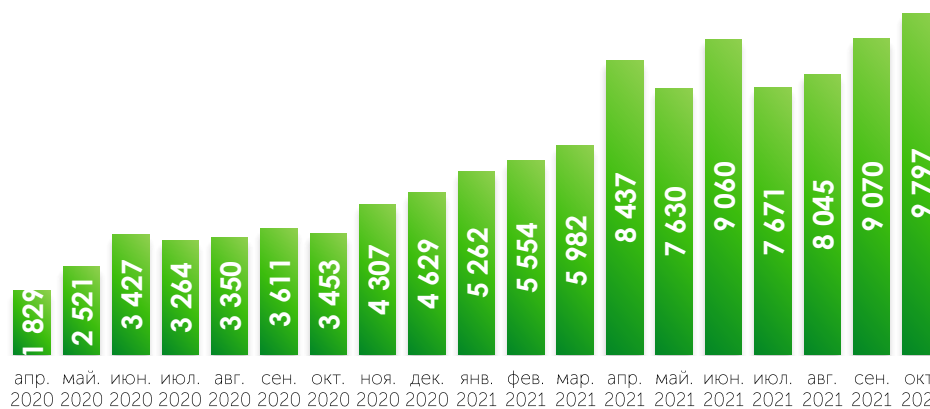


- Банки
- Брокеры-дилеры
- Др. институциональные инвесторы
- Физические лица
- Прочие юридические лица

Доля нерезидентов в брутто-обороте, %



Динамика активных счетов розничных инвесторов на рынке акций

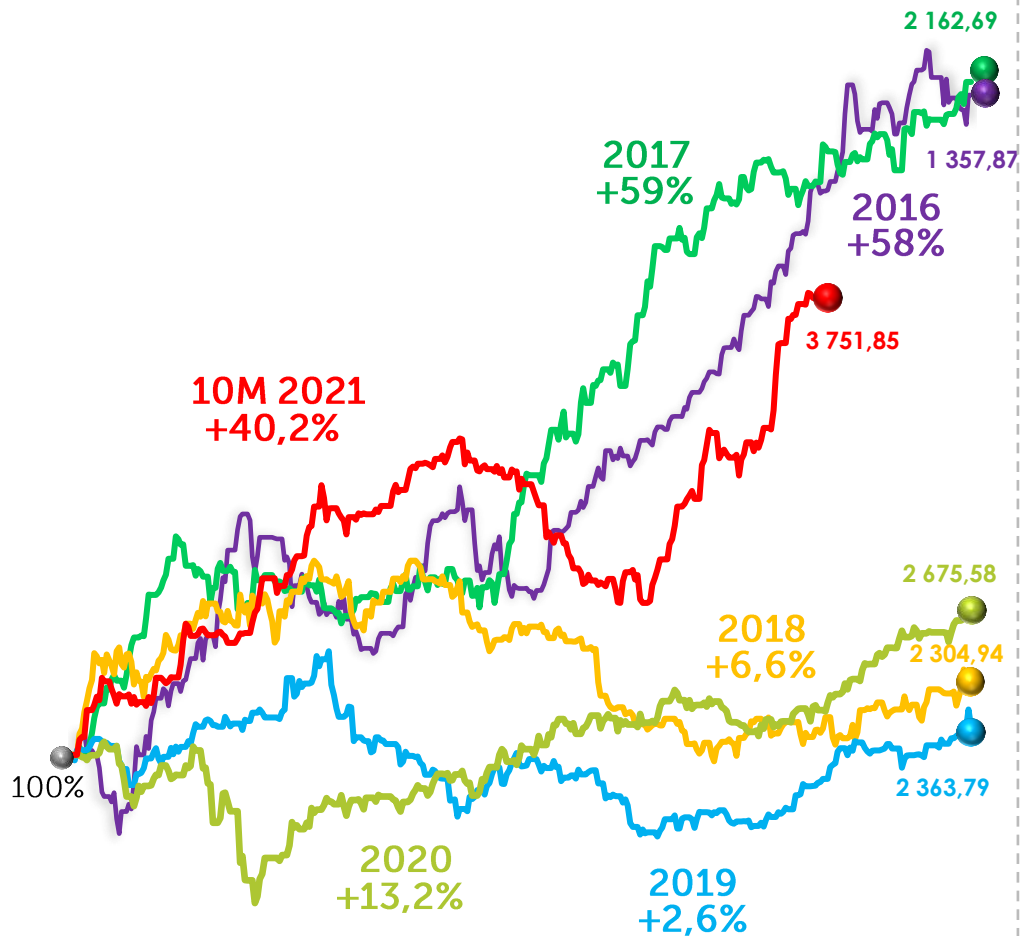


\* от общего брутто-оборота торгов акциями на вторичном рынке без учета крупных сделок

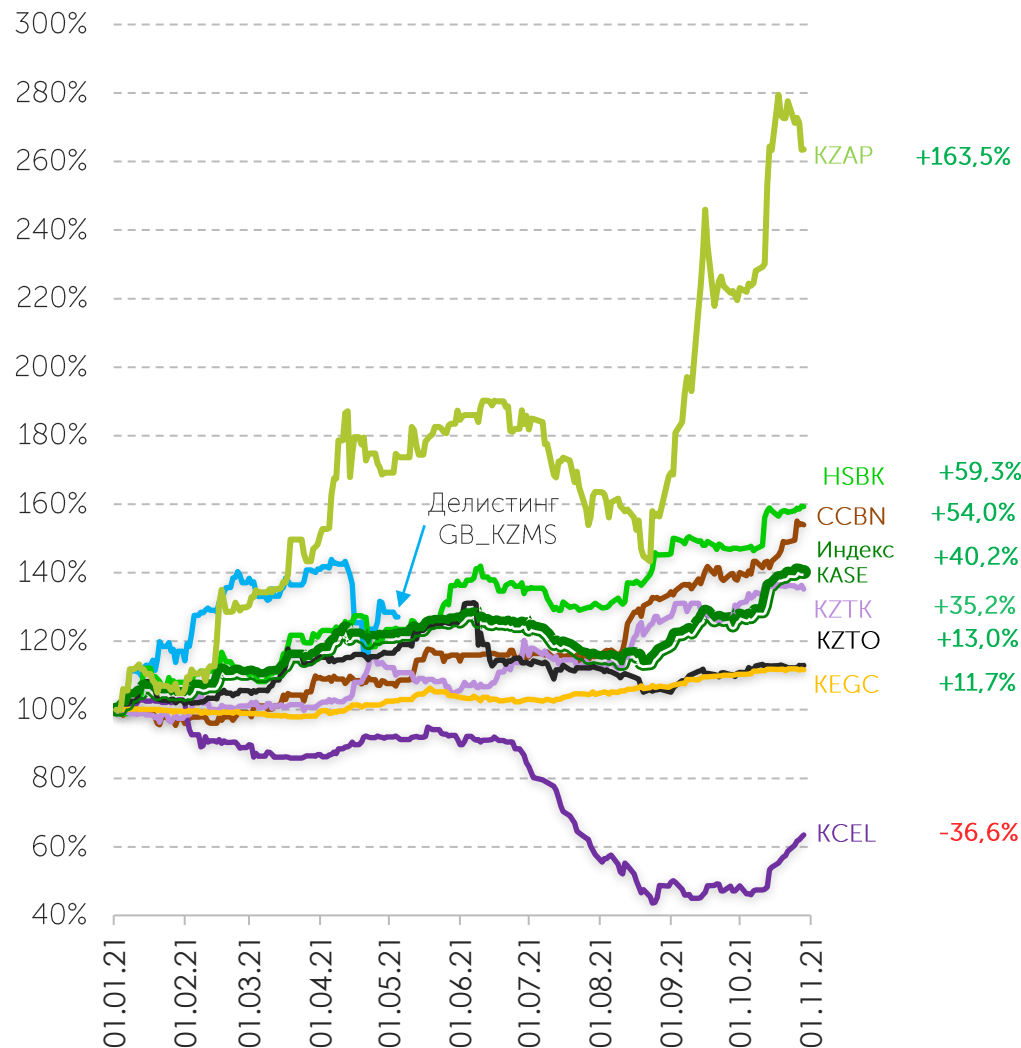
Источник: KASE

# Динамика Индекса KASE

## Индекс KASE в 2016 – 10М 2021



## Динамика составляющих Индекса KASE

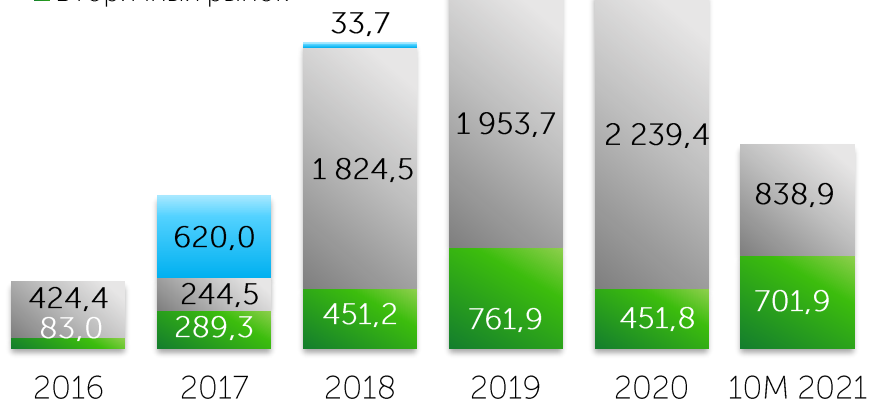


Источник: KASE, Bloomberg

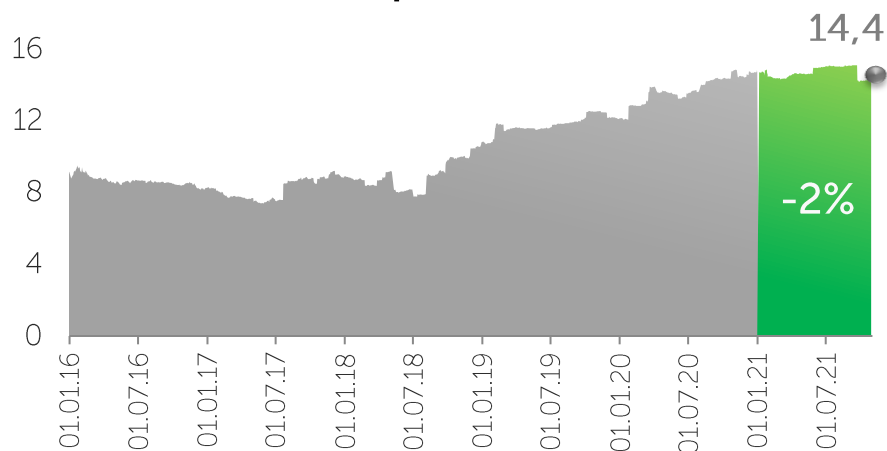
# Рынок корпоративных облигаций

## Объем сделок, млрд KZT

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

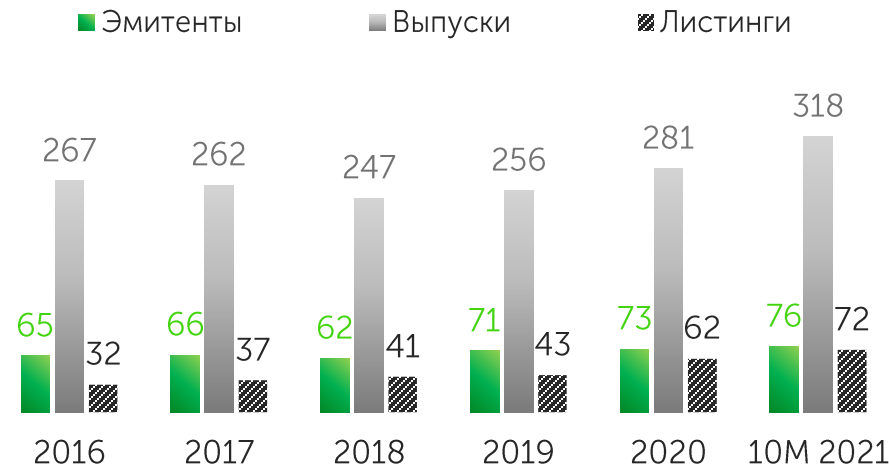


## Объем корпоративного долга в обращении, трлн KZT

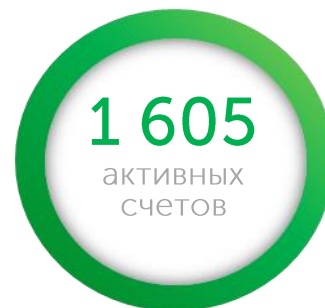


Источник: KASE

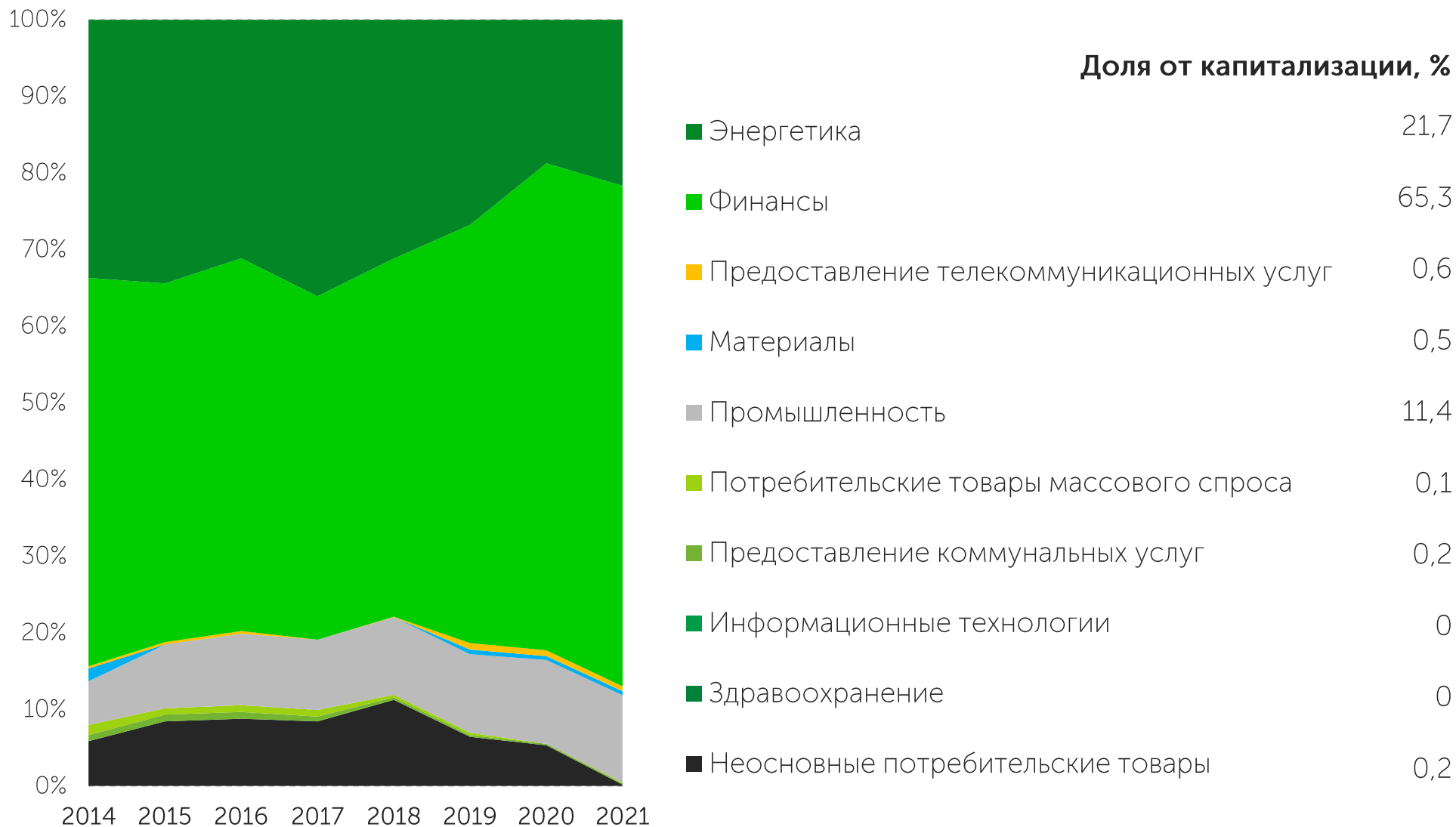
## Новые листинги



## Основные показатели за 9М 2021 года



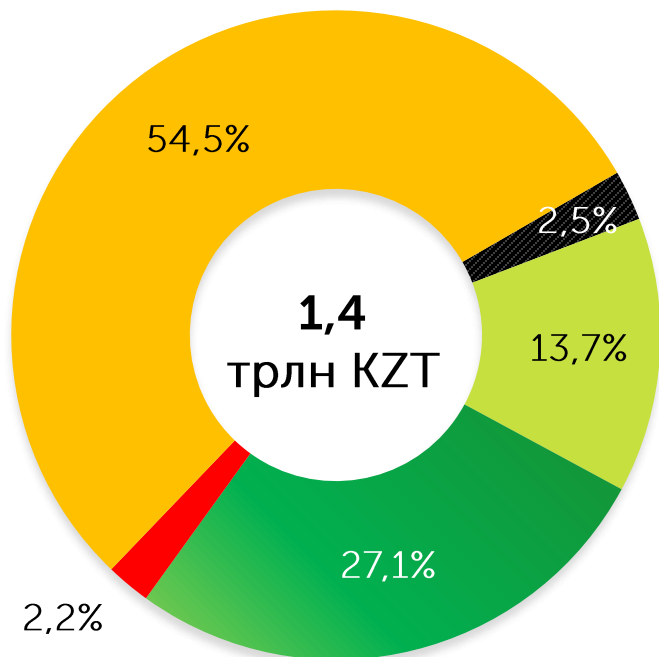
# Отраслевая структура списков облигаций KASE



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

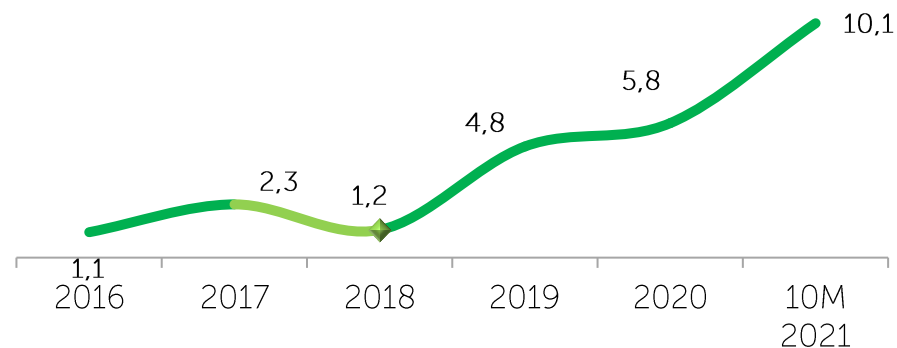
# Инвесторская база рынка корпоративных облигаций KASE

Доли основных категорий инвесторов на вторичном рынке за 10М 2021 года\*

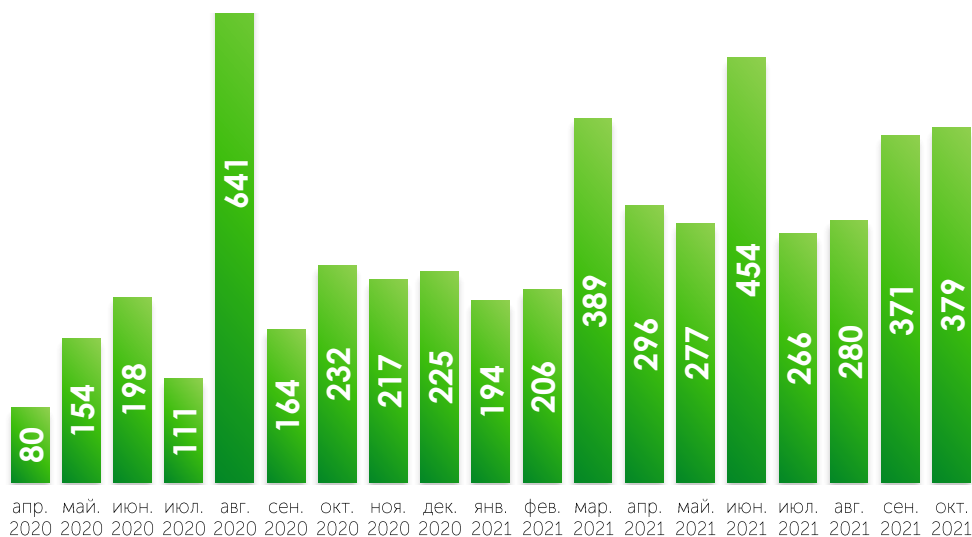


- Банки
- Брокеры-дилеры
- Др. институциональные инвесторы
- Физические лица
- Прочие юридические лица

Доля нерезидентов в брутто-обороте, %

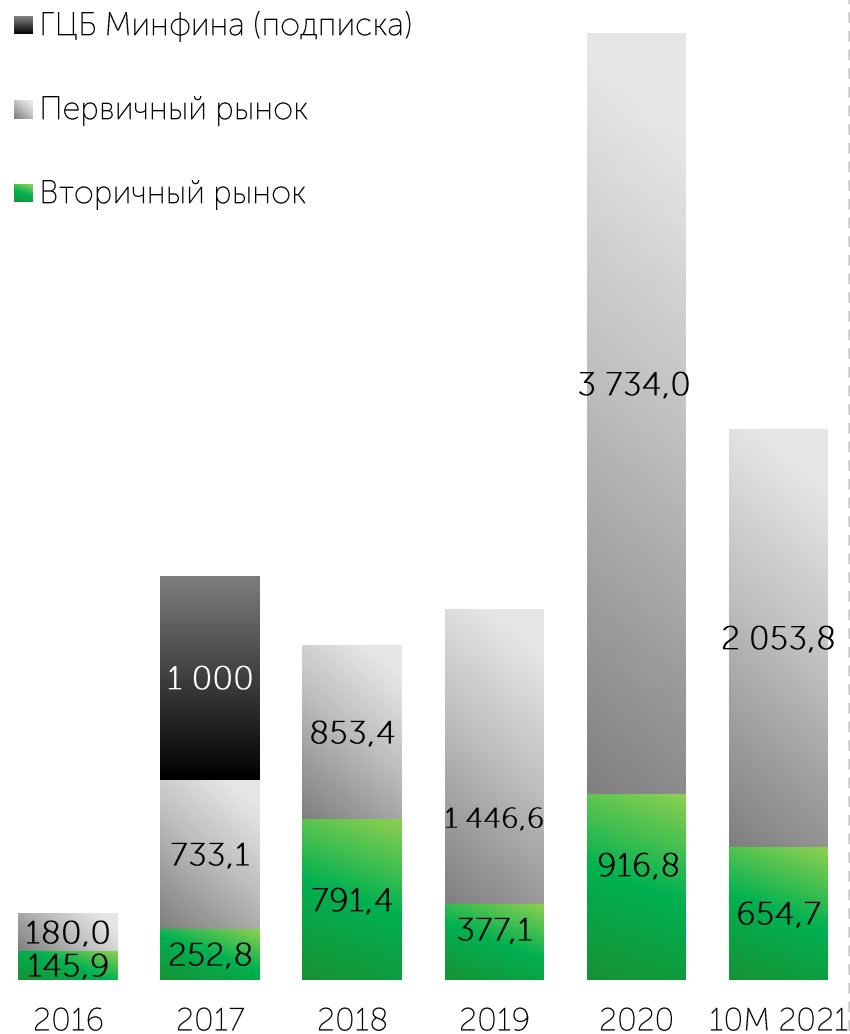


Динамика активных счетов на рынке корпоративных облигаций

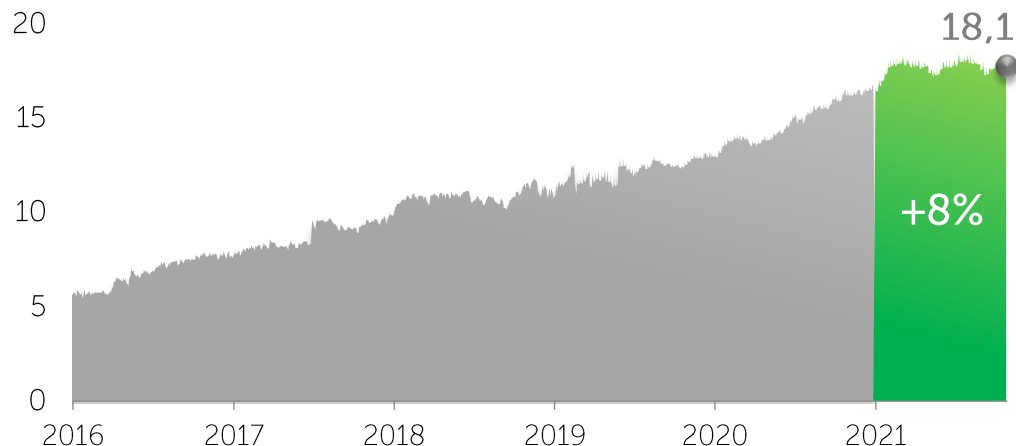


\* от общего брутто-оборота торгов корпоративными облигациями на вторичном рынке

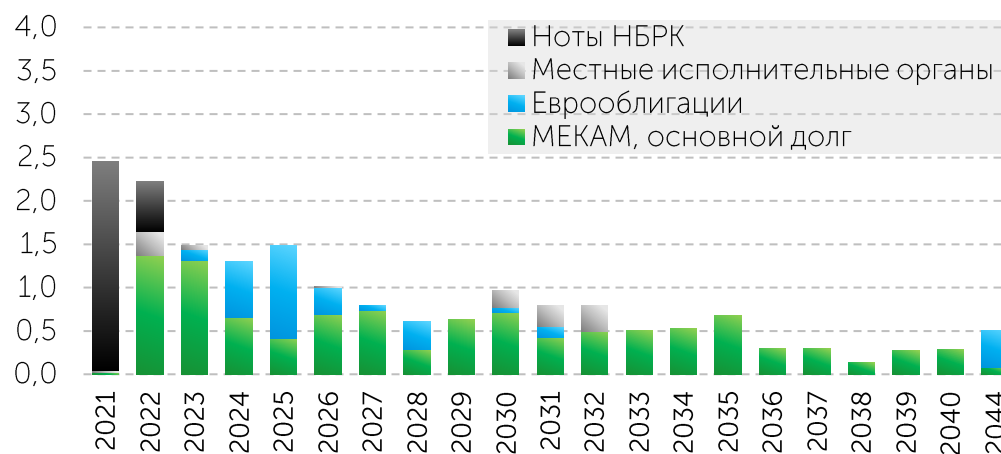
## Динамика объема торгов, млрд KZT



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

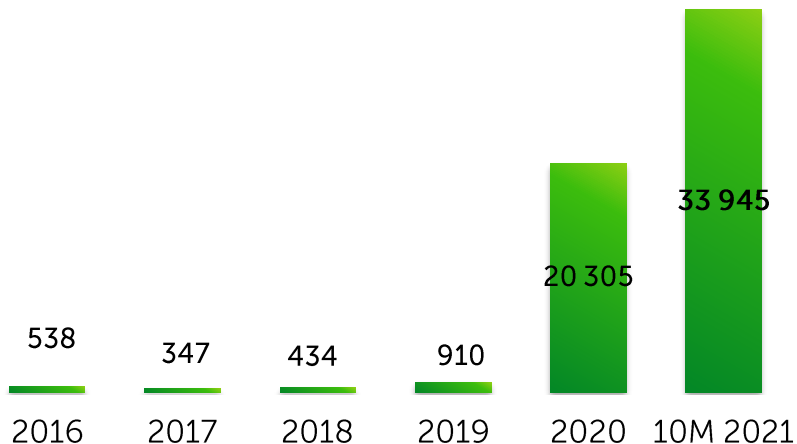


## Динамика выплат по госдолгу, трлн KZT

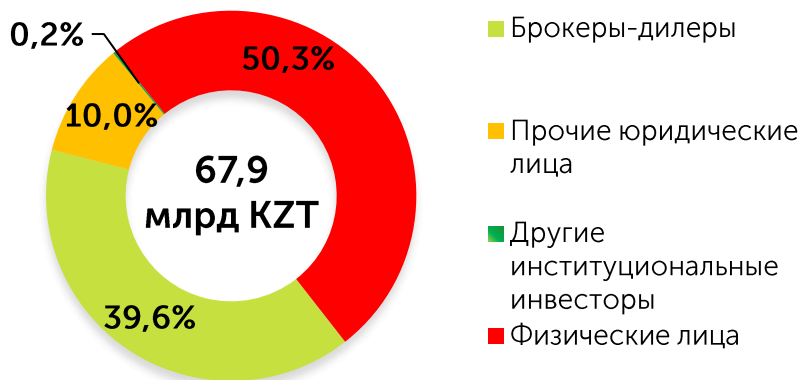


Источник: KASE

Объем сделок, млн KZT



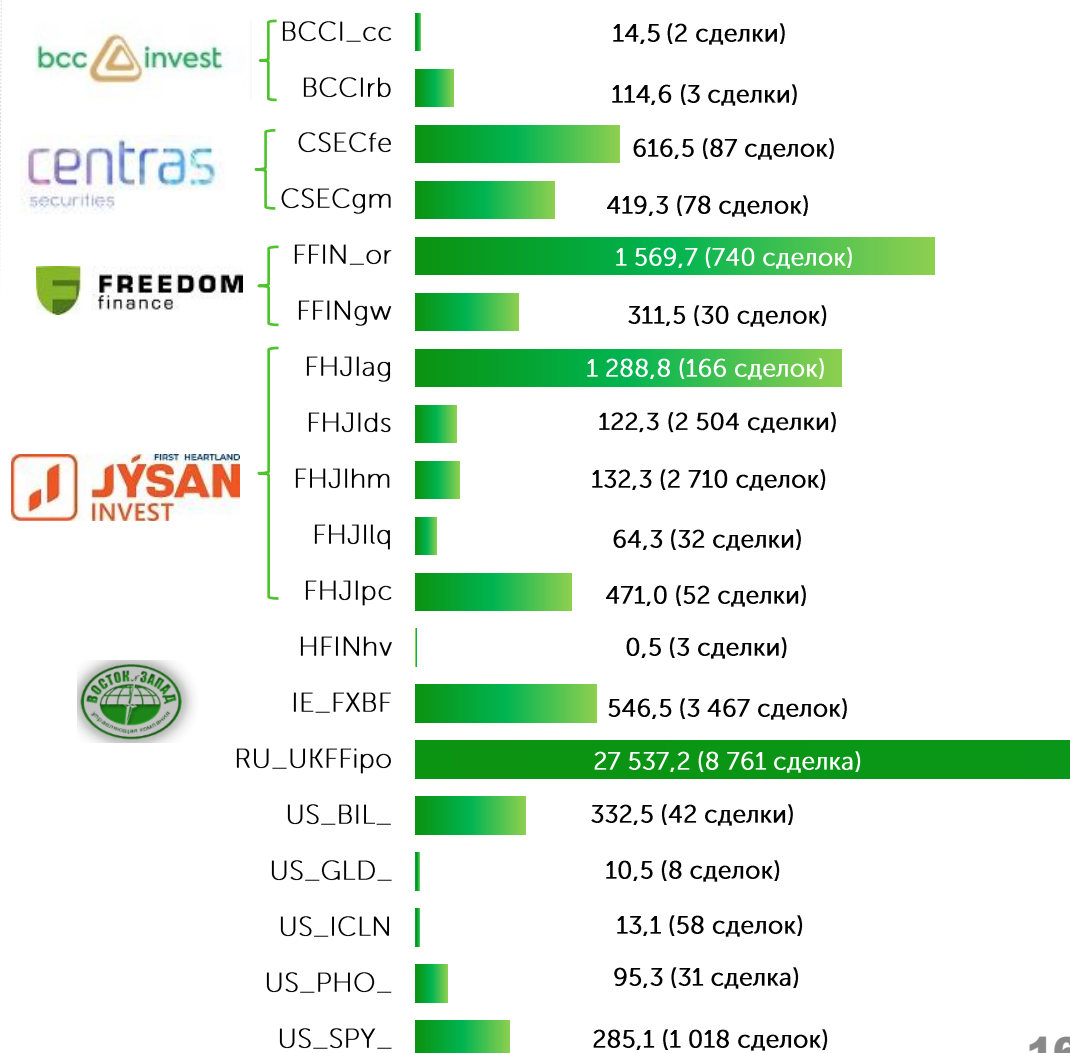
Доли основных категорий инвесторов за 10M 2021 года\*



\* от общего брутто-оборота торгов ценными бумагами инвестиционных фондов

Источник: KASE

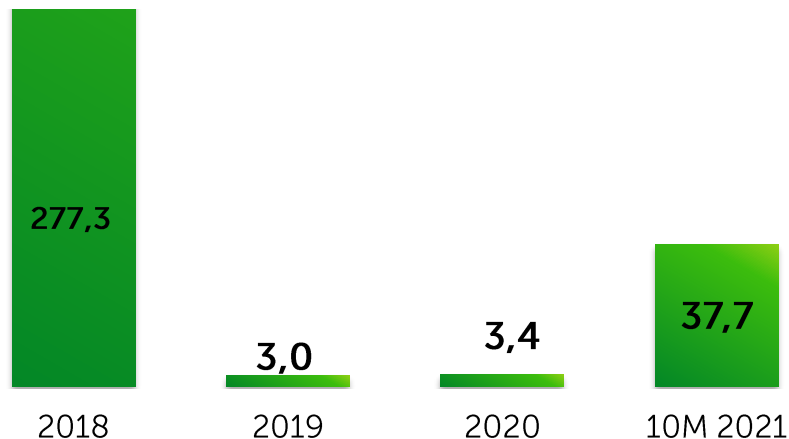
Объем торгов в разбивке по инструментам за 10M 2021 года, млн KZT



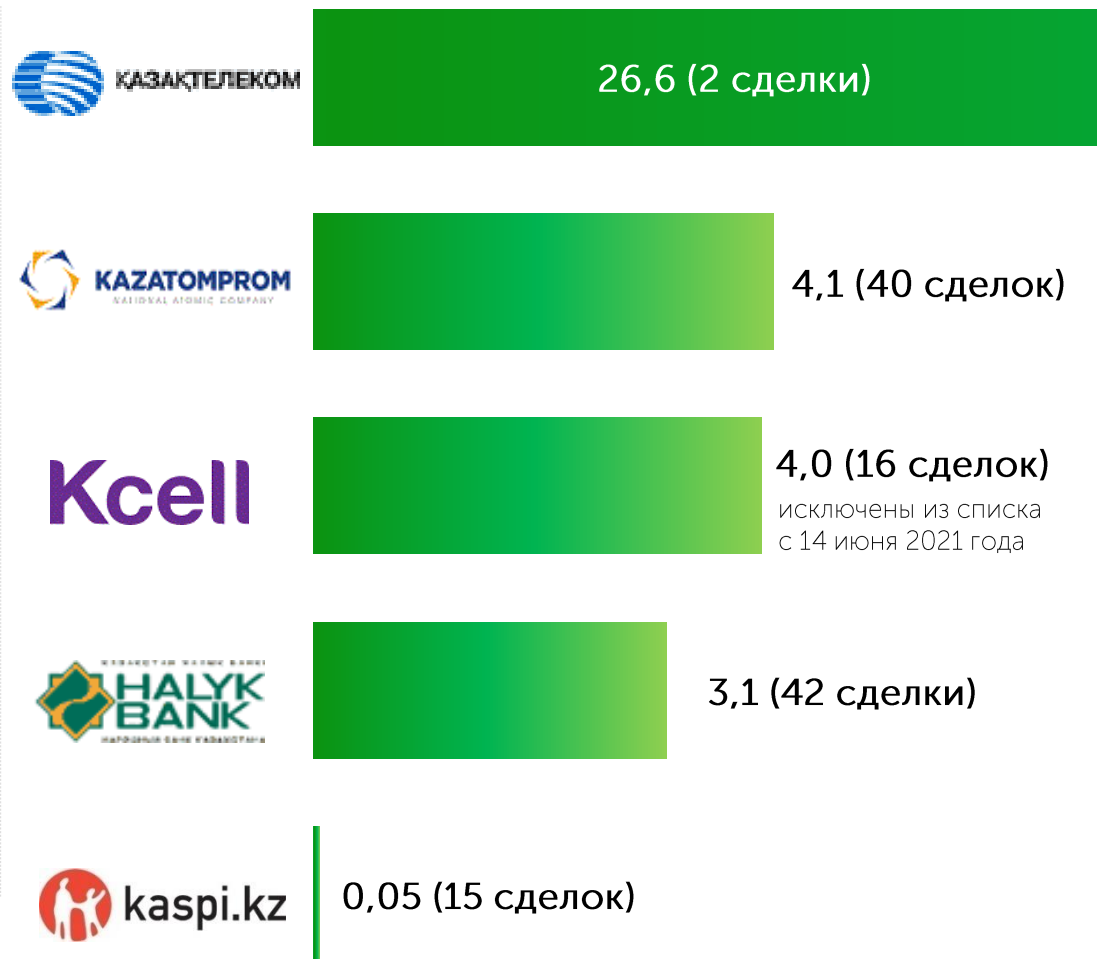


# Производные ценные бумаги

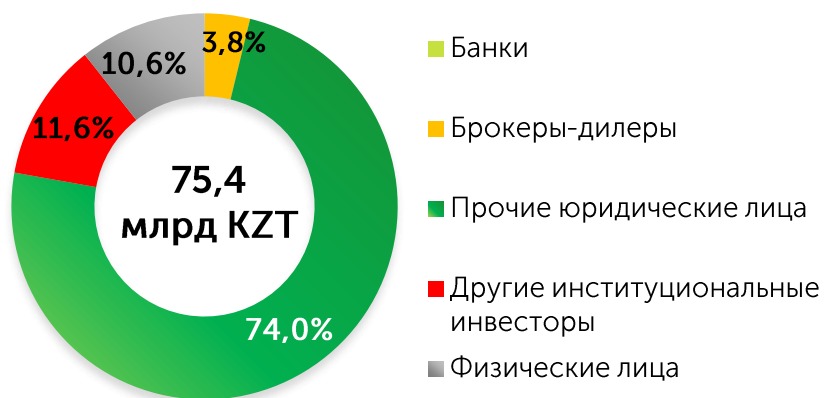
Объем сделок, млрд KZT



Объем торгов в разбивке по инструментам за 10М 2021 года, млрд KZT

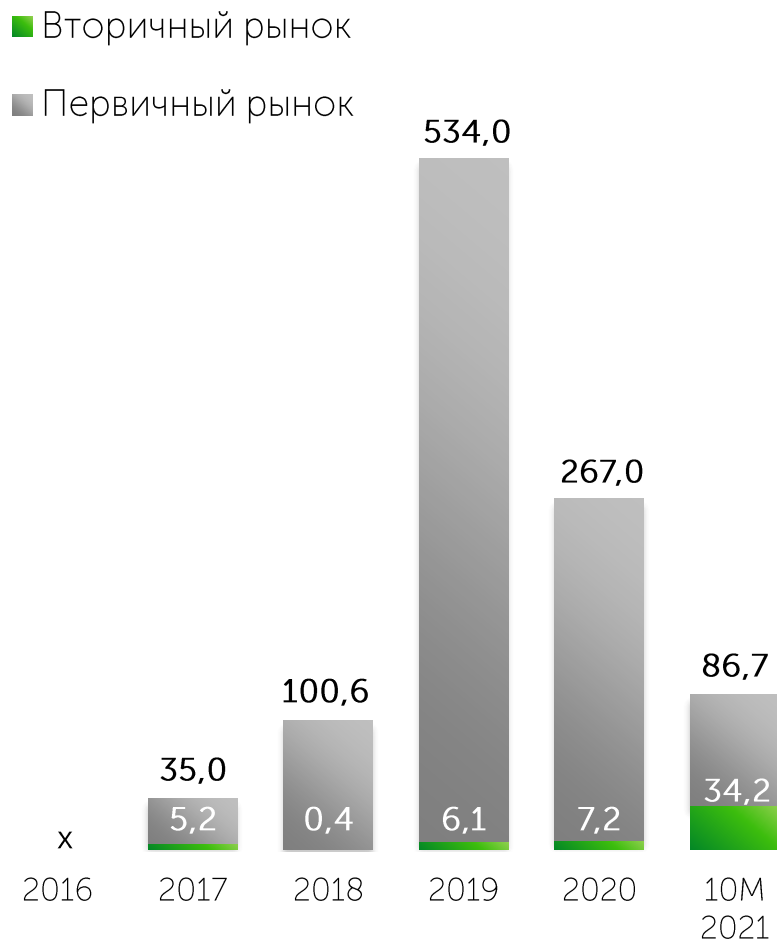


Доли основных категорий инвесторов за 10М 2021 года\*



\* от общего брутто-оборота торгов производными ценными бумагами

## Объемы торгов, млрд KZT



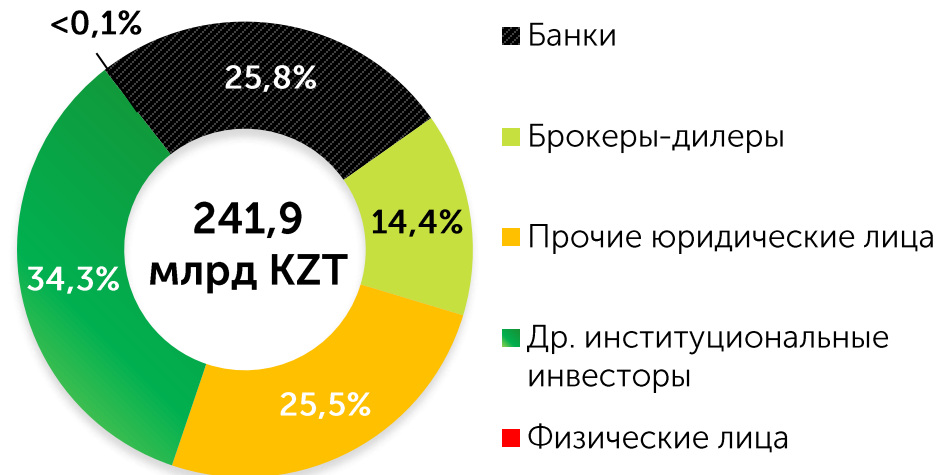
Источник: KASE

На 01 ноября 2021 года в официальном списке KASE находятся **45 выпусков облигаций**

**4 организаций:**

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

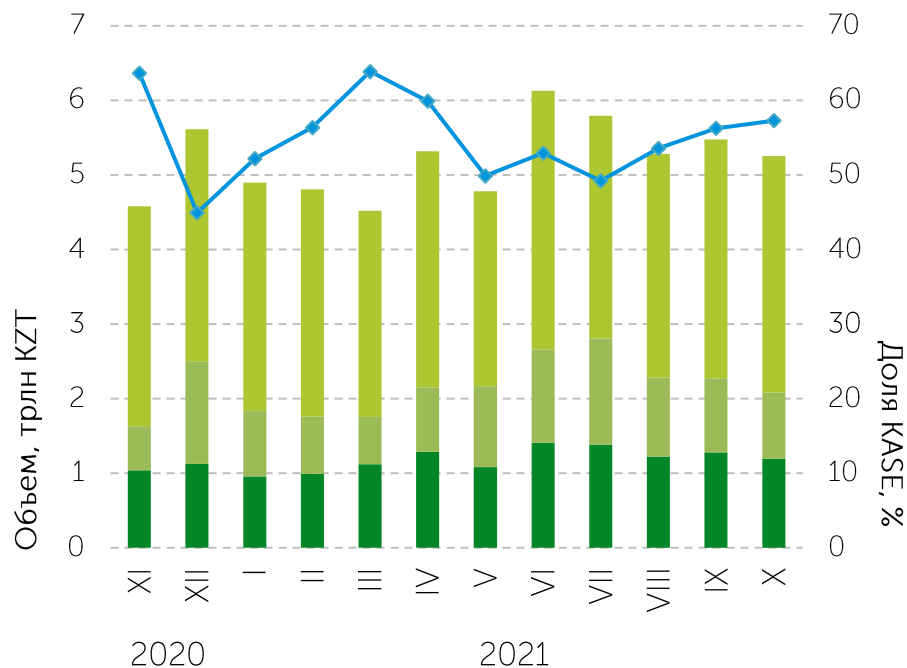
## Доли основных категорий инвесторов за 10М 2021 года\*



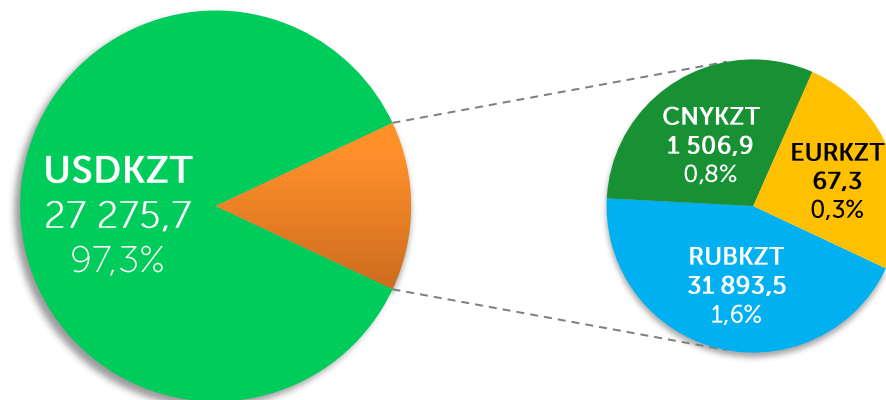
\* от общего брутто-оборота торгов облигациями МФО, из расчета исключена позиция инициатора специализированных торгов

## 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

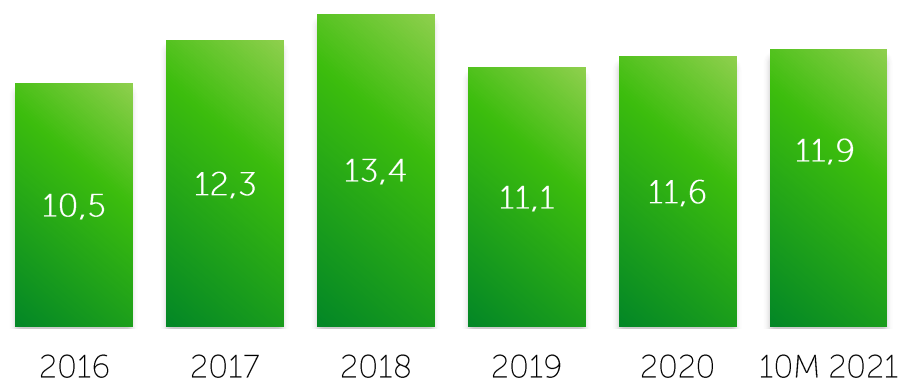


## Структура биржевого рынка за 10М 2021 года в объеме торгов. Объем в млн единиц валюты



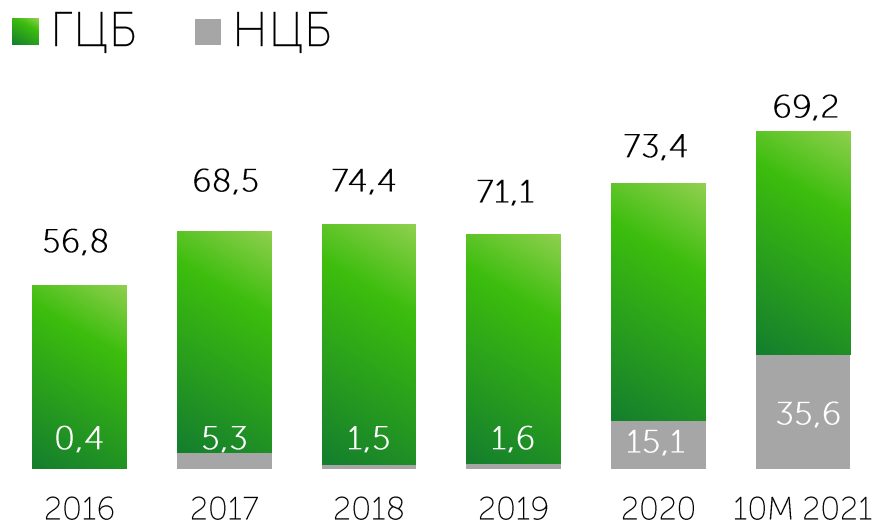
Примечание: доли рассчитаны от объема торгов в KZT

## Объем торгов на спот-рынке, трлн KZT

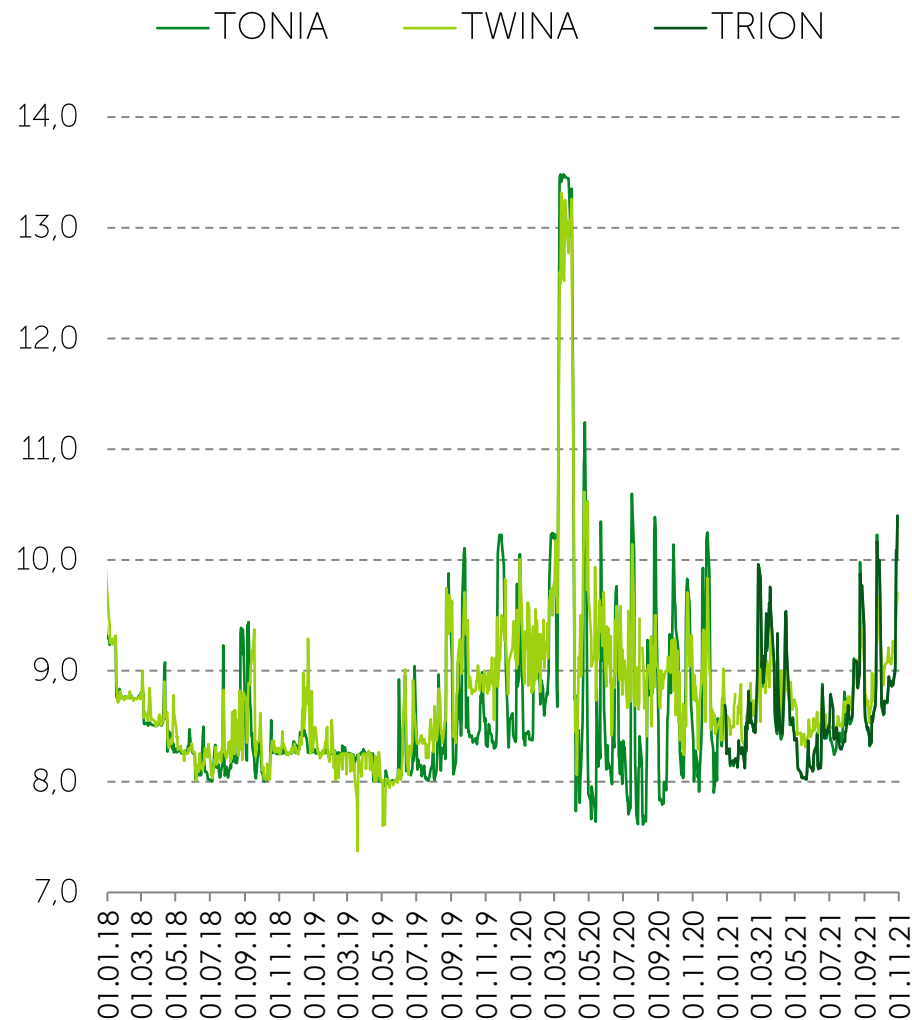


# Рынок операций репо

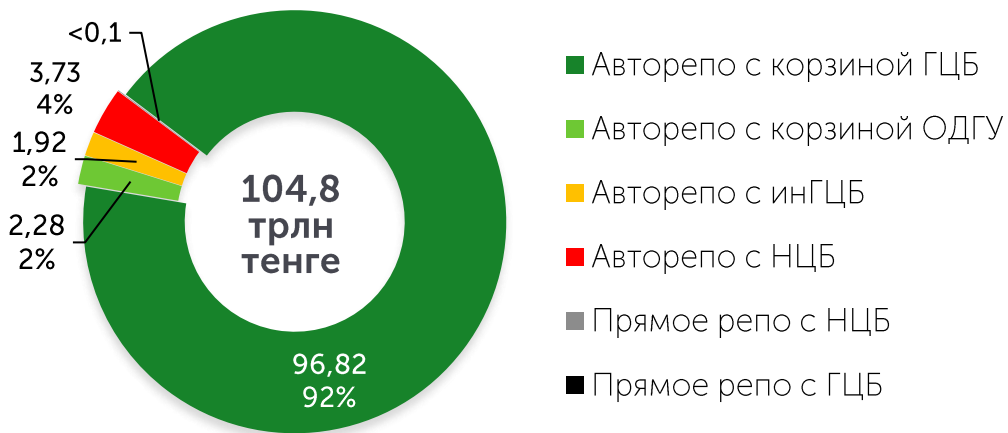
Объем торгов, трлн KZT



Индикаторы репо, % годовых

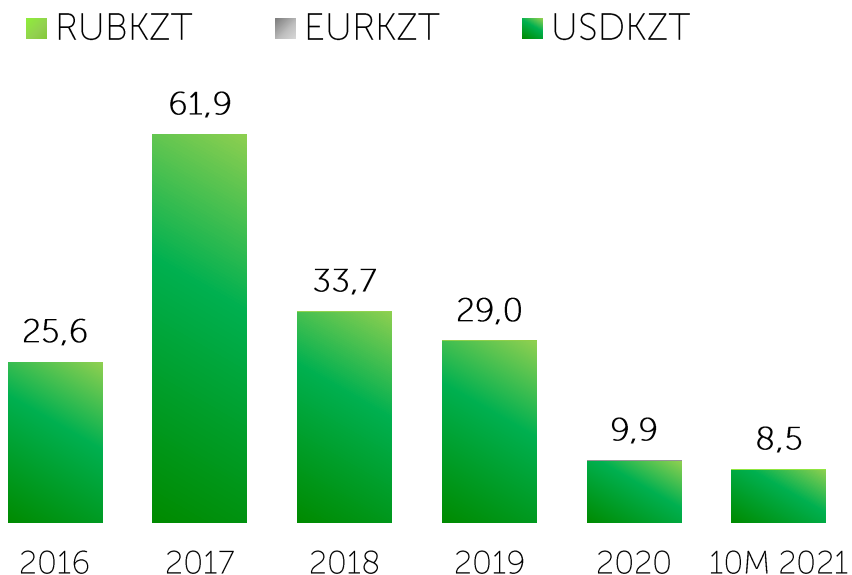


Инструменты рынка репо, трлн KZT

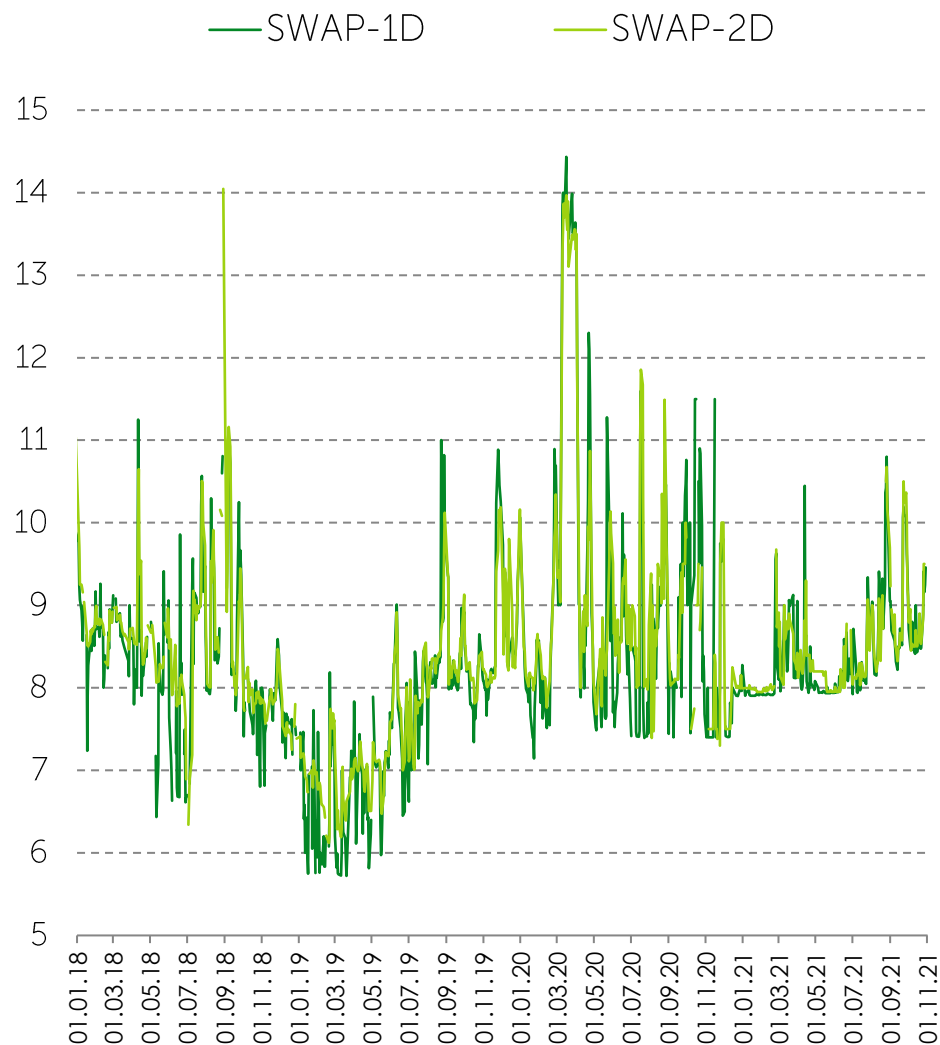


# Рынок операций валютного свопа

### Объем торгов, трлн KZT



### Индикаторы своп-рынка, % годовых



### Инструменты рынка операций валютного свопа (объем за 10М 2021/ доля):

- **USDKZT\_0\_001** (4 696,4 млрд KZT / 55,44 %)
- USDKZT\_0\_002 (3 254,2 млрд KZT / 38,41 %)
- USDKZT\_0\_01W (12,6 млрд KZT / 0,15 %)
- USDKZT\_0\_01M (508,6 млрд KZT / 6,00 %)
- RUBKZT\_0\_001 (0,03 млрд KZT / <0,01 %)

# 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](http://www.kase.kz)