



Қазақстан қор биржасы
Казахстанская фондовая биржа
Kazakhstan Stock Exchange

Типовая презентация

на 01 мая 2020 года



АО "Казахстанская фондовая биржа"

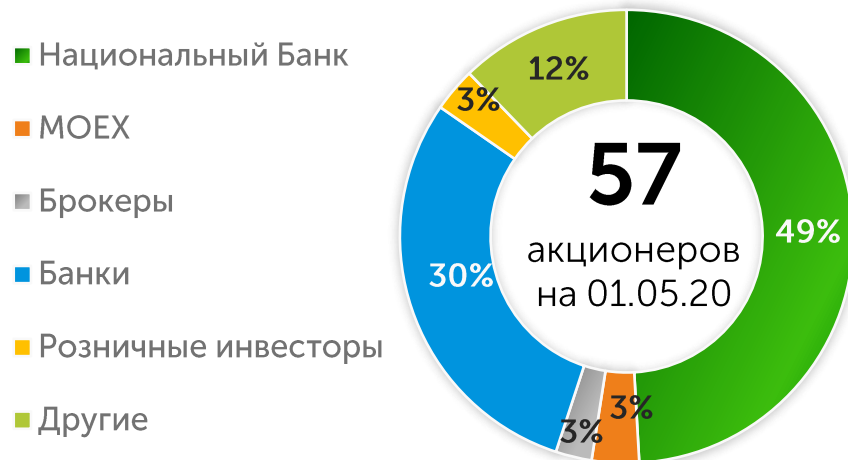
49,1% - НБРК

3,4% - МОЕХ

44,4% - 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



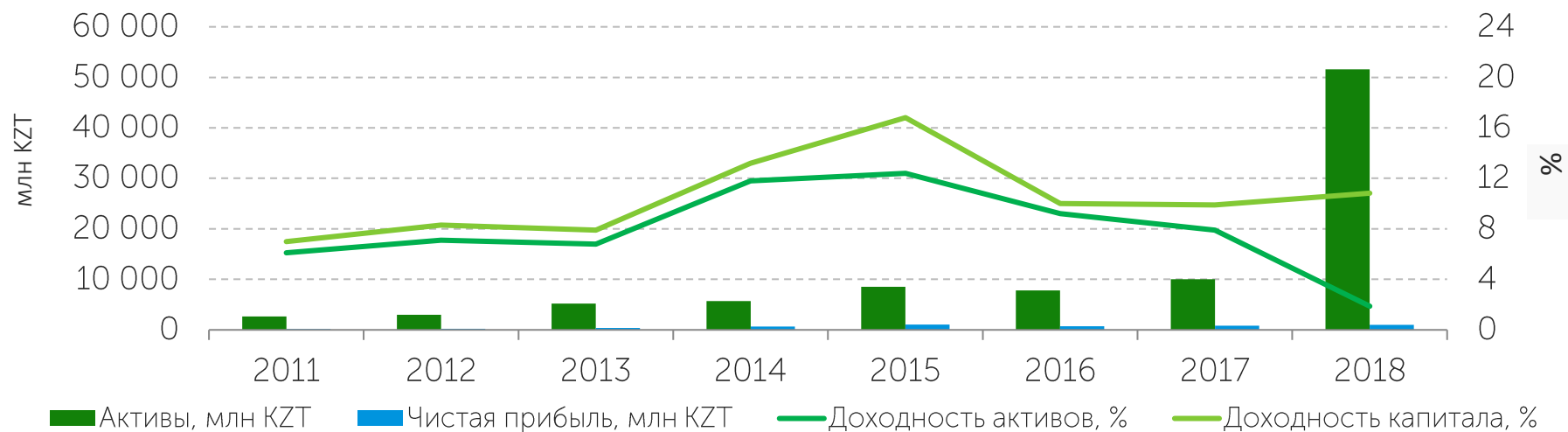
Акции и капитал KASE

На 01 апреля 2020 года:

собственный капитал	12 055,7 млн KZT
оплаченный уставный капитал	2 661,8 млн KZT
количество объявленных акций	5 000 000
количество размещенных акций	974 373
количество выкупленных акций	13 329
балансовая стоимость акции	12 544,4 KZT

Показатели доходности KASE

	Активы, млн KZT	Чистая прибыль, млн KZT	Доходность активов, %	Доходность капитала, %
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



43

Фондовая

32

Валютная

23

Деривативы

51

всего участников рынка

25

банков второго уровня (из 27)
резиденты РК

20

брокерских компаний (из 20)
резиденты РК

49

локальных участников

2

иностранного участника
(ООО "УНИВЕР Капитал", ООО ИК "Фридом Финанс")

2

МФО (Межгосударственный банк,
Евразийский банк развития)

12

участников, предоставляющих
услуги прямого доступа (DMA)

Новые члены KASE:

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

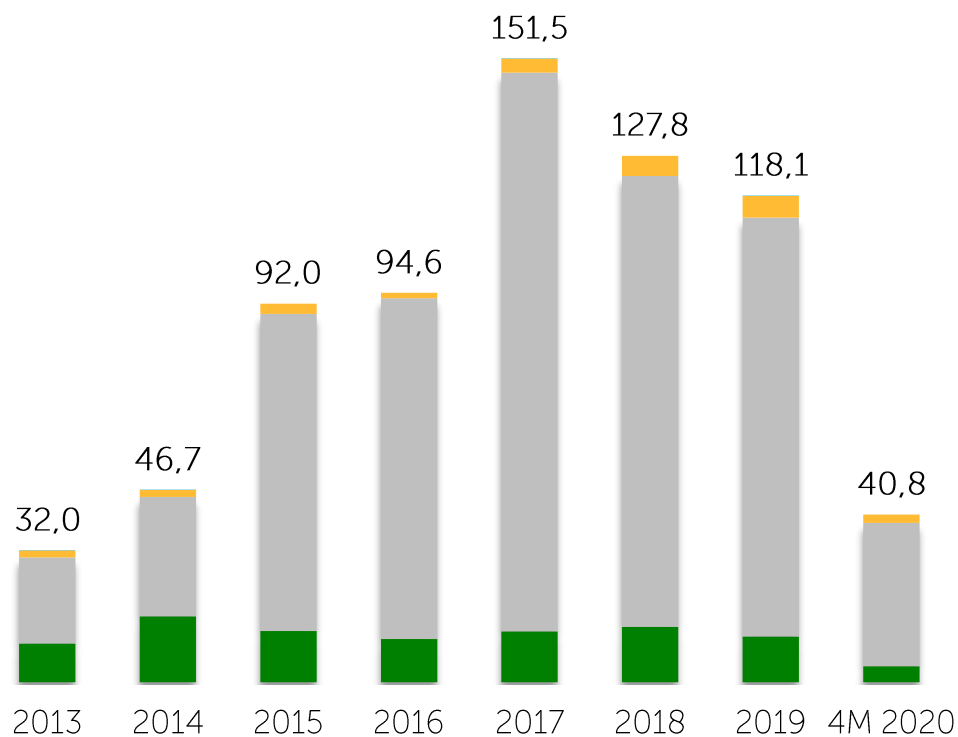
Показатели биржевого рынка за четыре месяца 2020 года

Сектор биржевого рынка	Объем, млрд KZT	Объем млн USD	Среднедневное количество сделок	Среднедневной объем сделок, млрд KZT	Средний объем одной сделки, млрд KZT
Рынок ценных бумаг	2 059,4	4 899,8	587	25,7	<0,1
Акции	40,5	101,6	571	0,5	<0,1
Корпоративные долговые ЦБ	549,6	1 296,8	8	6,9	0,9
ГЦБ	1 454,4	3 466,2	6	18,2	3,2
Облигации МФО	14,1	33,3	<1	0,2	0,7
ЦБ инвестиционных фондов	0,8	2,0	3	<0,1	<0,1
Производные ценные бумаги	–	–	–	–	–
Рынок иностранных валют	3 914,3	9 764,6	343	48,9	0,1
Рынок денег	34 788,5	87 087,1	488	434,9	0,9
Операций репо	29 855,0	74 606,4	465	373,2	0,8
Операций валютного свопа	4 933,5	12 480,7	23	61,7	2,7
Деривативы	–	–	–	–	–
Итого	40 762,1	101 751,6	1 418	509,5	0,4

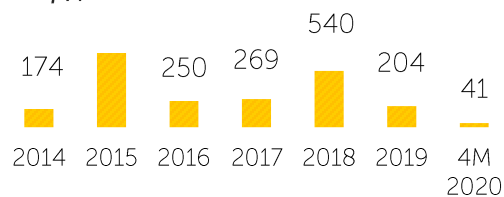
Объем и структура рынка



Динамика объема торгов по секторам, трлн KZT



млрд KZT



Рынок акций

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

млрд KZT



Рынок корпоративных облигаций

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

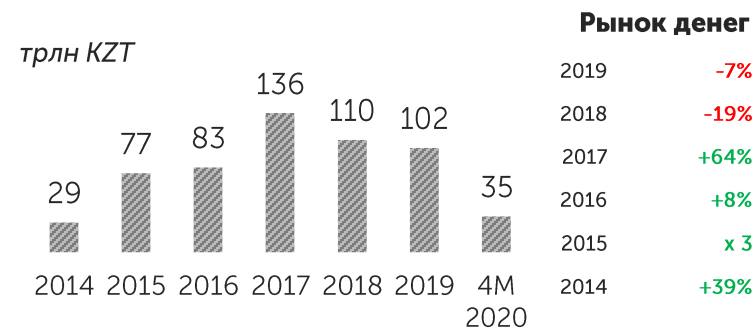
трлн KZT



Рынок иностранных валют

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

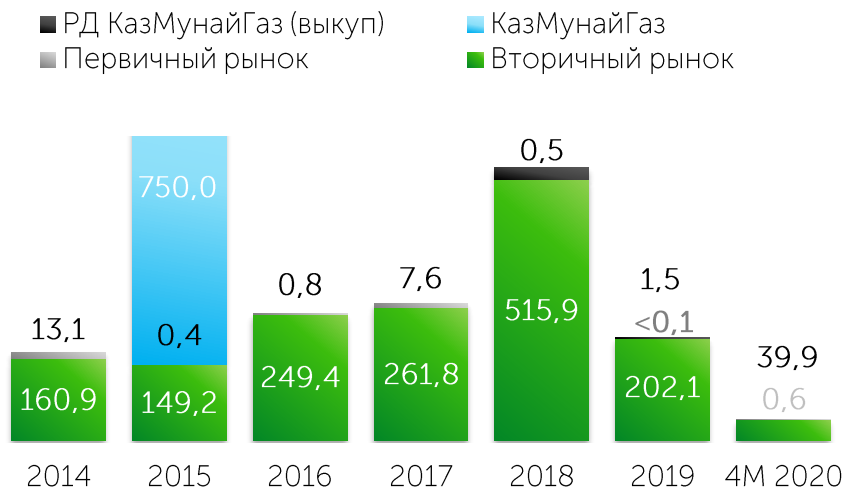
трлн KZT



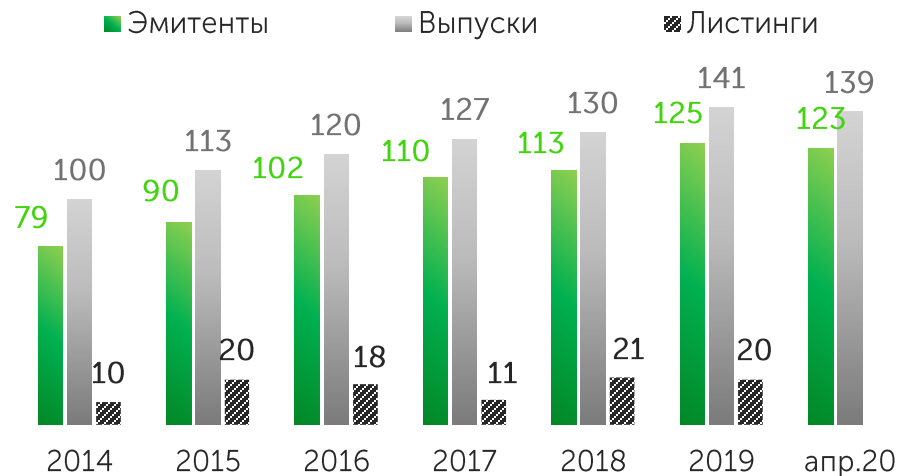
Рынок денег

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

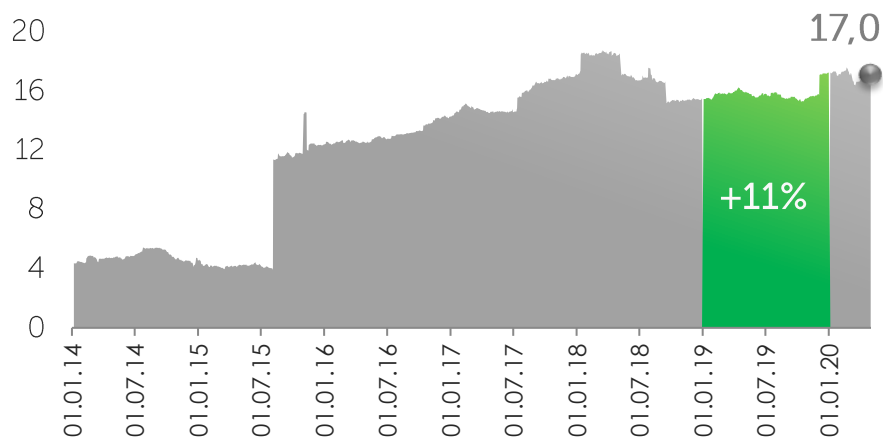
Объем сделок, млрд. KZT



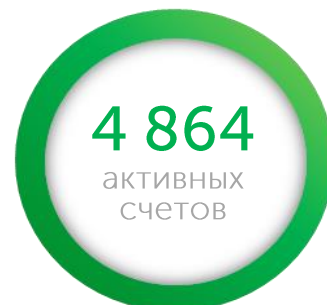
Новые листинги



Капитализация рынка акций, трлн KZT

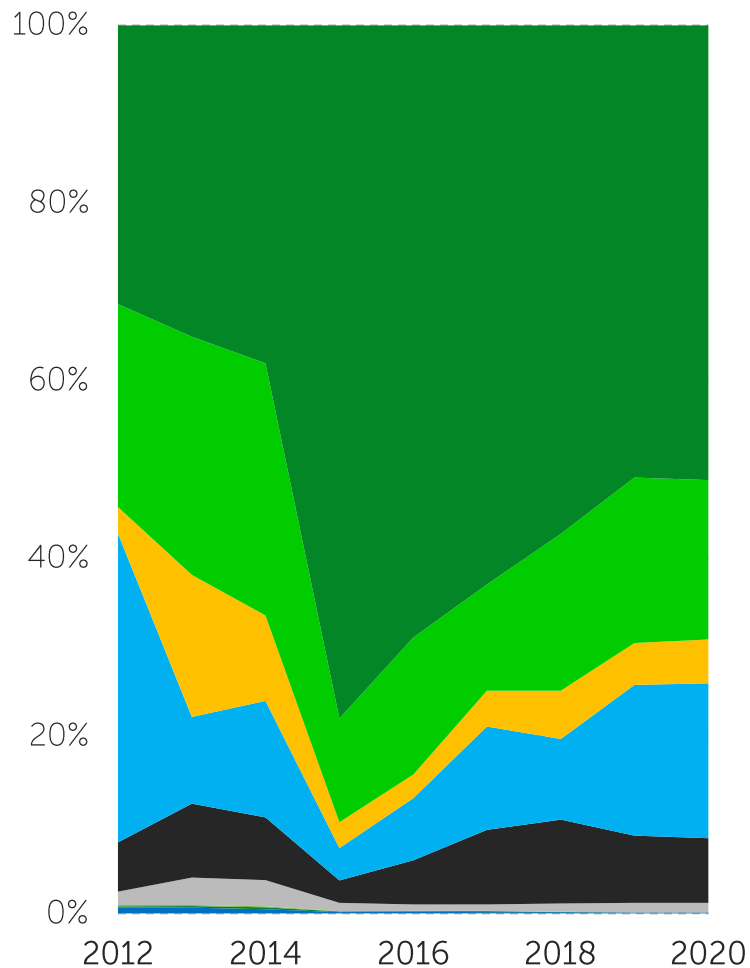


Основные показатели за 4М 2020 года



Отраслевая структура списков акций

Доля от капитализации, %



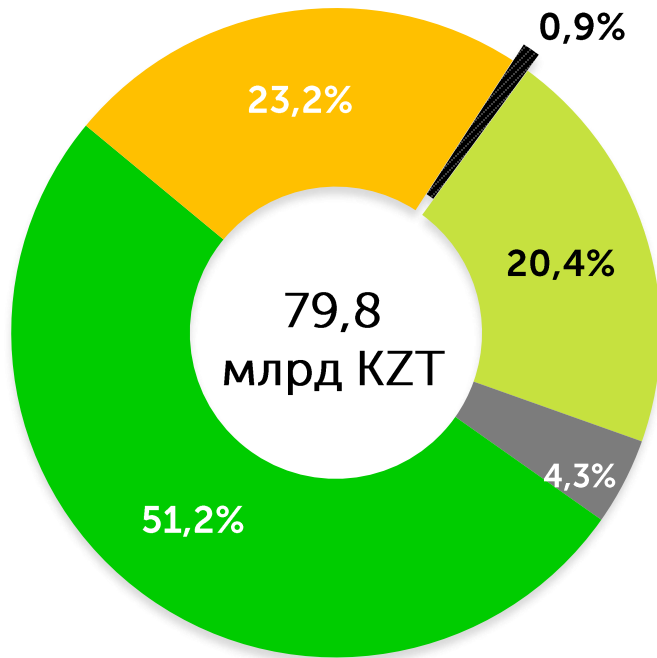
■ Энергетика	52,2
■ Финансы	18,4
■ Предоставление телекоммуникационных услуг	5,0
■ Материалы	15,8
■ Промышленность	7,5
■ Потребительские товары массового спроса	1,1
■ Предоставление коммунальных услуг	<0,1
■ Информационные технологии	0
■ Здравоохранение	0
■ Неосновные потребительские товары	0,1

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

Источник: KASE

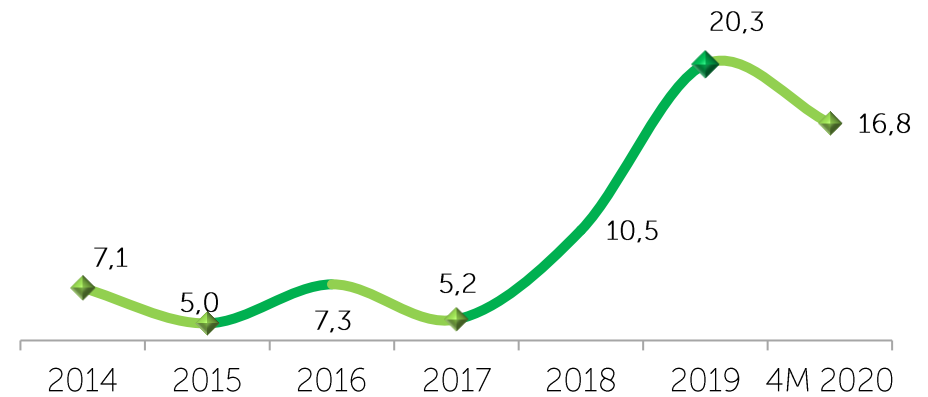
Рынок акций: инвесторская база

Доли основных категорий инвесторов на вторичном рынке за 4М 2020 год*

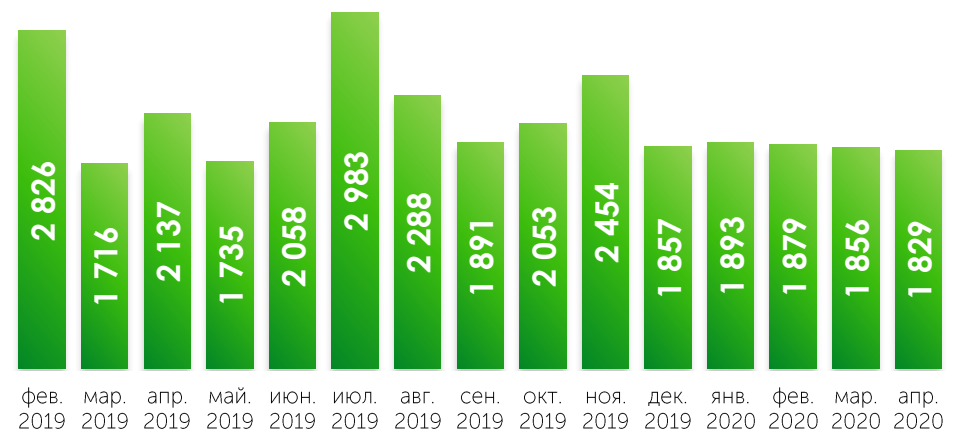


- Банки
- Брокеры-дилеры
- Др. институциональные инвесторы
- Физические лица
- Прочие юридические лица

Доля нерезидентов в брутто-обороте, %



Динамика активных счетов розничных инвесторов на рынке акций

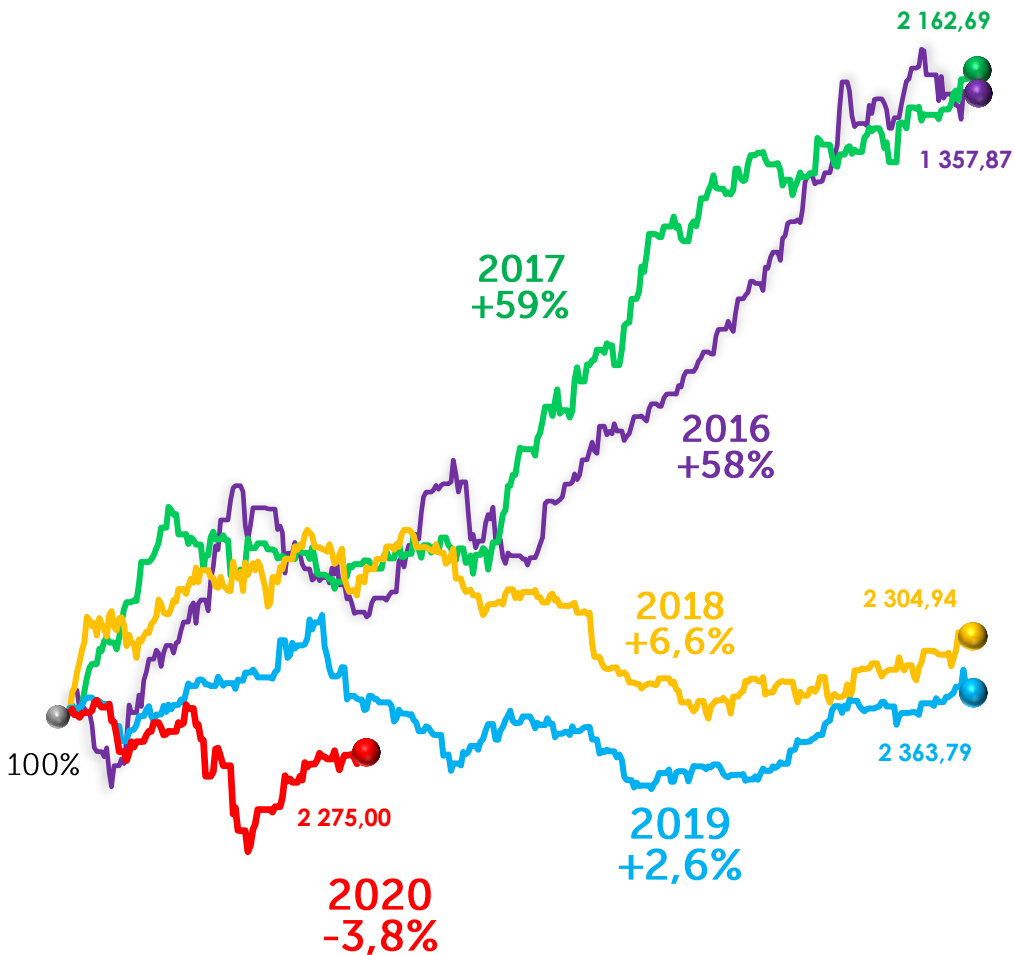


* от общего брутто-оборота торгов акциями на вторичном рынке

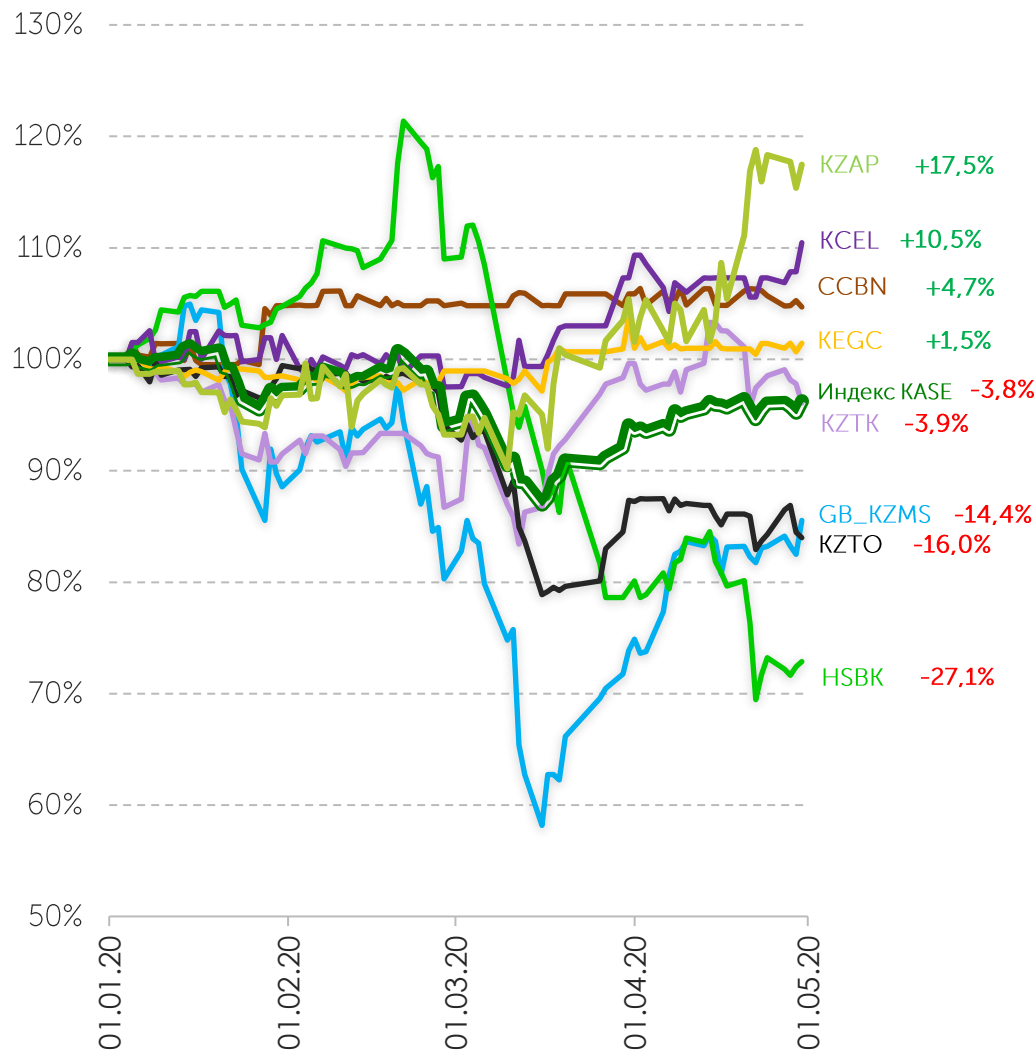
Источник: KASE

Динамика Индекса KASE

Индекс KASE в 2016-4М 2019



Динамика составляющих Индекса KASE

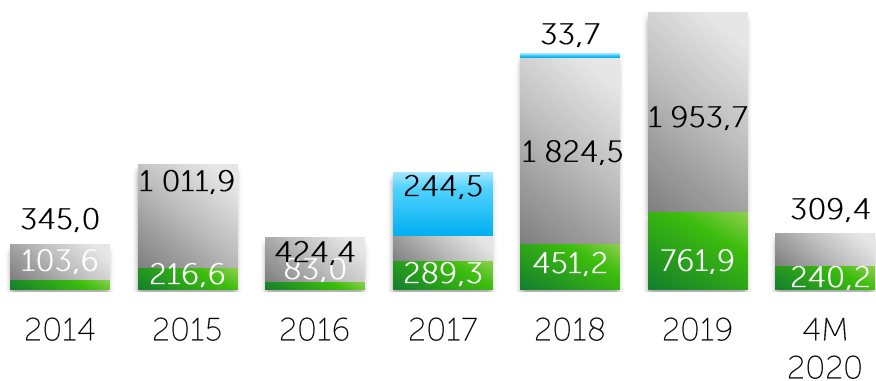


Источник: KASE, Bloomberg

Рынок корпоративных облигаций

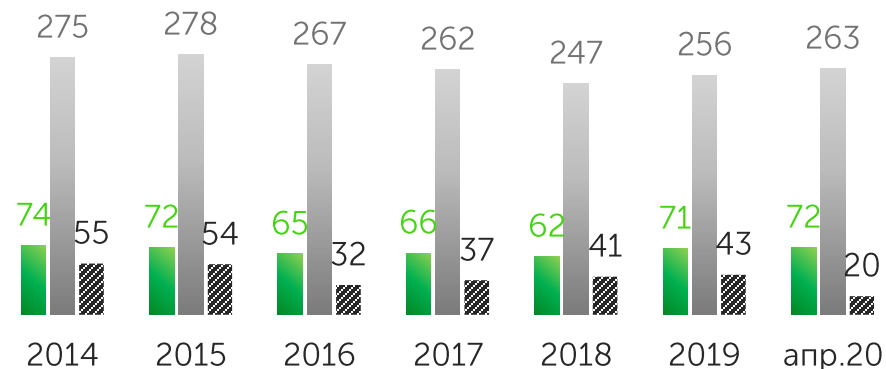
Объем сделок, млрд KZT

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

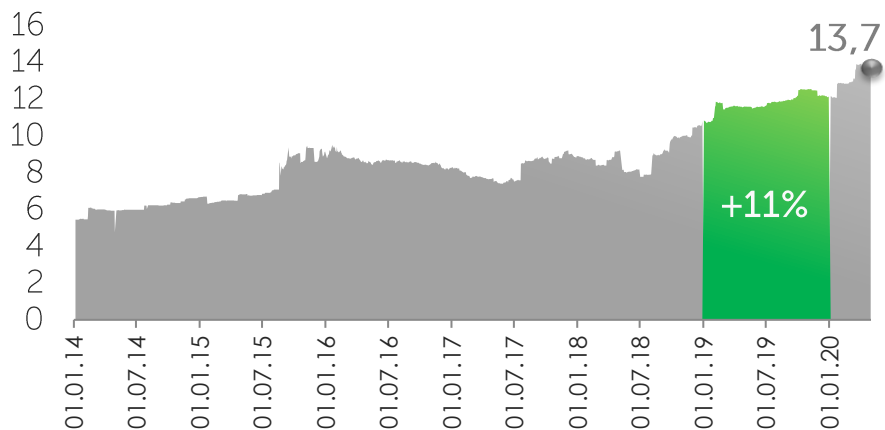


Новые листинги

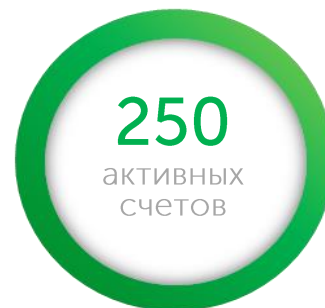
- Эмитенты
- Выпуски
- Листинги



Объем корпоративного долга в обращении, трлн KZT



Основные показатели за 4М 2020 года



-36,1%
к 4М 2019 года

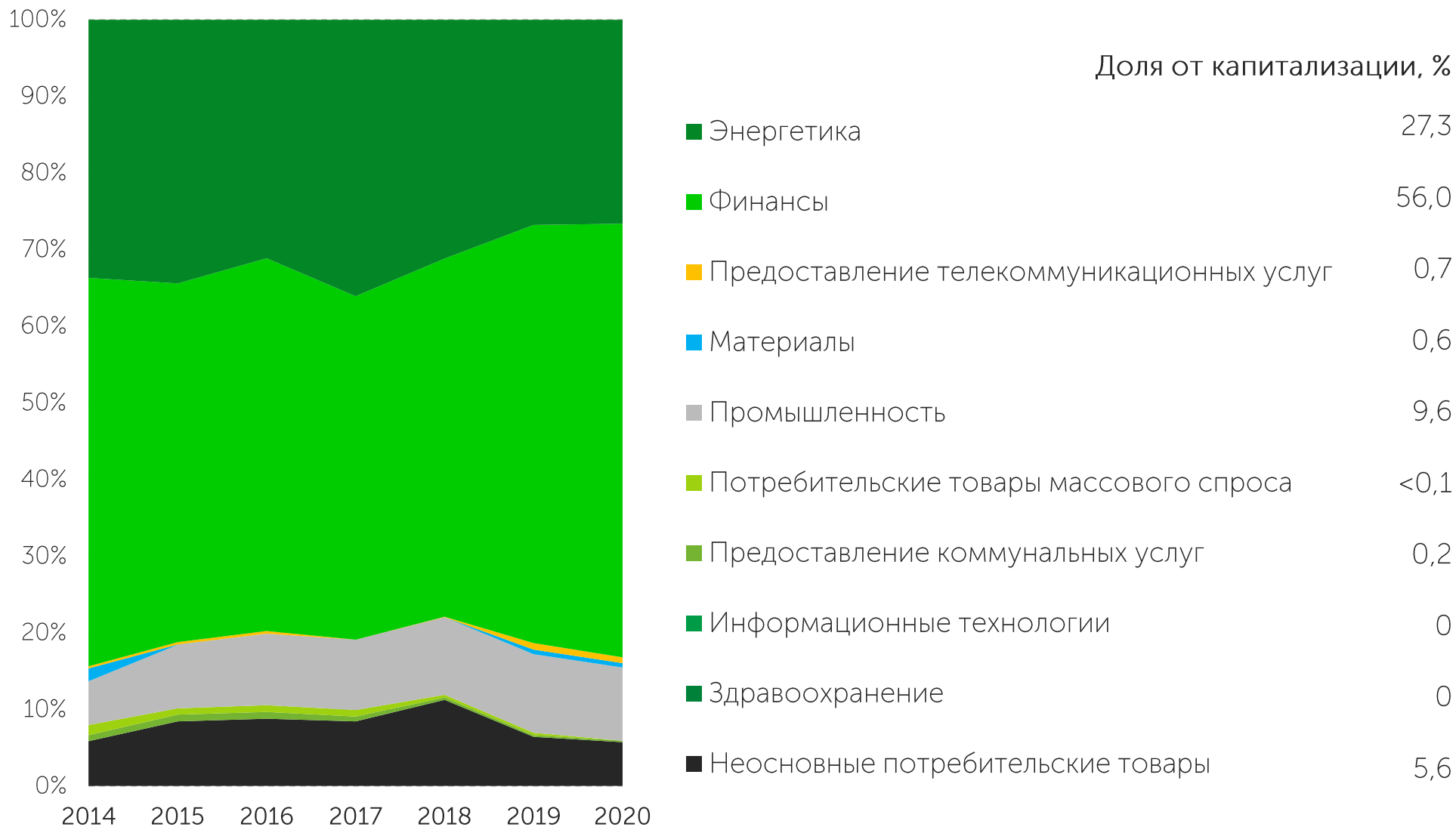


-58,4%
к 4М 2019 года



-34,3%
к 4М 2019 года

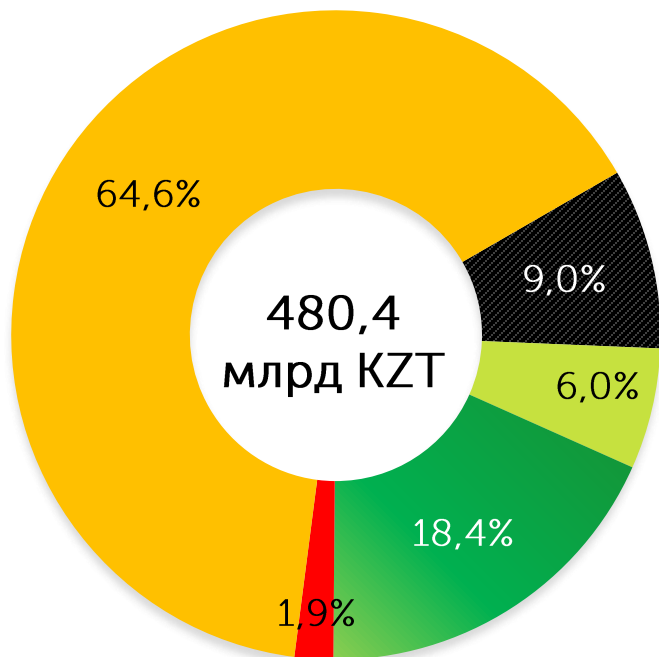
Отраслевая структура списков облигаций KASE



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

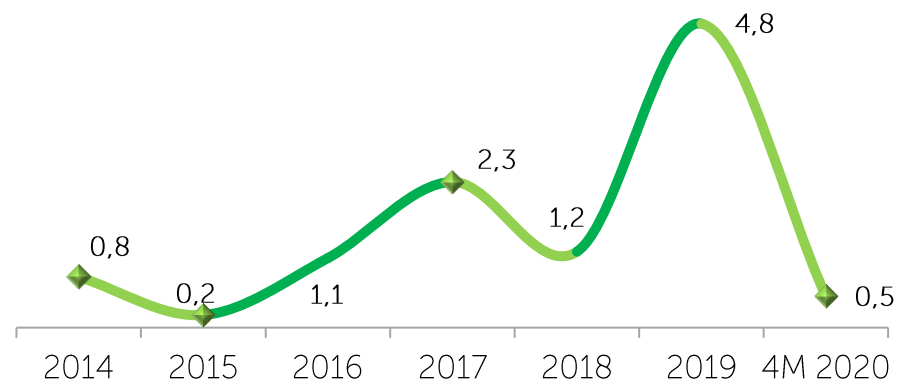
Инвесторская база рынка корпоративных облигаций KASE

Доли основных категорий инвесторов на вторичном рынке за 4М 2020 год*

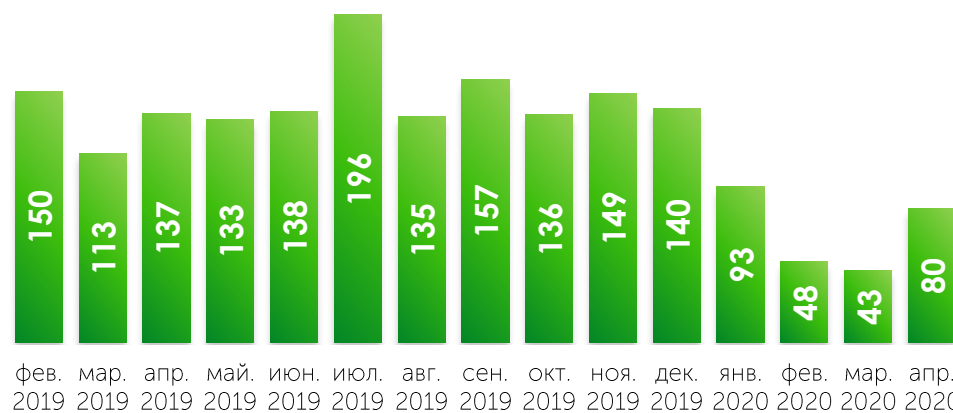


- Банки
- Брокеры-дилеры
- Др. институциональные инвесторы
- Физические лица
- Прочие юридические лица

Доля нерезидентов в брутто-обороте, %

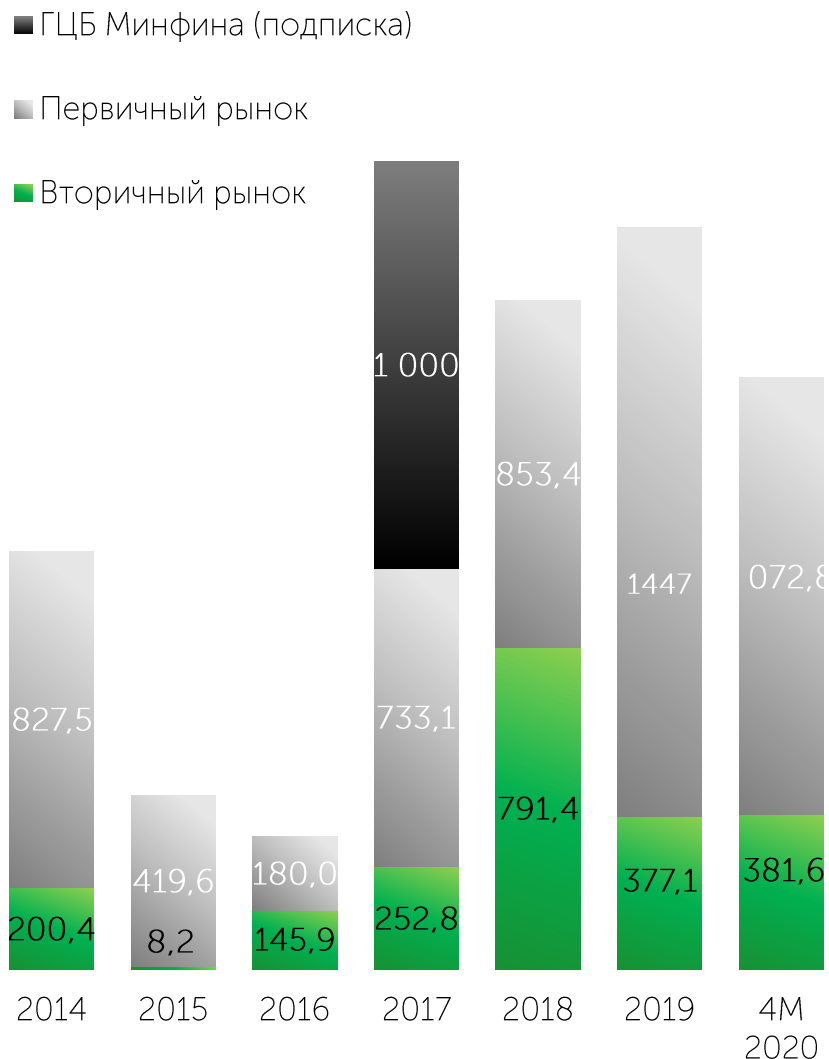


Динамика активных счетов на рынке корпоративных облигаций

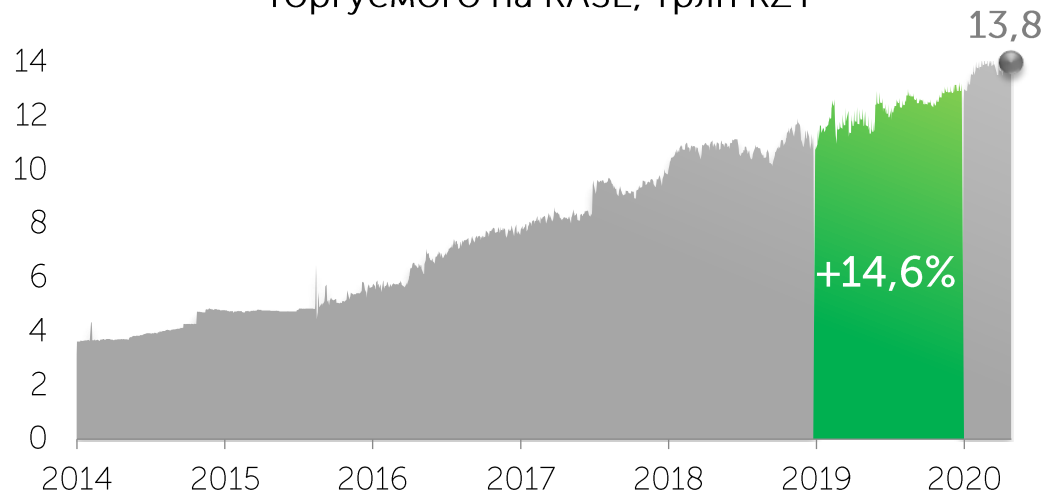


* от общего брутто-оборота торгов корпоративными облигациями на вторичном рынке

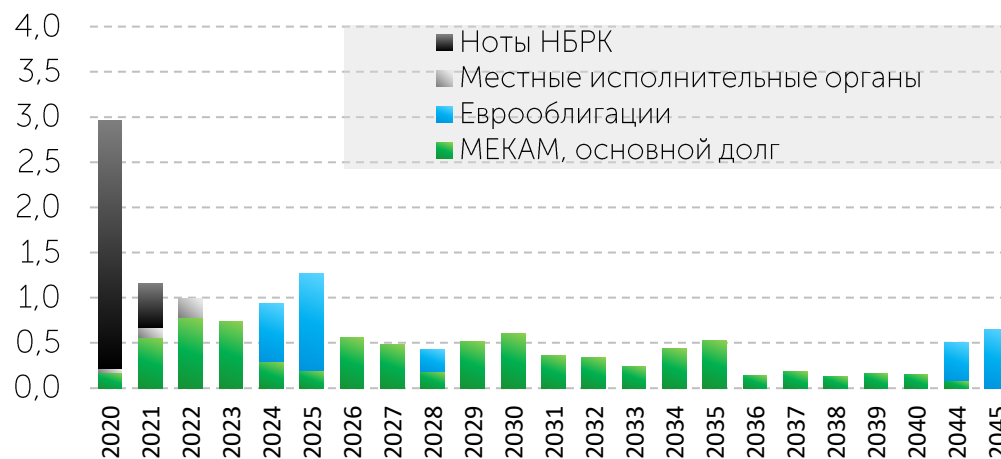
Динамика объема торгов, млрд KZT



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

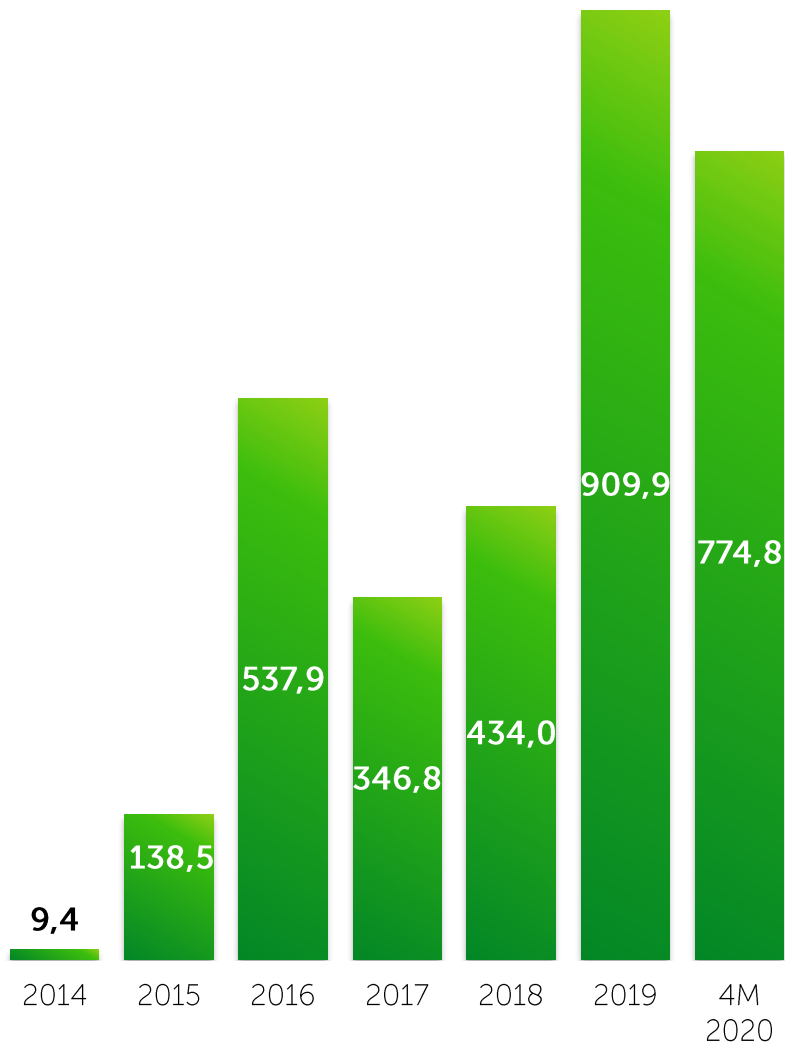


Динамика выплат по госдолгу, трлн KZT



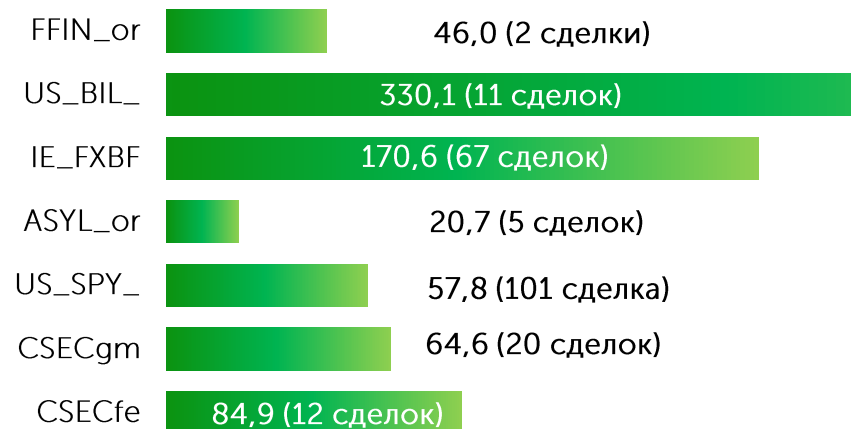
Источник: KASE

Объем сделок, млн KZT

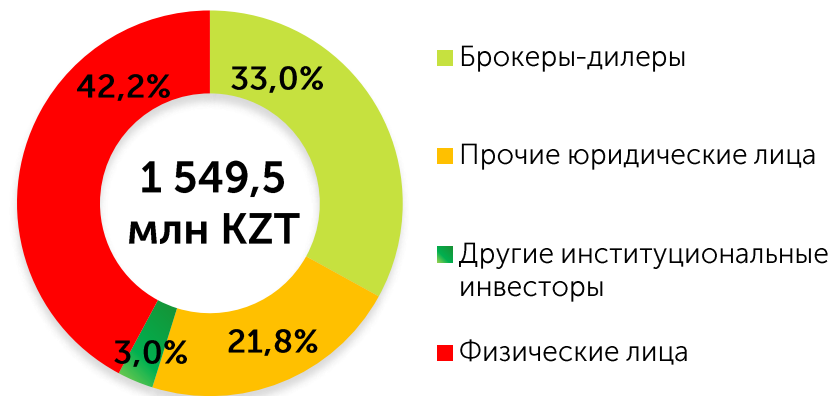


Источник: KASE

Объем торгов в разбивке по инструментам за 4М 2020 года, млн KZT

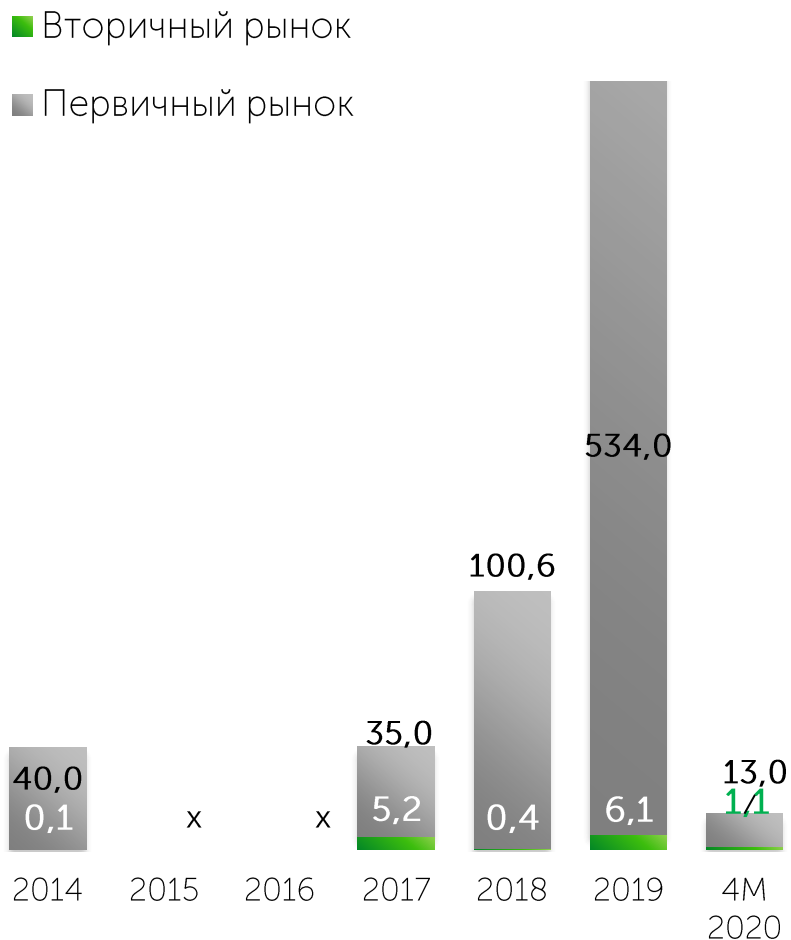


Доли основных категорий инвесторов за 4М 2020 год*



* от общего брутто-оборота торгов ценными бумагами инвестиционных фондов

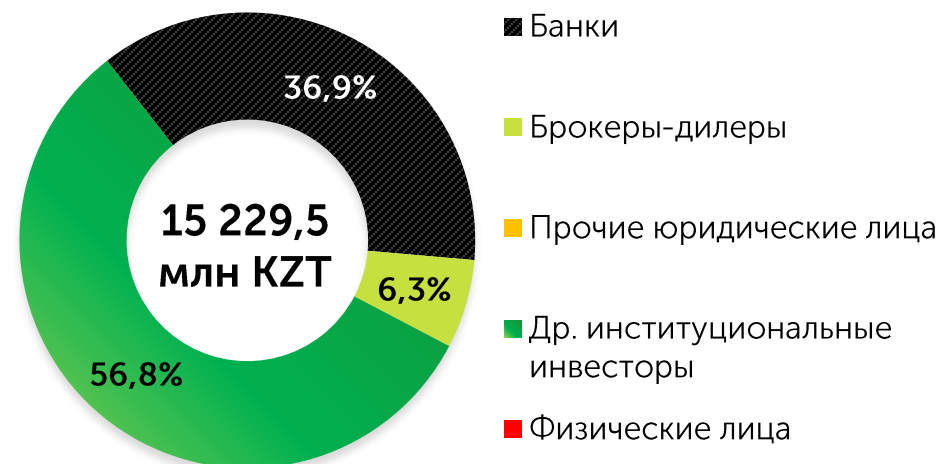
Объемы торгов, млрд KZT



На 01 мая 2020 года в официальном списке KASE находятся **31 выпуск облигаций 5 организаций:**

- 12 выпусков Евразийского банка развития
- 10 выпусков Европейского банка реконструкции и развития
- 5 выпуска Международной финансовой корпорации
- 1 выпуск Европейского инвестиционного банка
- 3 выпуска Азиатского банка развития

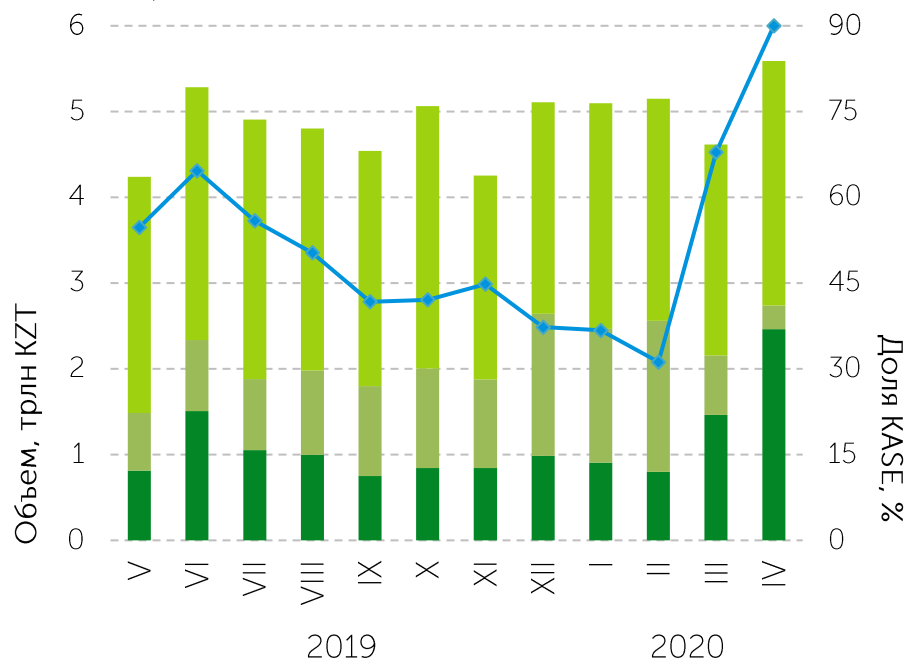
Доли основных категорий инвесторов за 4М 2020 года*



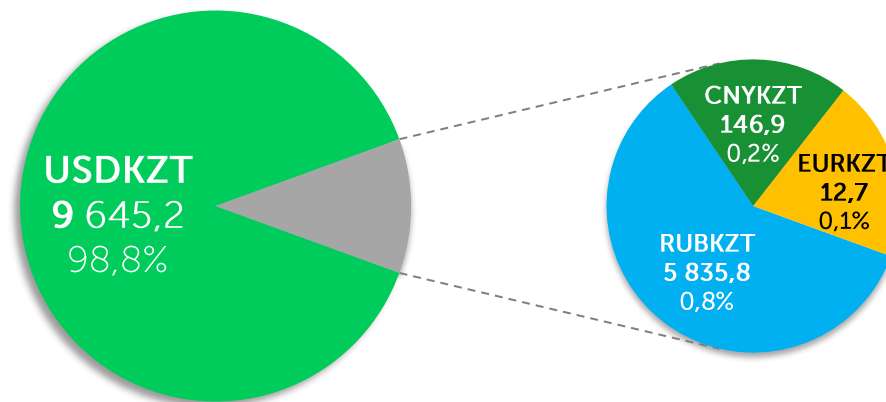
Соотношение биржевых и внебиржевых валютных операций

- 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

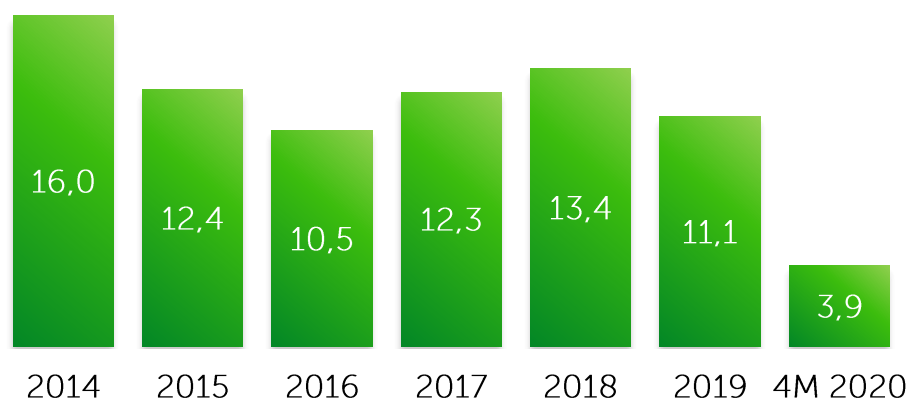


Структура биржевого рынка за 4М 2020 года в объеме торгов. Объем в млн единиц валюты



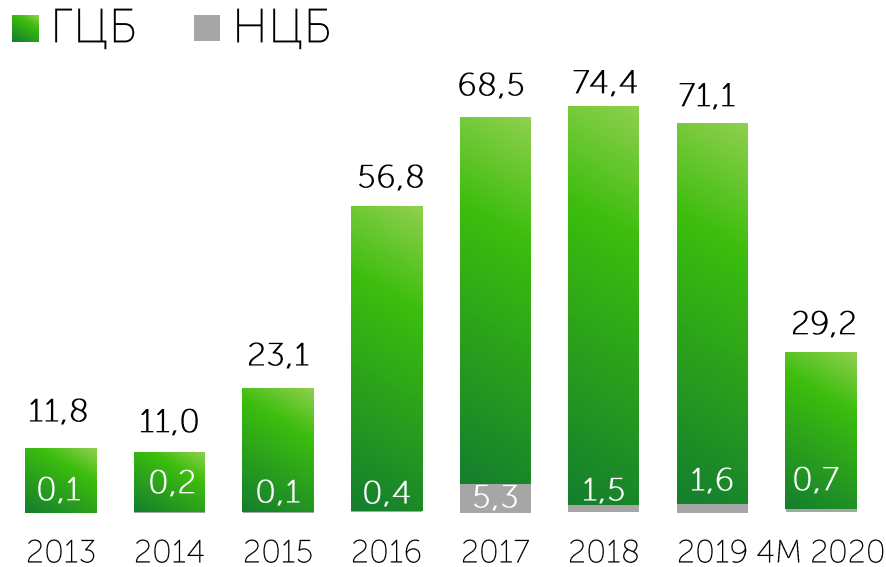
Примечание: доли рассчитаны от объема торгов в KZT

Объем торгов на спот-рынке, трлн KZT



Рынок операций репо

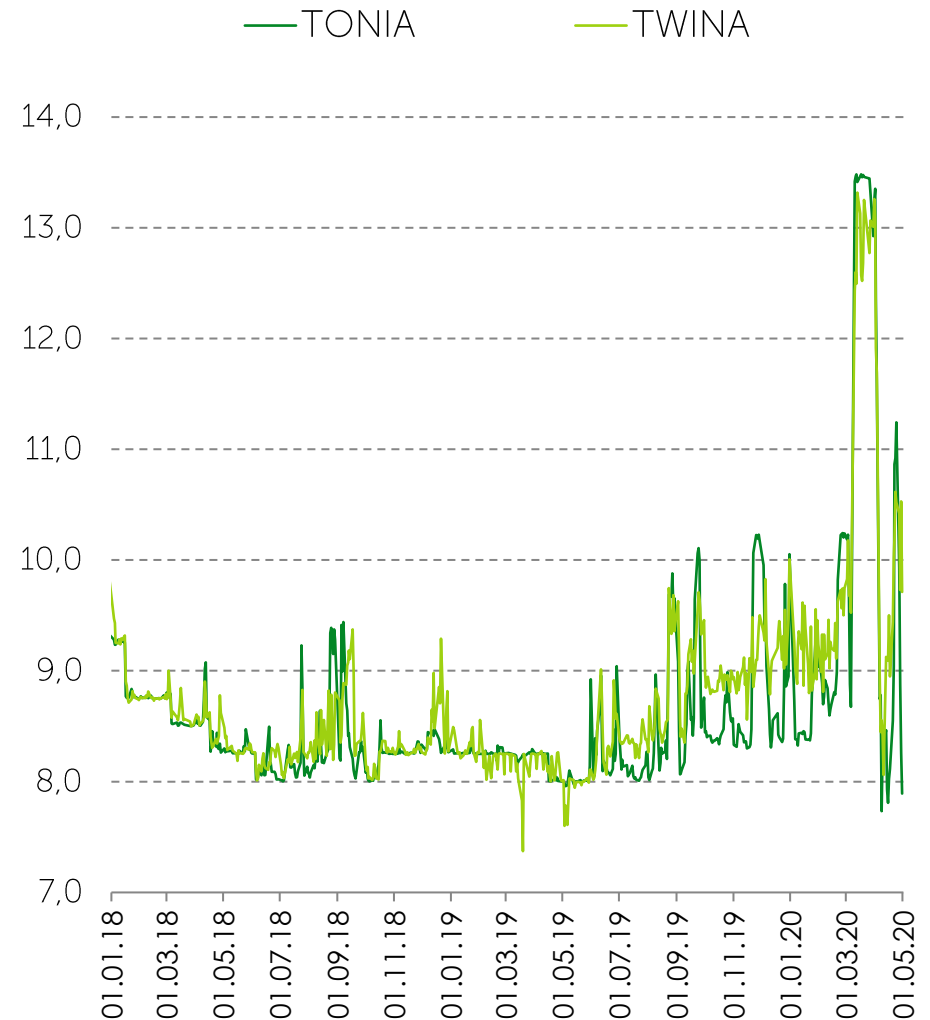
Объем торгов, трлн KZT



Инструменты рынка репо (объем за 4М 2020 / доля):

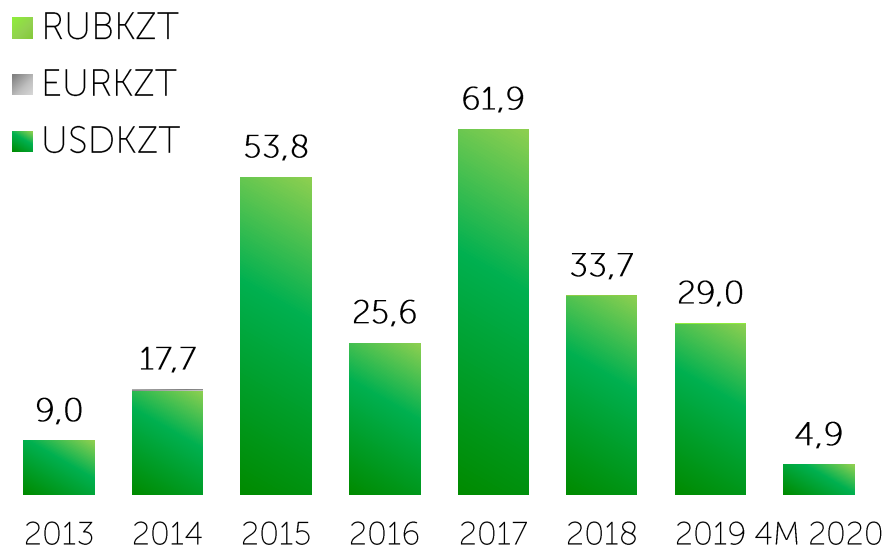
- **Авторепо с ГЦБ** (29 440,7 млрд KZT / 97,77 %)
- Авторепо с корзиной НЦБ (24,5 млрд KZT / 0,08 %)
- Авторепо с корзиной ОДГУ (44,0 млрд KZT / 0,15 %)
- Авторепо с НЦБ (198,6 млрд KZT / 0,66 %)
- Авторепо с ЦК (384,5 млрд KZT / 1,28 %)
- Прямое репо с НЦБ (7,5 млрд KZT / 0,02 %)
- Прямое репо с ЦК (12,5 млрд KZT / 0,04 %)

Индикаторы репо, % годовых



Рынок операций валютного свопа

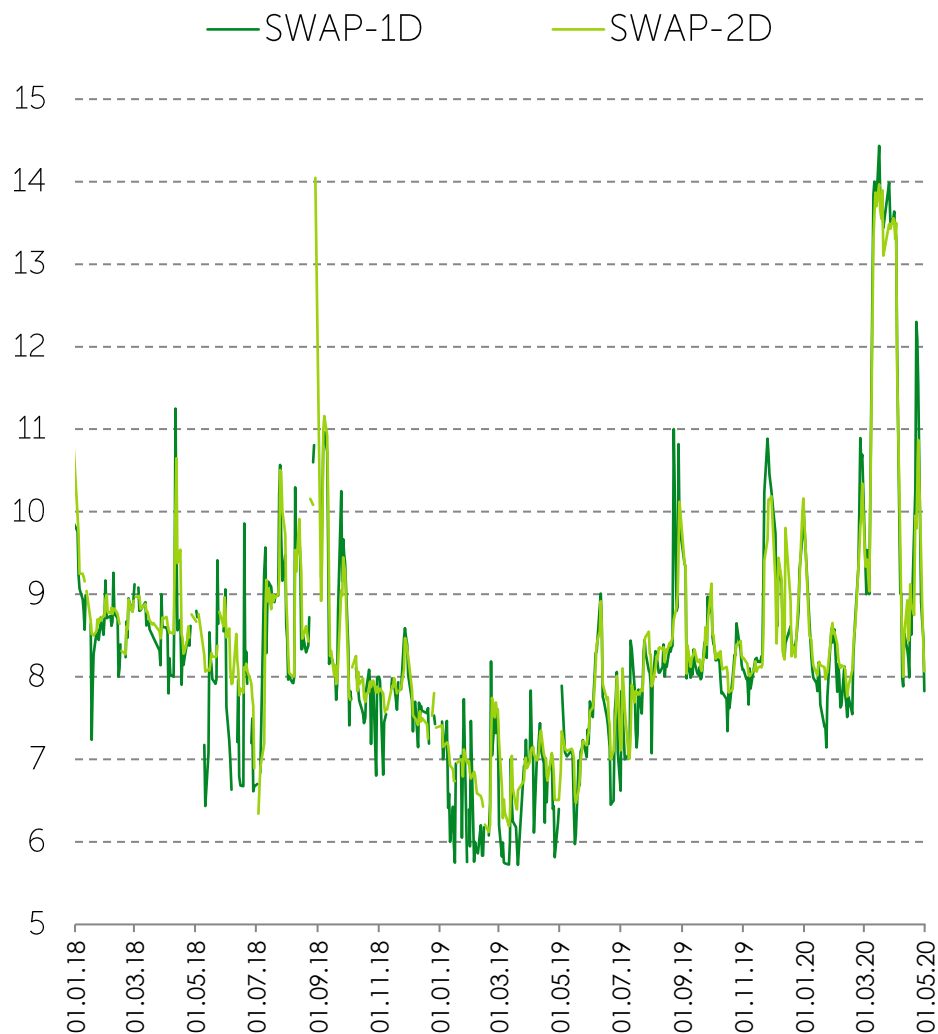
Объем торгов, млрд KZT



Инструменты рынка операций валютного свопа (объем за 4М 2020 / доля):

- 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 %)

Индикаторы своп-рынка, % годовых



Спасибо за внимание!

-  Kazakhstan Stock Exchange
-  kase_kz
-  Kazakhstan.stock.exchange
-  Казахстанская фондовая биржа KASE

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