



Қазақстан қор биржасы
Казахстанская фондовая биржа
Kazakhstan Stock Exchange

Типовая презентация

на 01 декабря 2022 года



АО "Казахстанская фондовая биржа"

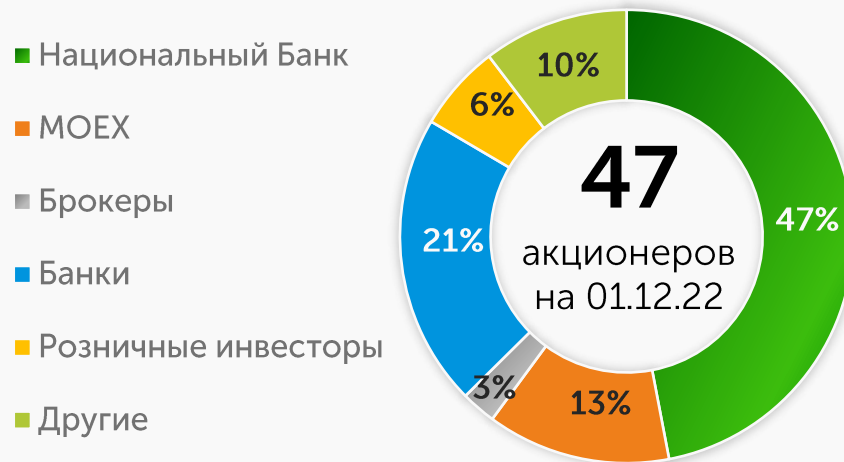
47,0% - НБРК

13,1% – МОЕХ

33,7% - 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



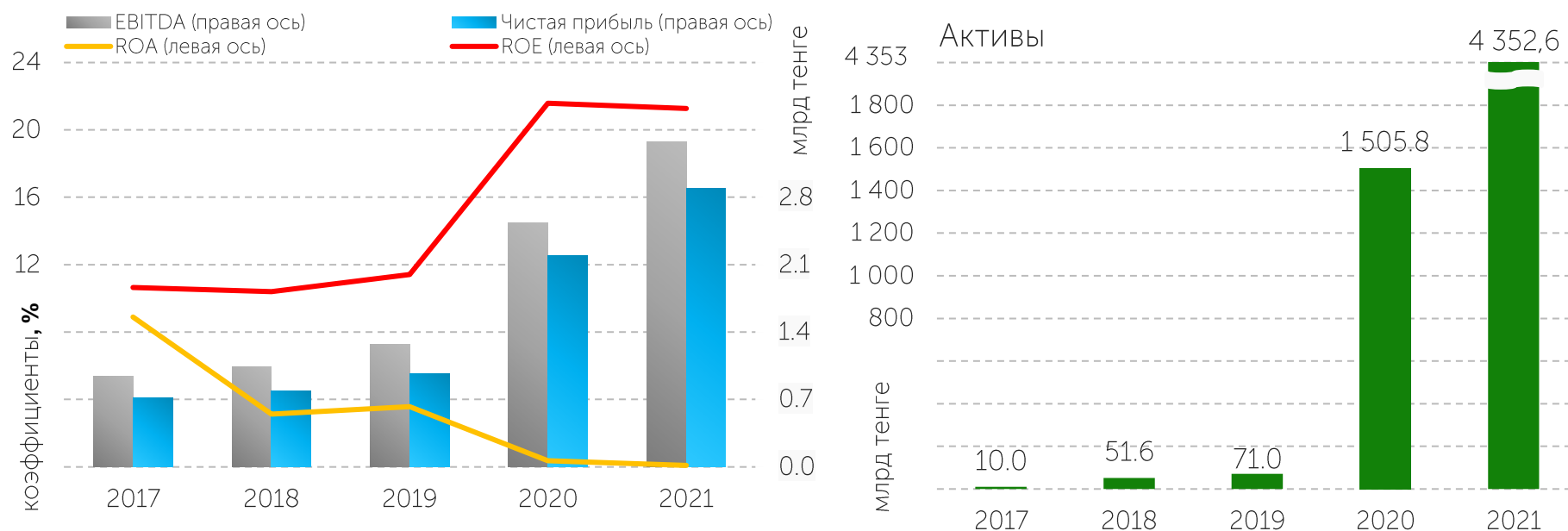
Акции и капитал KASE

На 01 октября 2022 года:

собственный капитал	24 648,4 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	22 923,8 KZT

Показатели доходности KASE

	Активы, млн KZT	Чистая прибыль, млн KZT	Доходность активов, %	Доходность капитала, %
2021	4 352 567,9	3 905,1	0,1	22,0
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



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

43

Фондовая

32

Валютная

27

Деривативы

52

всего участников рынка

21

банк второго уровня (из 21)
резиденты РК

22

брокерских компаний (из 22)
резиденты РК

46

локальных участников

4

иностранного участника
(ООО "ИВА Партнерс", ООО ИК "Фридом Финанс",
АО "Райффайзенбанк", Freedom Finance Global PLC)

2

МФО (Межгосударственный банк,
Евразийский банк развития)

12

участников, предоставляющих
услуги прямого доступа (DMA)

Новые члены KASE:

2022

- АО "Инвестиционная компания Standard" / фондовая
- АО "Дочерняя организация Народного Банка Казахстана "Halyk Finance" / валютная
- АО "ЕвроЦентрАстана" / фондовая и деривативы
- АО "UD Capital" / фондовая и деривативы
- АО "NGDEM Finance" / деривативы
- Freedom Finance Global PLC / фондовая

2021

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

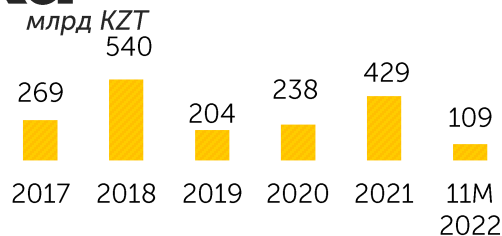
2020

- АО "ForteFinace" / фондовая и деривативы
- АО "Исламский банк "Заман-Банк" / валютная

Показатели биржевого рынка за одиннадцать месяцев 2022 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	7 557,9	16 401,1	1 707	33 740,6	19,8
Акции	109,0	235,9	1 443	486,5	0,3
KASE Global	24,1	53,6	111	107,5	1,0
Корпоративные долговые ЦБ	1 941,7	4 215,1	71	8 668,3	122,7
ГЦБ	5 336,0	11 575,6	14	23 821,3	1 724,6
Облигации МФО	105,3	264,8	2	542,2	365,8
ЦБ инвестиционных фондов	8,5	18,6	64	37,9	0,6
Производные ценные бумаги	17,2	37,6	4	76,8	20,3
Рынок иностранных валют	18 970,2	40 932,2	342	84 688,3	248,0
Рынок денег	208 974,4	457 398,4	942	932 921,3	990,3
Операций репо	183 494,8	401 783,5	921	819 173,3	889,4
Операций валютного свопа	25 479,6	55 614,9	21	113 748,0	5 418,9
Деривативы	–	–	–	–	–
Итого	235 510,3	514 748,5	2 991	1 051 385,3	351,6

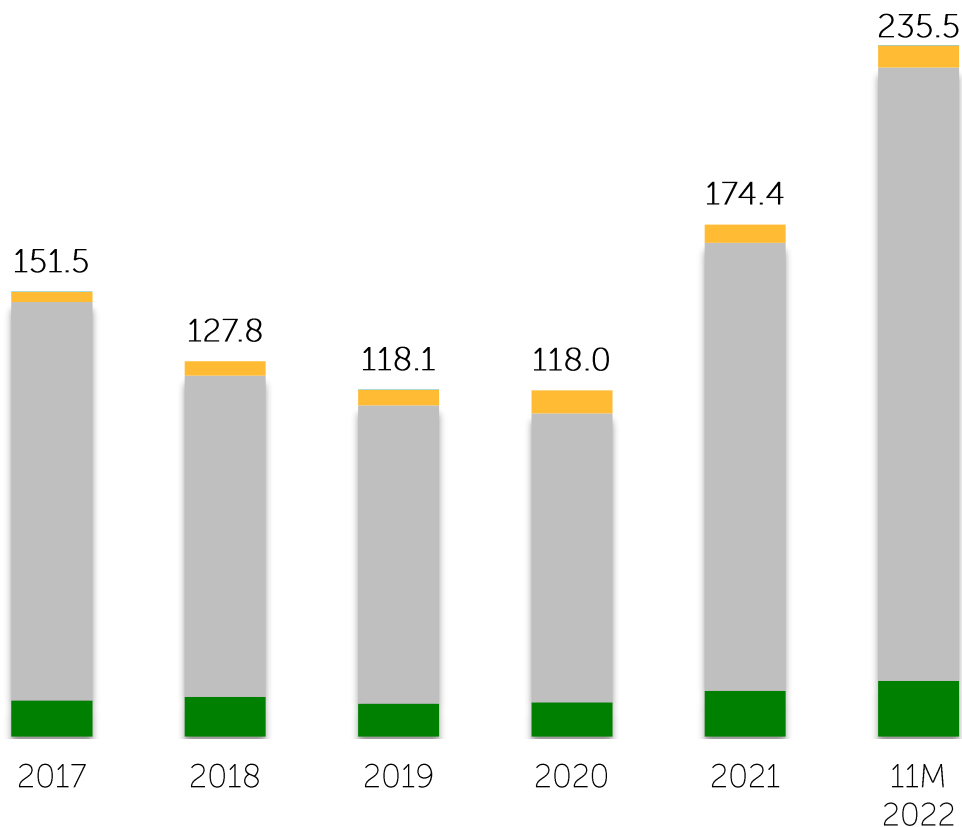
Объем и структура рынка



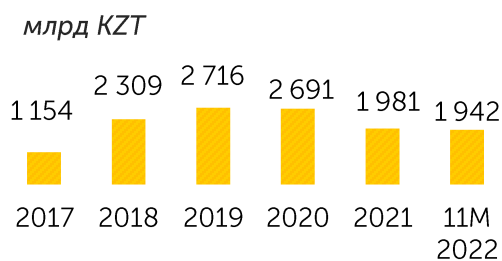
Рынок акций

2021	+80,0%
2020	+17,0%
2019	-62%
2018	x2
2017	+7,7%

Динамика объема торгов по секторам, трлн KZT

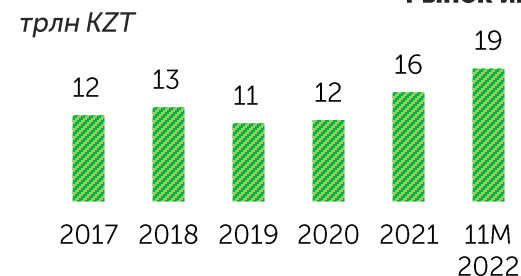


Рынок корпоративных облигаций



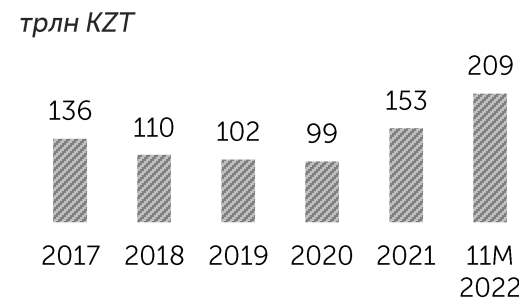
2021	-26%
2020	-1%
2019	+18%
2018	x2
2017	+127%

Рынок иностранных валют



2021	+34%
2020	+4%
2019	-17%
2018	+9%
2017	+18%

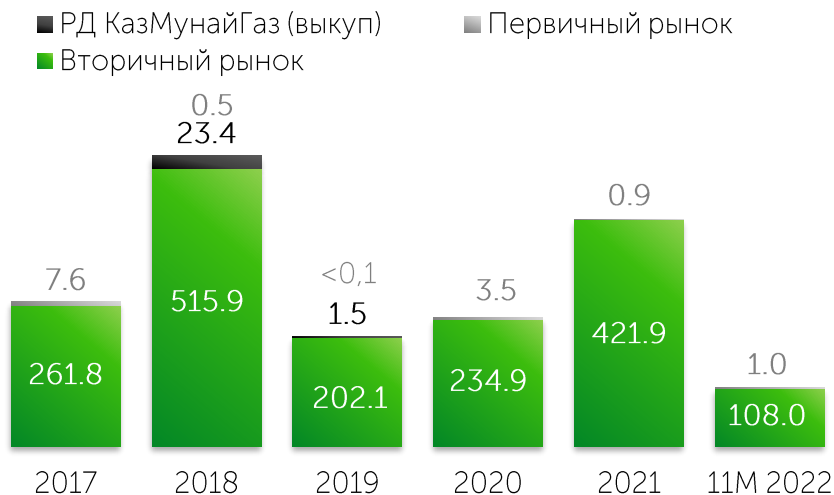
Рынок денег



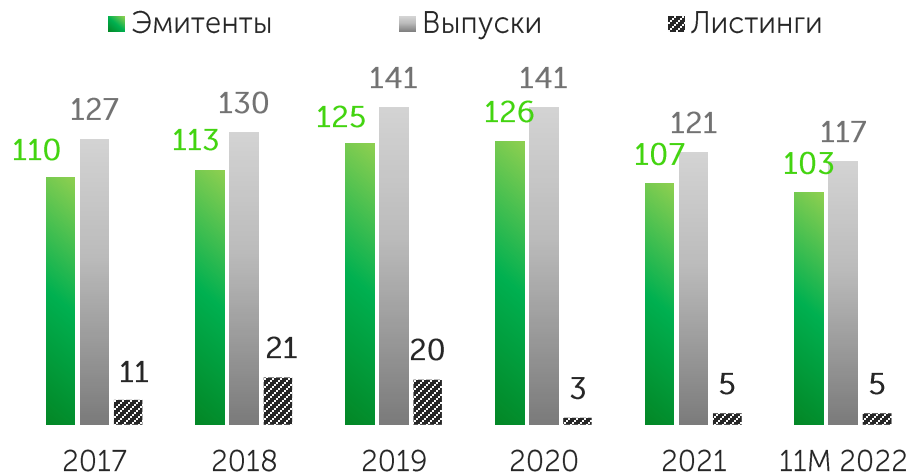
2021	+55%
2020	-3%
2019	-7%
2018	-19%
2017	+64%

Рынок акций

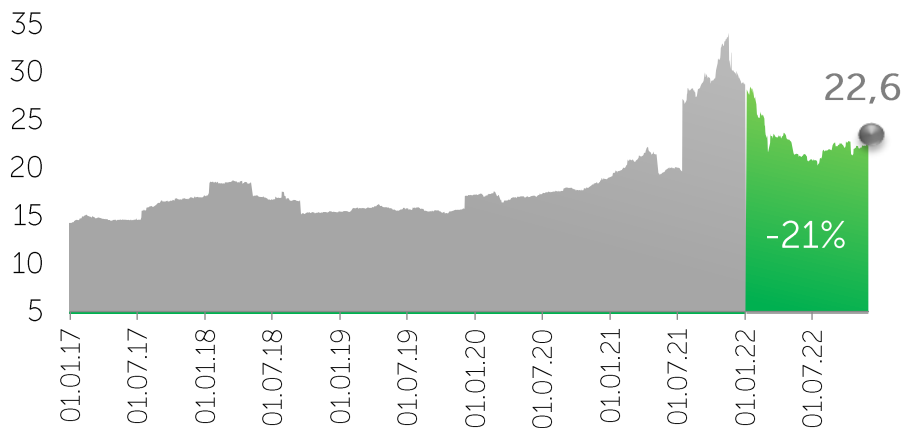
Объем сделок, млрд KZT



Новые листинги



Капитализация рынка акций, трлн KZT



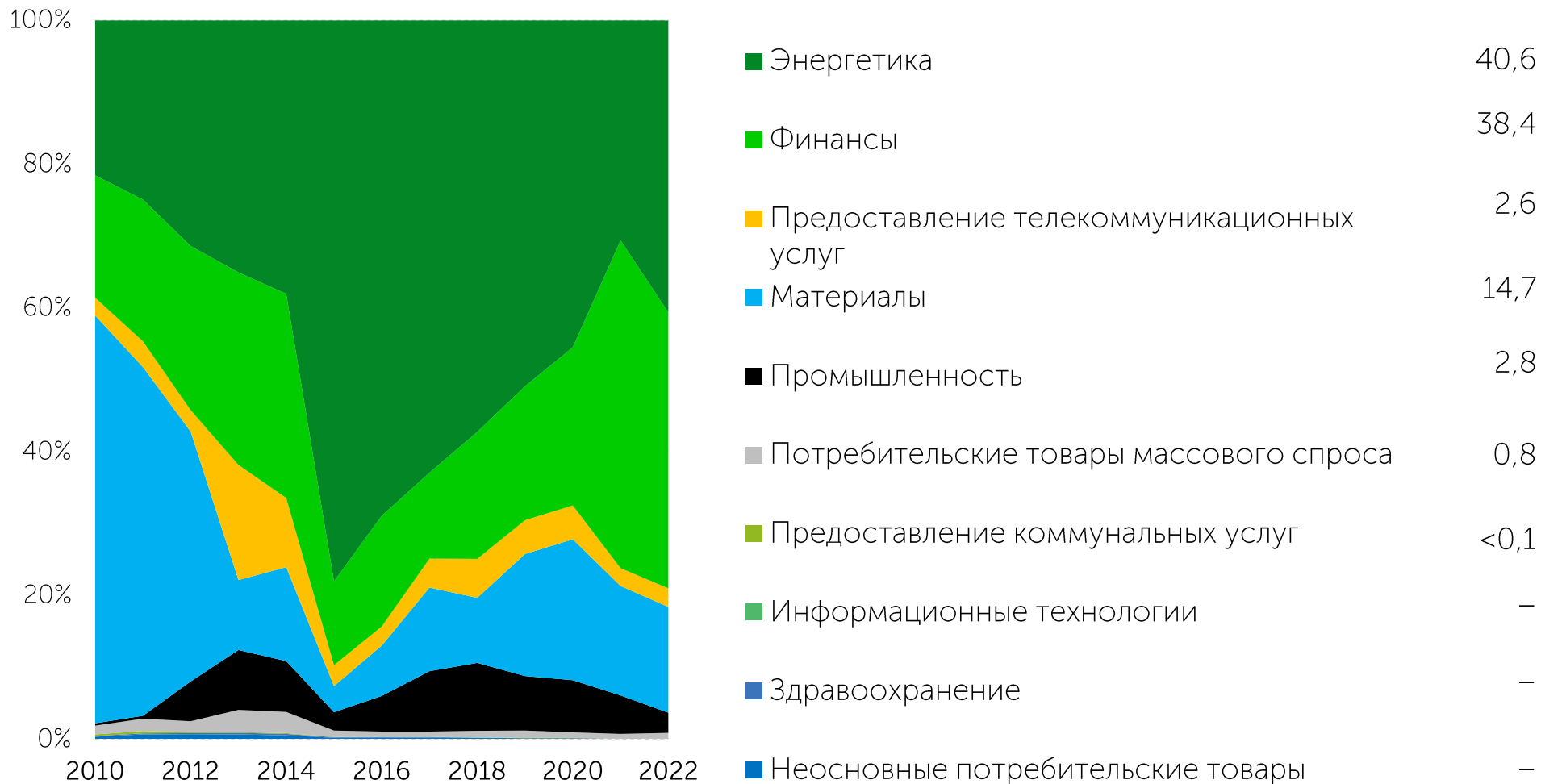
Основные показатели за 11M 2022 года



* с учетом индивидуальных счетов и уникальных кодов по омнибус счетам

Отраслевая структура списков акций

Доля от капитализации, %

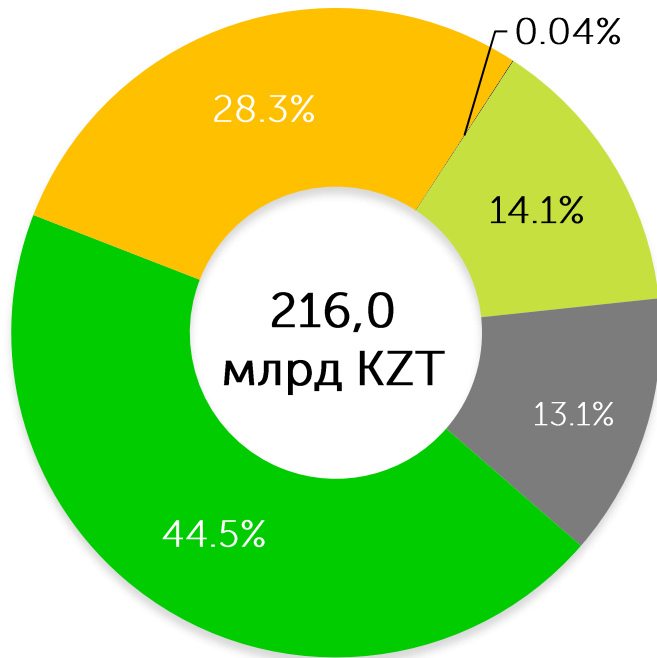


Примечание: в качестве классификатора используется "Global Industry Classification Standard (GICS)®"

Источник: KASE

Рынок акций: инвесторская база

Доли основных категорий инвесторов на вторичном рынке за 11М 2022 года*

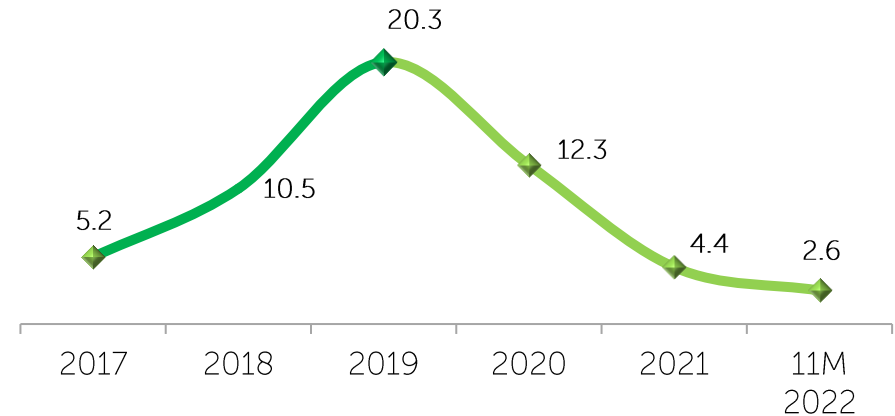


- Банки
- Брокеры-дилеры
- Др. институциональные инвесторы
- Физические лица
- Прочие юридические лица

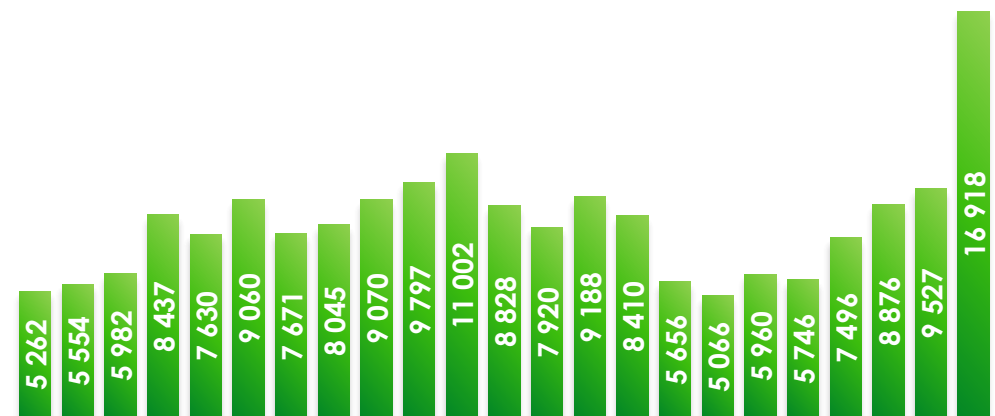
* от общего брутто-оборота торгов акциями без учета крупных сделок

Источник: KASE

Доля нерезидентов в брутто-обороте*, %



Динамика активных розничных инвесторов на рынке акций**

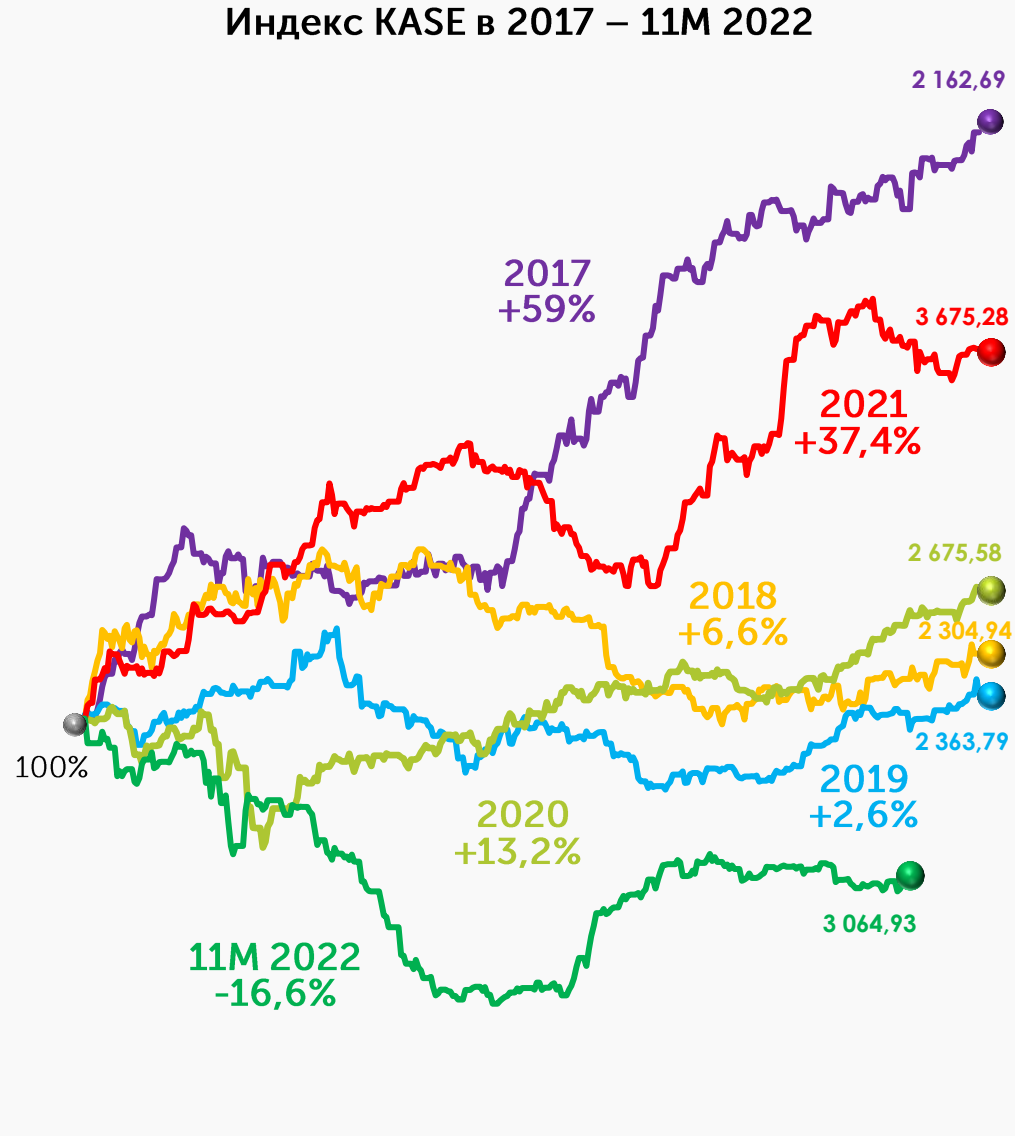


янв. 2021, фев. 2021, мар. 2021, апр. 2021, май. 2021, июн. 2021, июл. 2021, авг. 2021, сен. 2021, окт. 2021, ноя. 2021, дек. 2021, янв. 2022, фев. 2022, мар. 2022, апр. 2022, май. 2022, июн. 2022, июл. 2022, авг. 2022, сен. 2022, окт. 2022, ноя. 2022

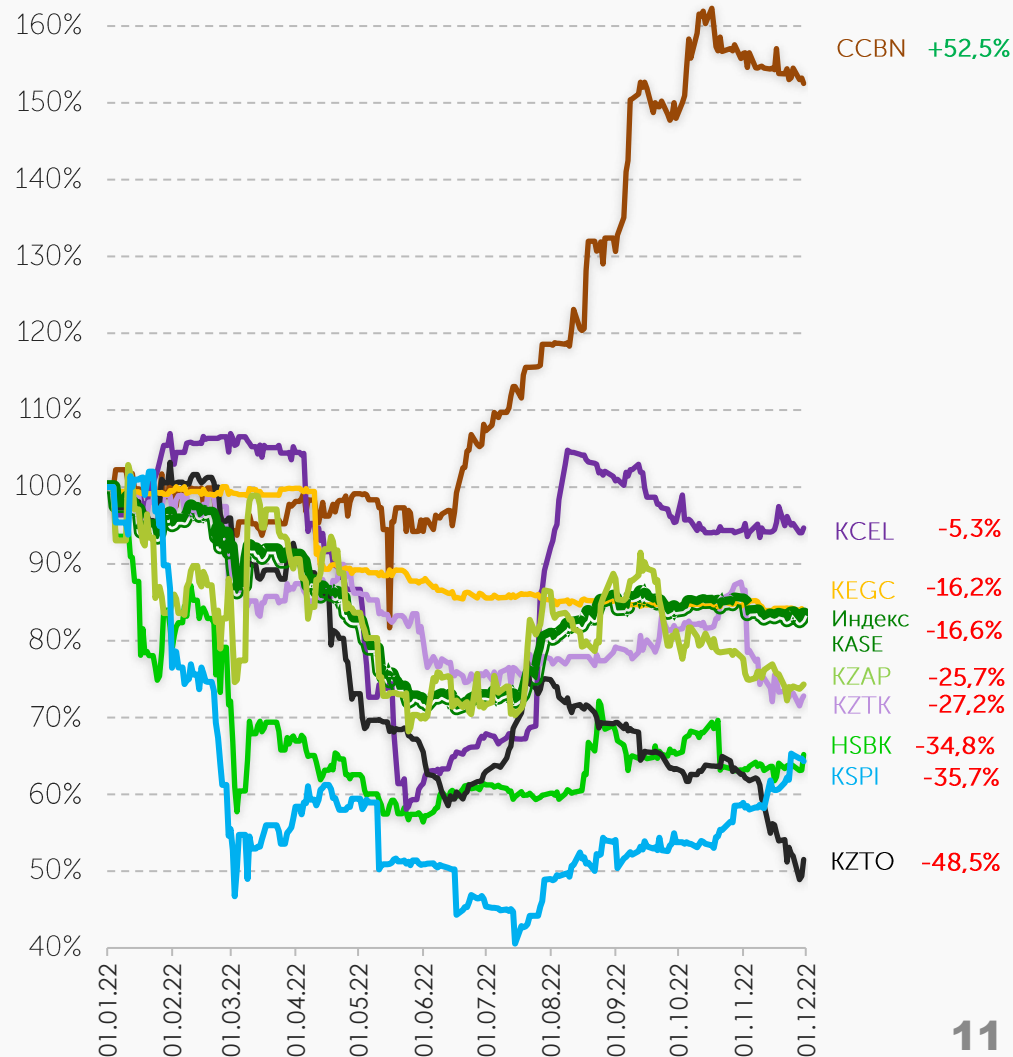
** с учетом индивидуальных счетов и уникальных кодов по омнибус счетам

Динамика Индекса KASE

Индекс KASE в 2017 – 11М 2022

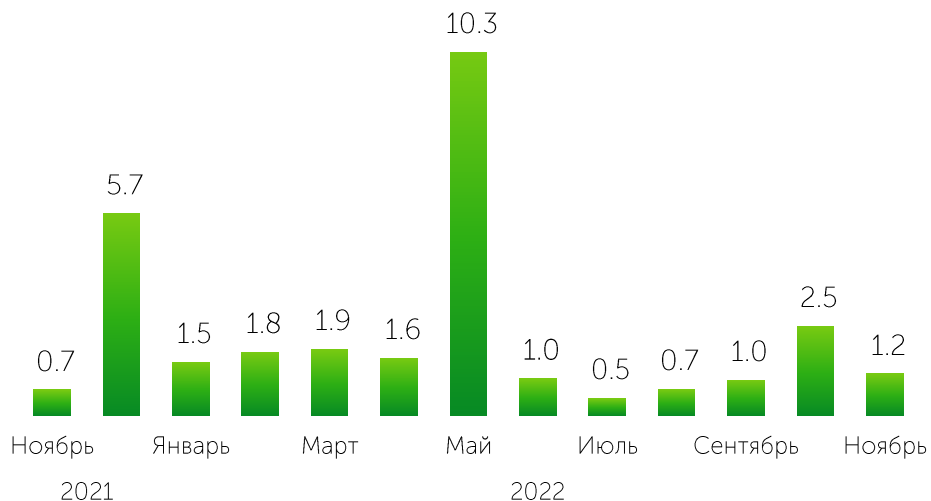


Динамика составляющих Индекса KASE

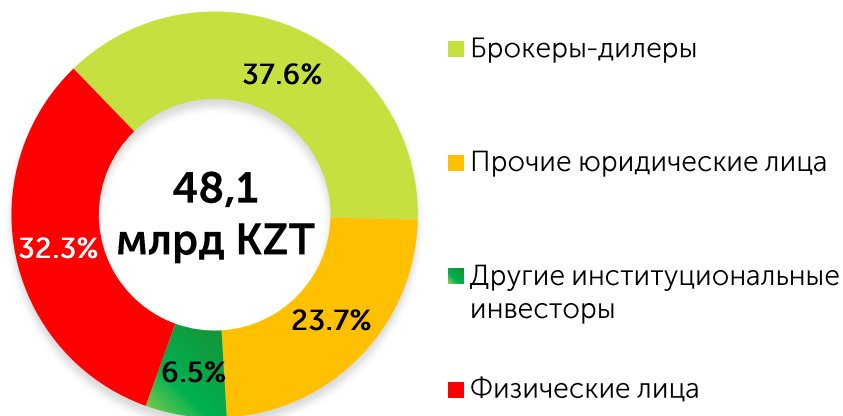


Источник: KASE, Bloomberg

Объем сделок, млрд KZT



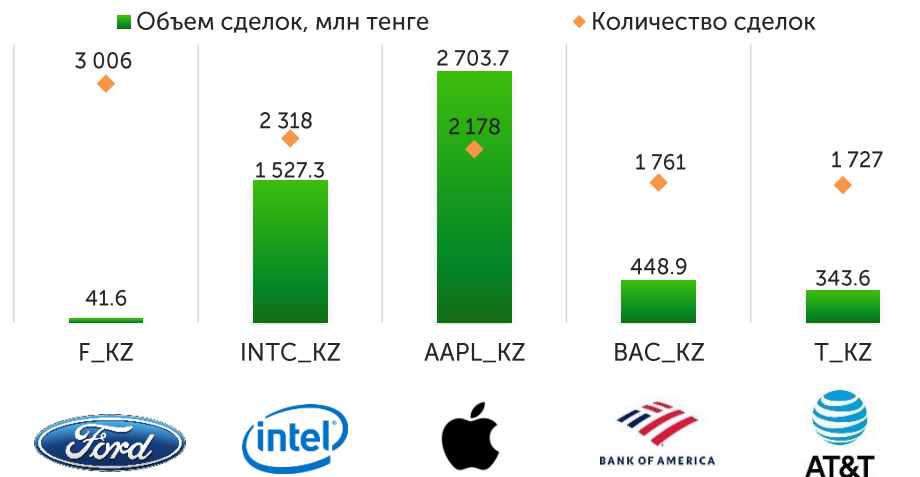
Доли основных категорий инвесторов за 11М 2022 года*



* от общего брутто-оборота торгов в секторе KASE Global без учета крупных сделок

Источник: KASE

Топ-5 наиболее популярных акций сектора KASE Global по итогам 11М 2022 года



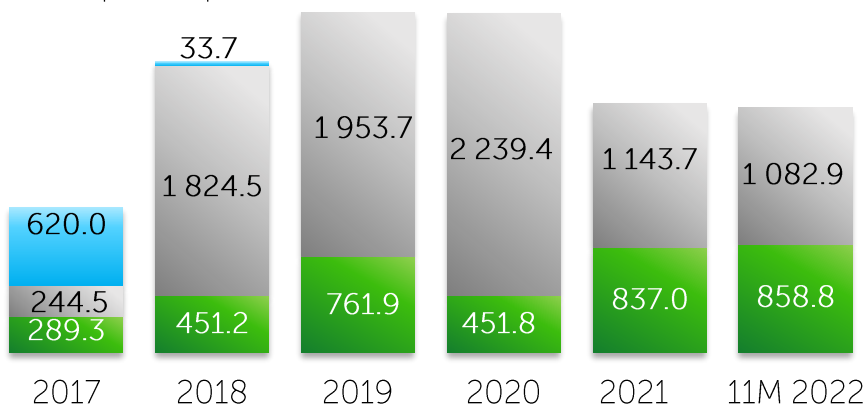
Основные показатели за 11М 2022 года



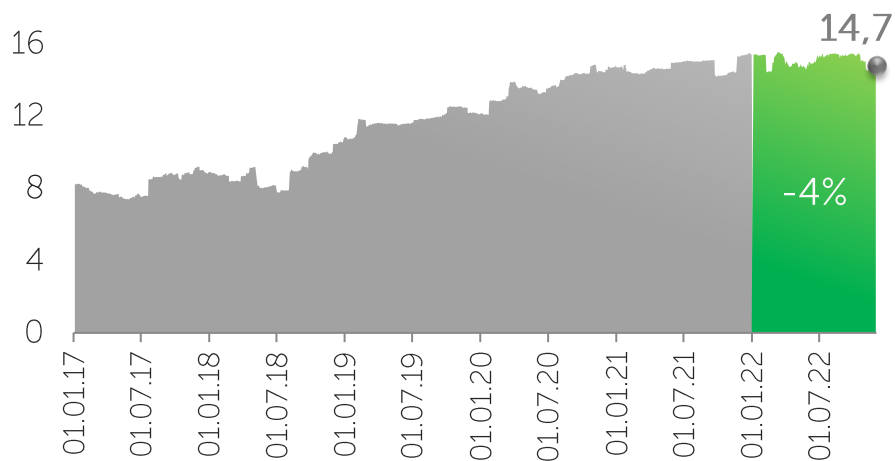
Рынок корпоративных облигаций

Объем сделок, млрд KZT

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



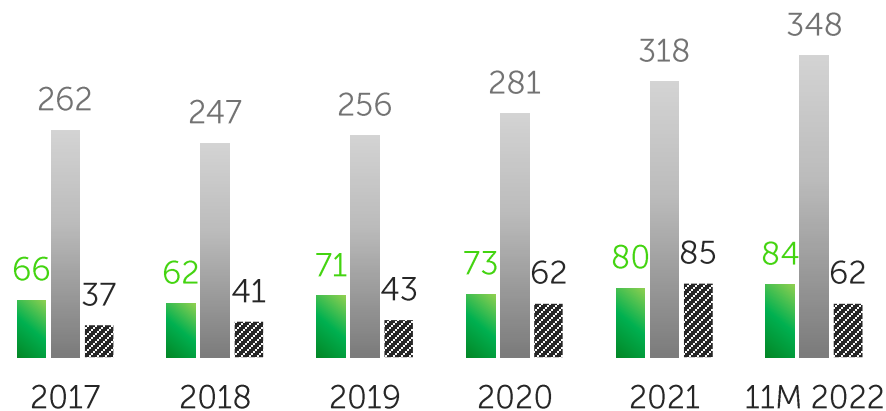
Объем корпоративного долга в обращении, трлн KZT



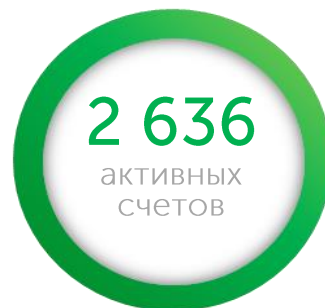
Источник: KASE

Новые листинги

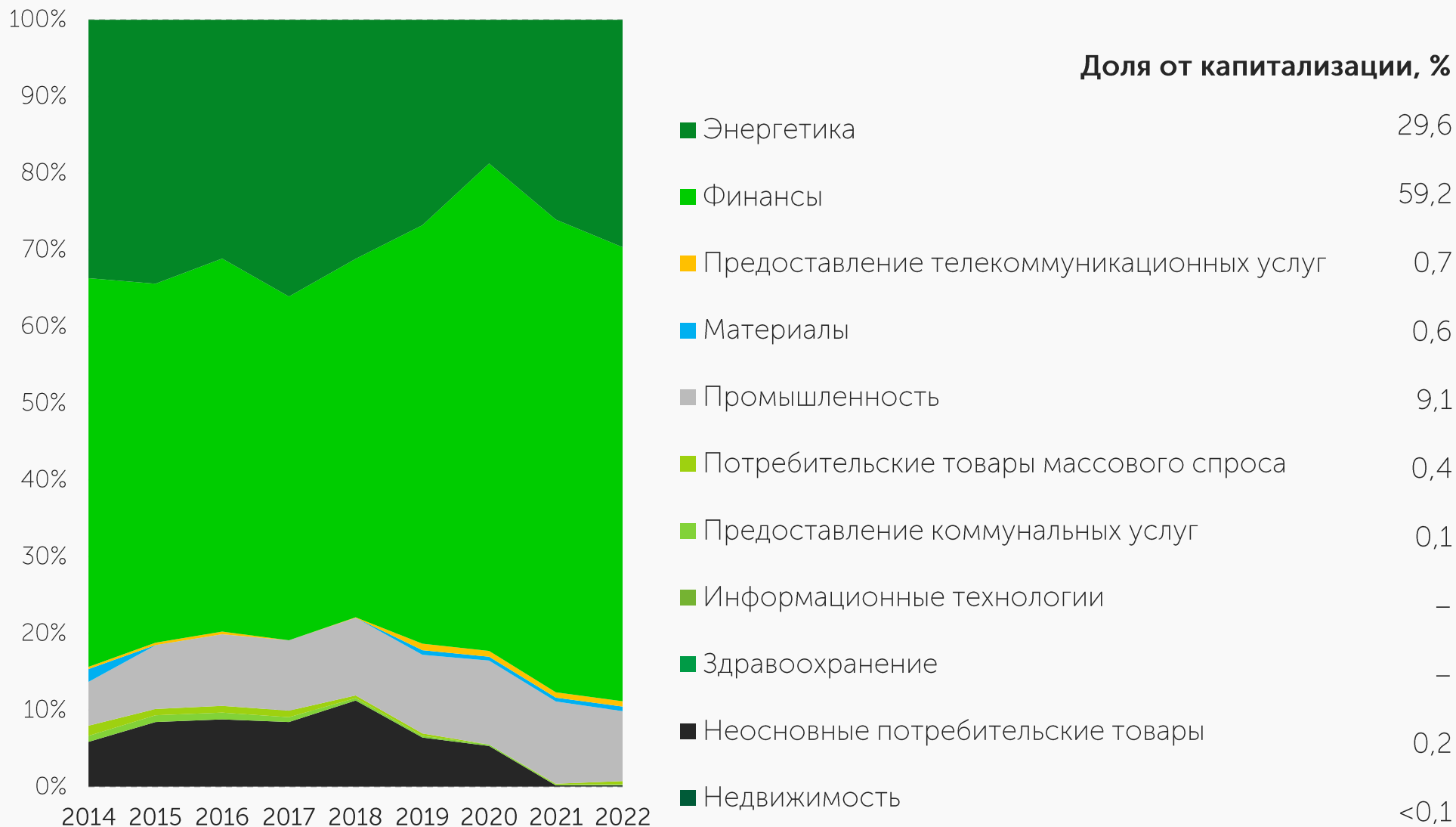
- Эмитенты
- Выпуски
- Листинги



Основные показатели за 11M 2022 года



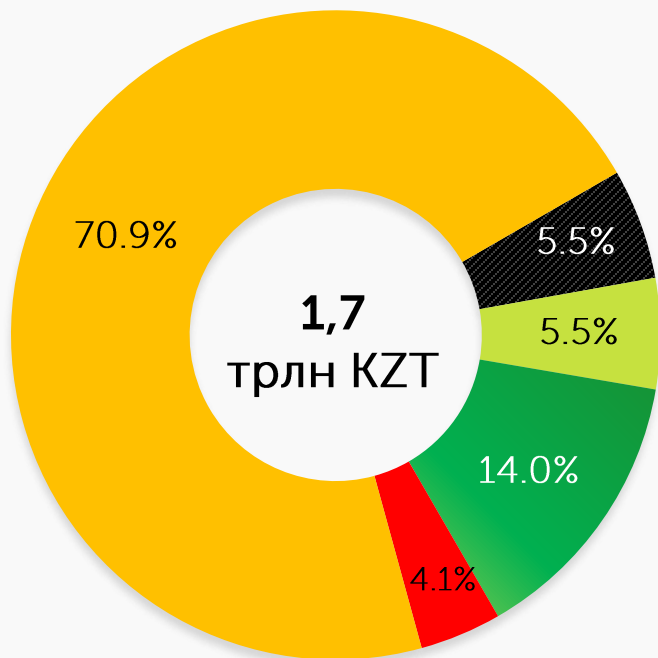
Отраслевая структура списков облигаций KASE



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

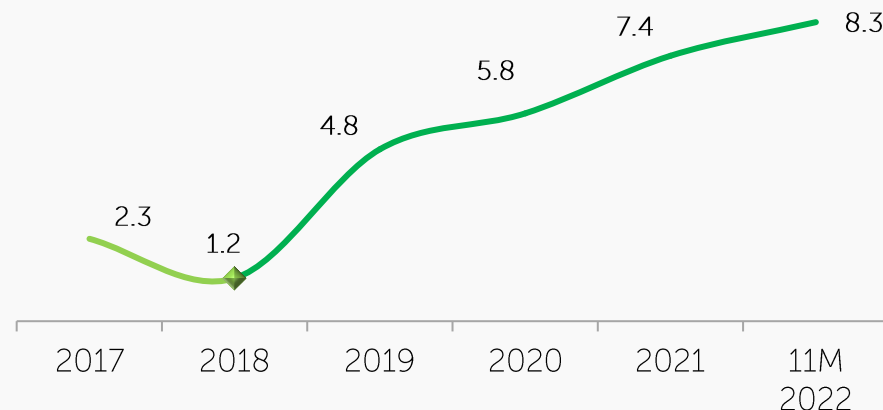
Инвесторская база рынка корпоративных облигаций KASE

Доли основных категорий инвесторов на вторичном рынке за 11М 2022 года*

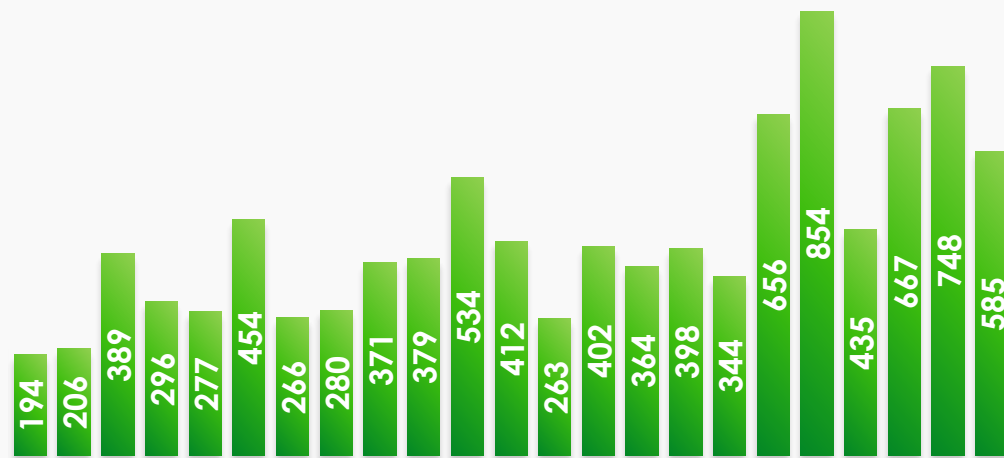


- Банки
- Брокеры-дилеры
- Др. институциональные инвесторы
- Физические лица
- Прочие юридические лица

Доля нерезидентов в брутто-обороте, %



Динамика активных счетов на рынке корпоративных облигаций



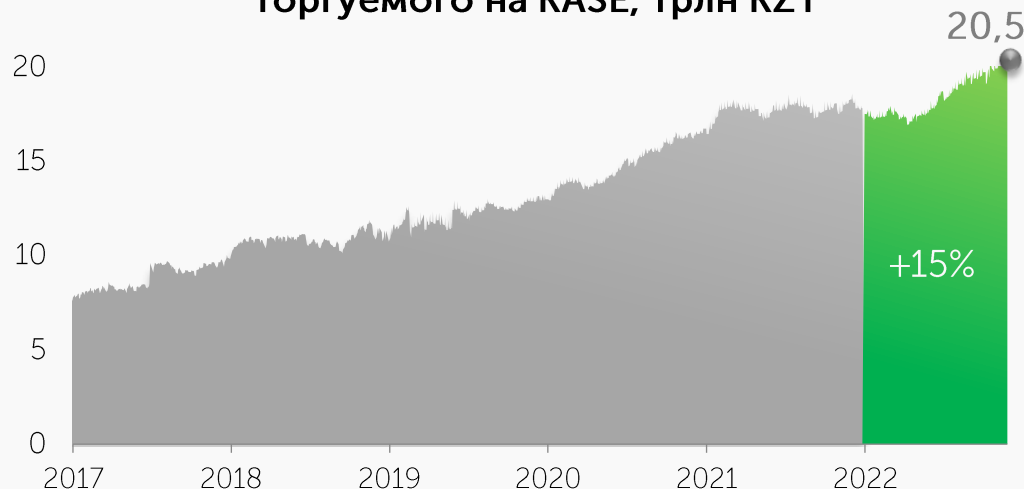
янв. 2021, фев. 2021, мар. 2021, апр. 2021, май. 2021, июн. 2021, июл. 2021, авг. 2021, сен. 2021, окт. 2021, ноя. 2021, дек. 2021, янв. 2022, фев. 2022, мар. 2022, апр. 2022, май. 2022, июн. 2022, июл. 2022, авг. 2022, сен. 2022, окт. 2022, ноя. 2022

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

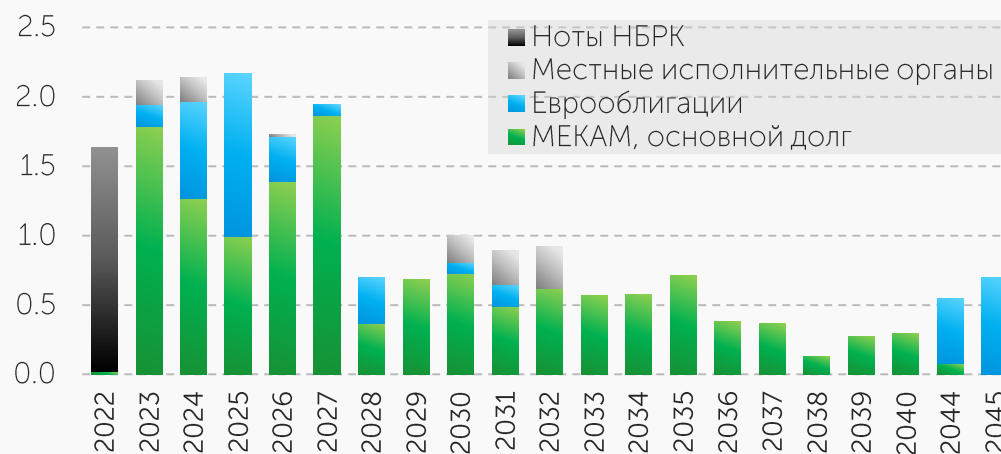
Динамика объема торгов, млрд KZT



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



Динамика выплат по госдолгу, трлн KZT

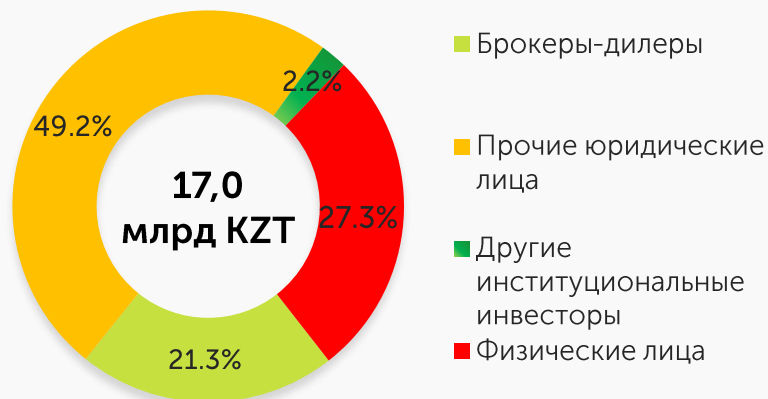


Источник: KASE

Объем сделок, млн KZT



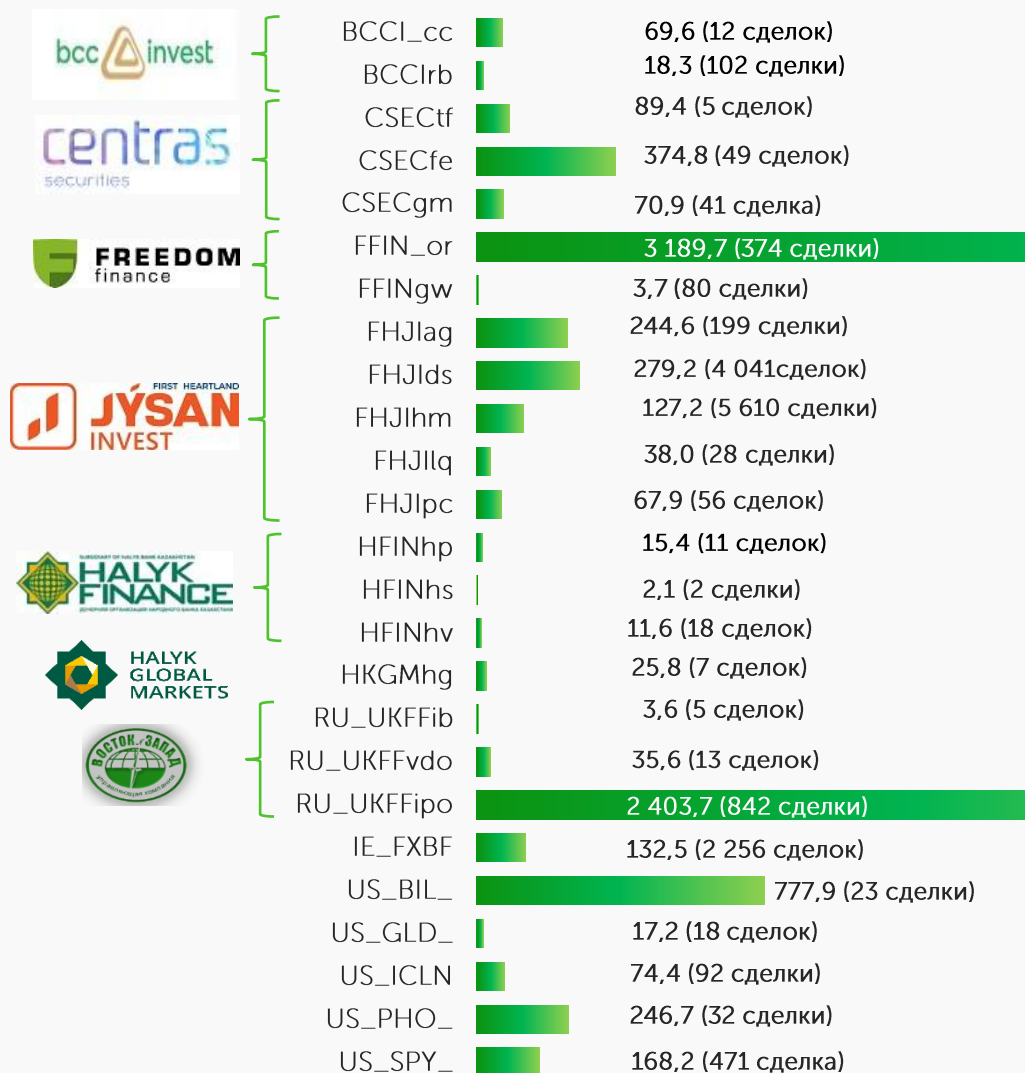
Доли основных категорий инвесторов за 11M 2022 года*



* от общего брутто-оборота торгов ценными бумагами инвестиционных фондов

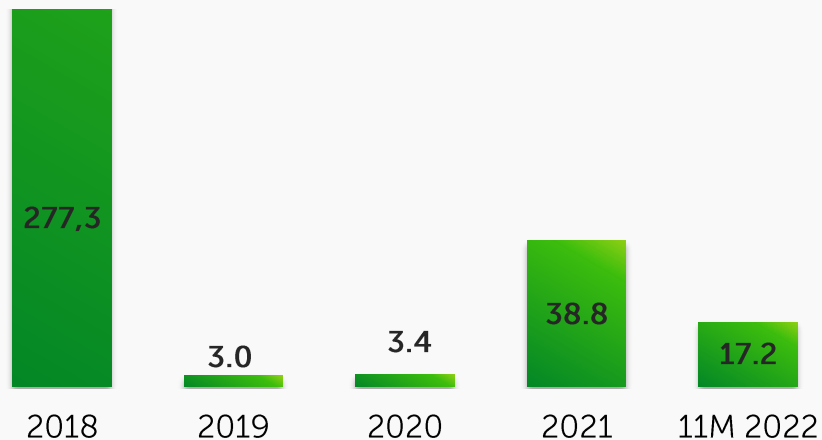
Источник: KASE

Объем торгов в разбивке по инструментам за 11M 2022 года, млн KZT



Производные ценные бумаги

Объем сделок, млрд KZT



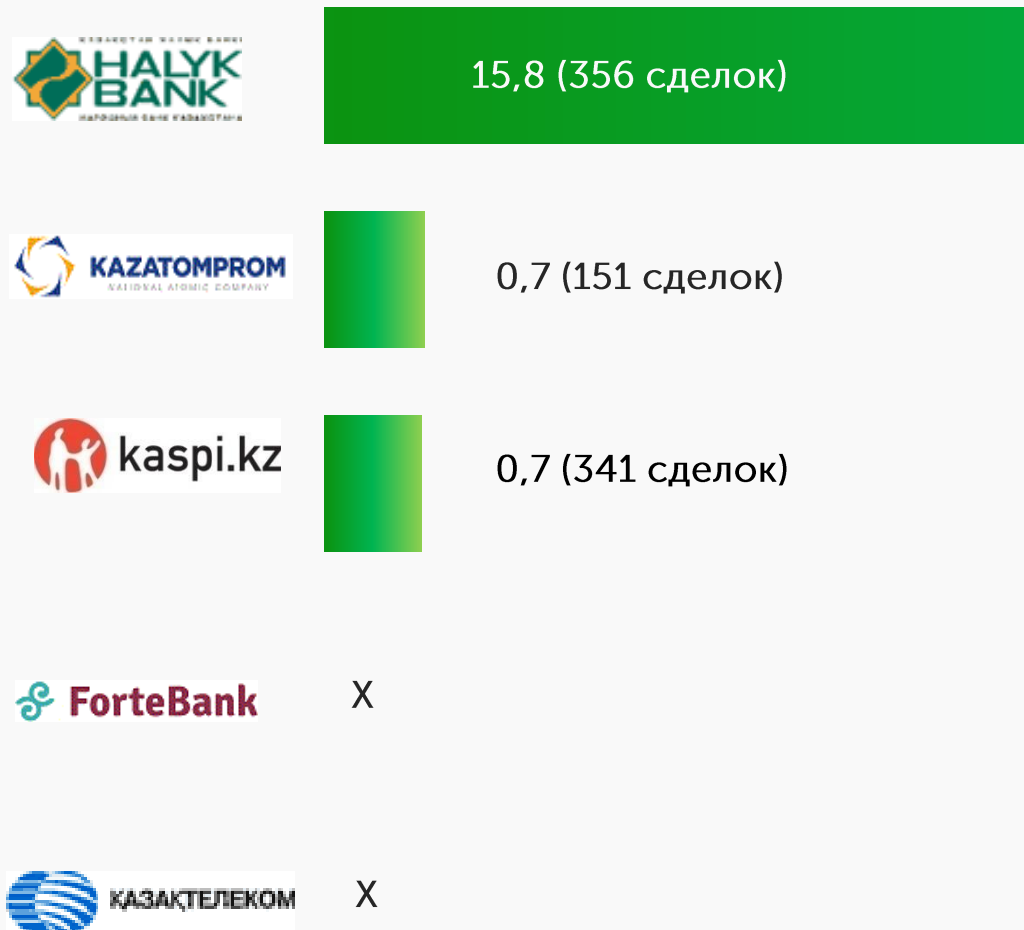
Доли основных категорий инвесторов за 11M 2022 года*



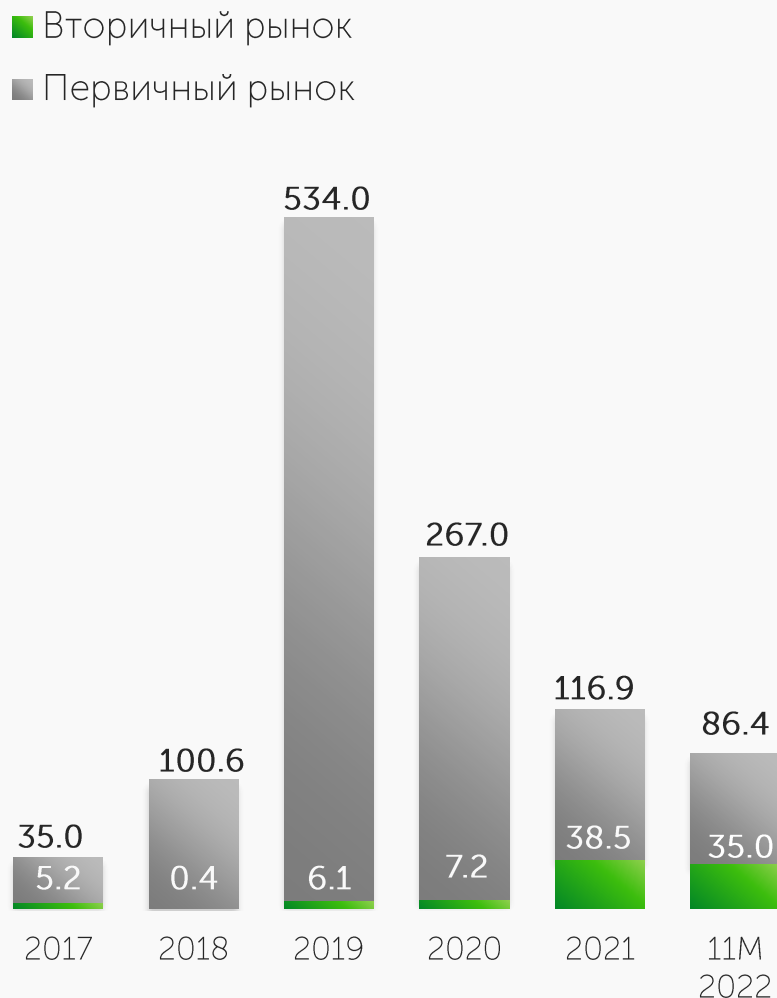
* от общего брутто-оборота торгов производными ценными бумагами

Источник: KASE

Объем торгов в разбивке по инструментам за 11M 2022 года, млрд KZT



Объемы торгов, млрд KZT

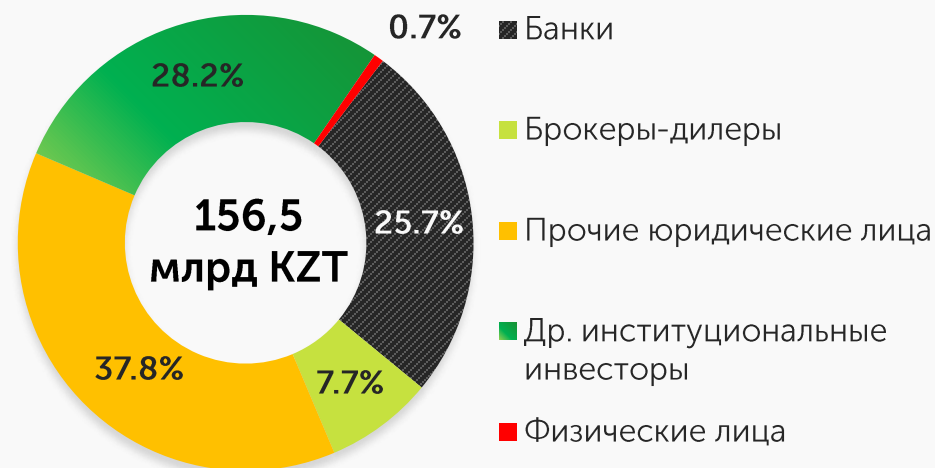


Источник: KASE

На 01 декабря 2022 года в официальном списке KASE находятся **39 выпуск облигаций 4 организаций:**

- 16 выпусков Евразийского банка развития
- 12 выпусков Европейского банка реконструкции и развития
- 2 выпуска Международной финансовой корпорации
- 9 выпусков Азиатского банка развития

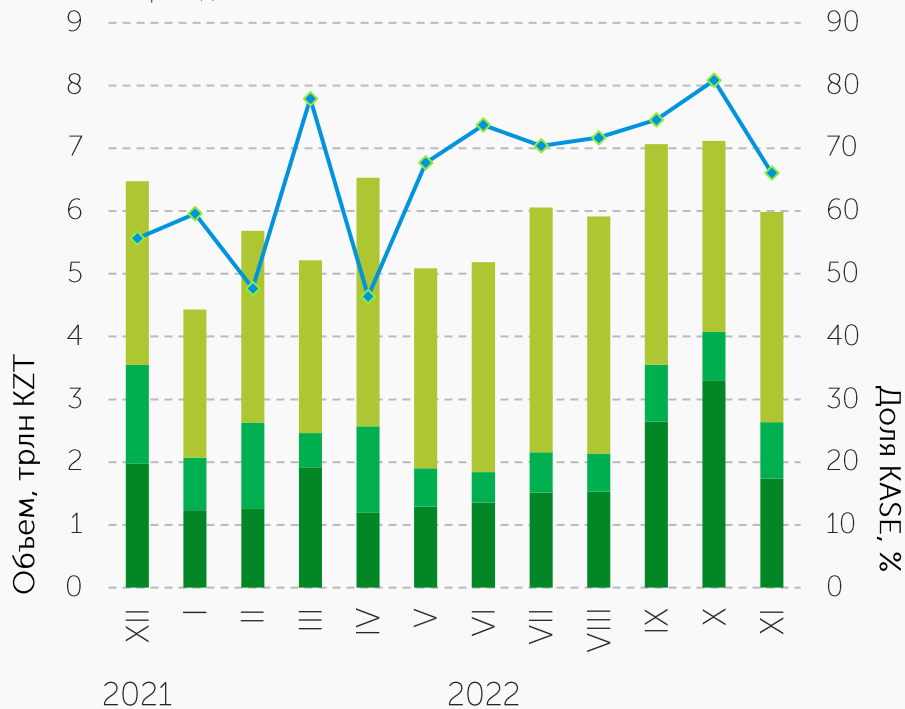
Доли основных категорий инвесторов за 11М 2022 года*



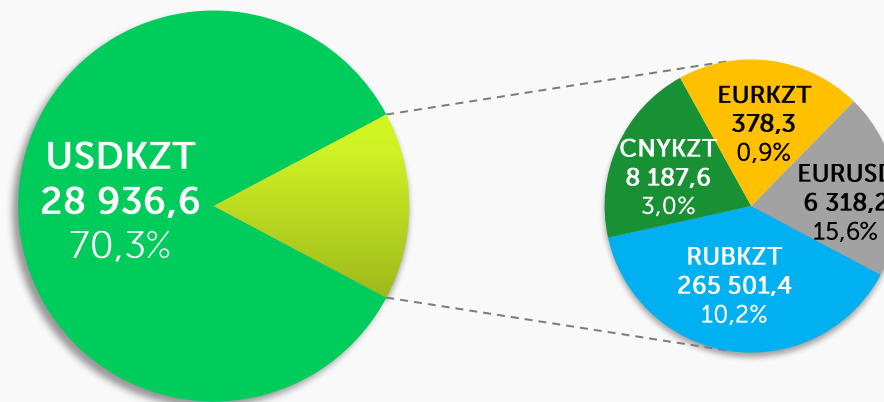
* от общего брутто-оборота торгов облигациями МФО, из расчета исключена позиция инициатора специализированных торгов

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

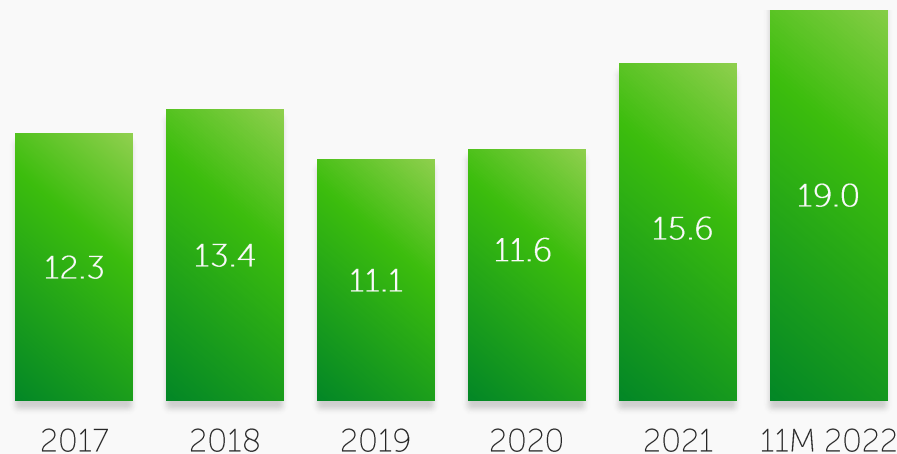


Структура биржевого рынка за 11М 2022 года в объеме торгов. Объем в млн единиц валюты



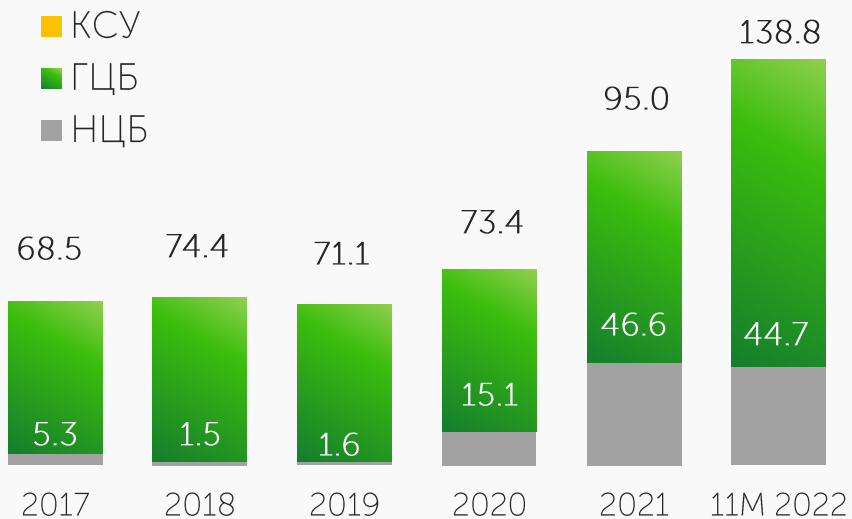
Примечание: доли рассчитаны от объема торгов в KZT

Объем торгов на спот-рынке, трлн KZT

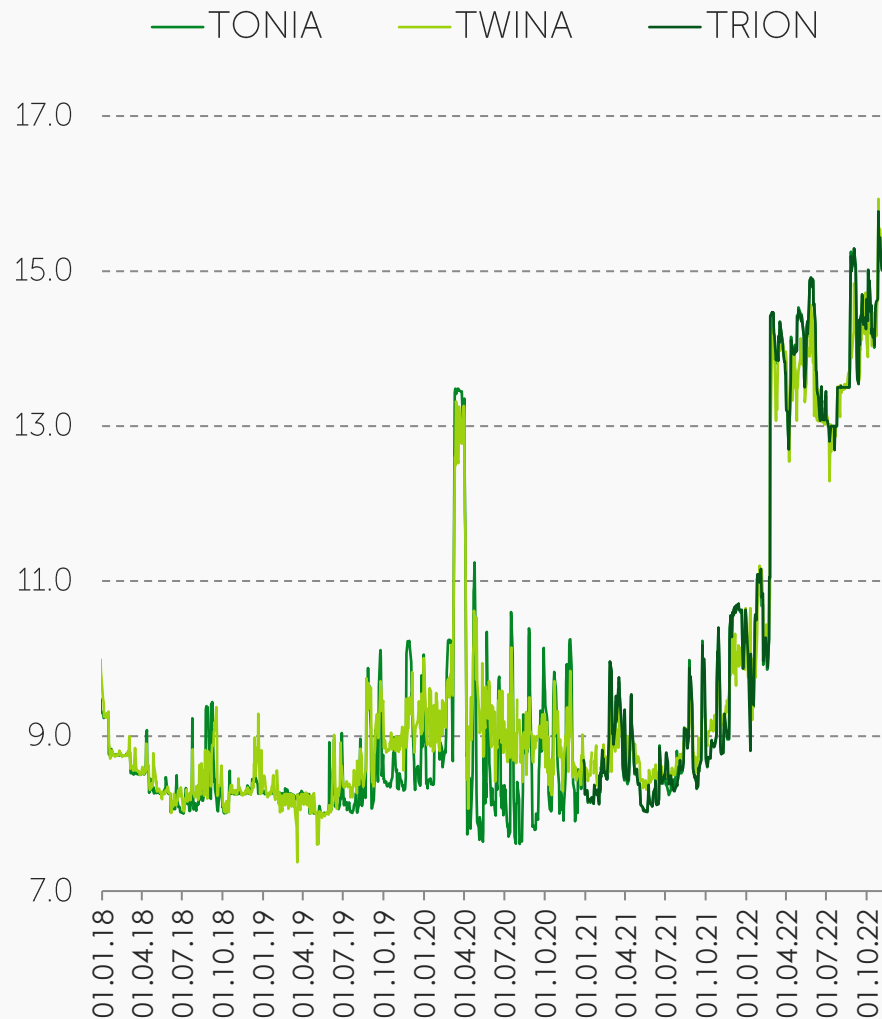


Рынок операций репо

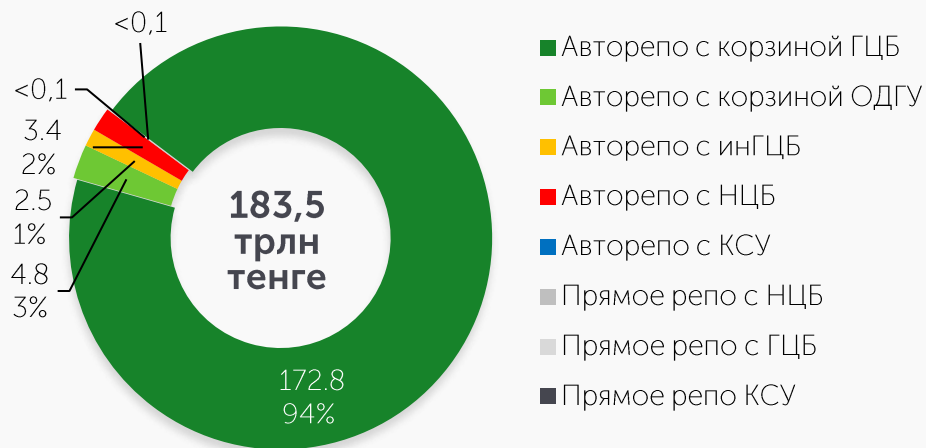
Объем торгов, трлн KZT



Индикаторы репо, % годовых

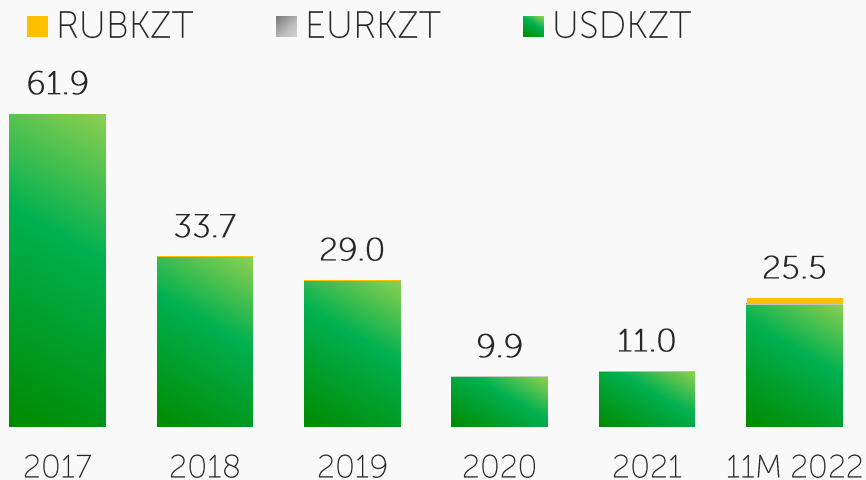


Инструменты рынка репо, трлн KZT

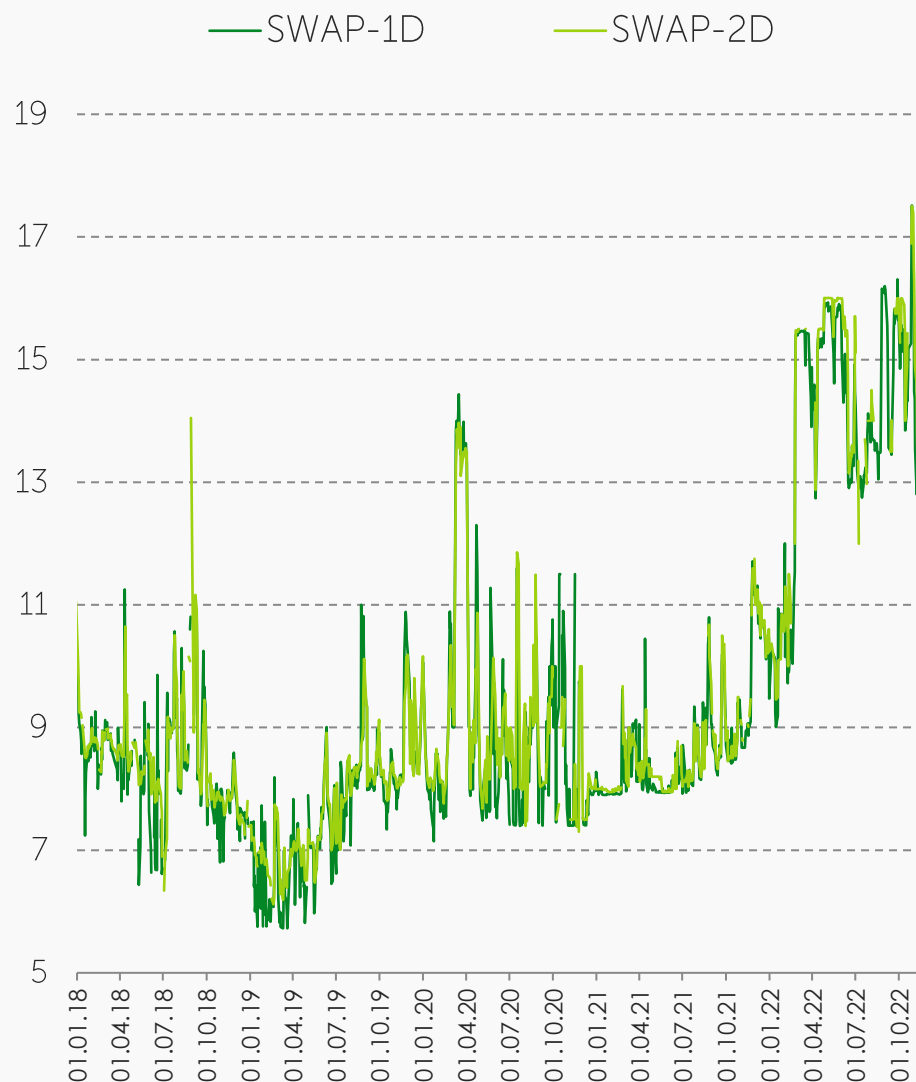


Рынок операций валютного свопа

Объем торгов, трлн KZT



Индикаторы своп-рынка, % годовых



Инструменты рынка операций валютного свопа (объем за 11M 2022/ доля):

- **USDKZT_0_001** (19 255,7 млрд KZT / 75,6 %)
- USDKZT_0_002 (4 840,5 млрд KZT / 19,0 %)
- USDKZT_0_01W (32,0 млрд KZT / 0,1 %)
- USDKZT_0_01M (194,2 млрд KZT / 0,8 %)
- RUBKZT_0_001 (166,5 млрд KZT / 0,7 %)
- RUBKZT_0_002 (809,4 млрд KZT / 3,2 %)
- RUBKZT_1_001 (11,2 млрд KZT / 0,04 %)
- EURKZT_0_001 (139,2 млрд KZT / 0,5 %)
- EURKZT_1_001 (30,8 млрд KZT / 0,1 %)

Спасибо за внимание!

-  Kazakhstan Stock Exchange
-  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