



Типовая презентация

На 01 апреля 2023 года



KASE сегодня

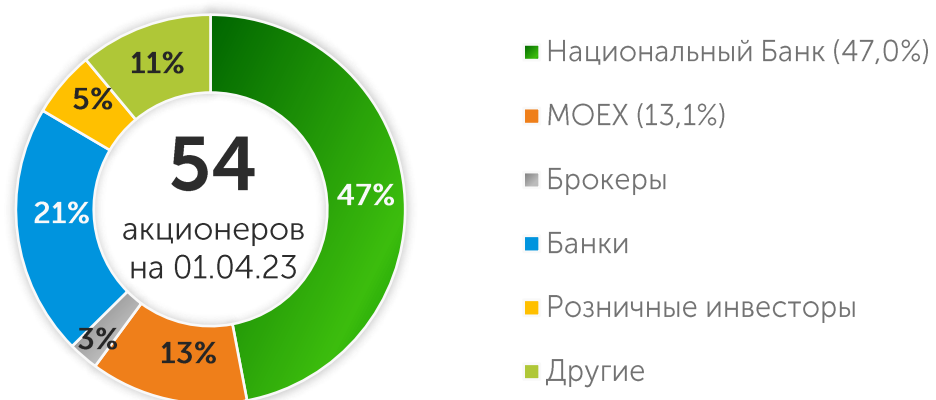


АО "Казахстанская фондовая биржа"

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

Акционеры KASE



Источник: KASE



Услуги KASE



ЛИСТИНГ

- допуск ценных бумаг к публичному обращению
- частное размещение
- создание условий для раскрытия информации



ЧЛЕНСТВО

- фондовый рынок
- валютный рынок
- рынок деривативов



ФИНАНСОВЫЕ ИНСТРУМЕНТЫ

- ценные бумаги
- операции репо: корзина ГЦБ, ОДГУ, ЦБ, входящие в список Т+, КСУ
- своп операции RUB/KZT, USD/KZT, CNY/KZT, EUR/KZT
- валютные пары RUB/KZT, USD/KZT, CNY/KZT, EUR/KZT, EUR/USD
- фьючерсы KASE Index, HSBK, KZAP, USD/KZT, RUB/KZT



ПОСТ-ТОРГОВЫЕ УСЛУГИ

- клиринг
- расчеты
- Центральный контрагент



РЫНОЧНЫЕ ДАННЫЕ

- задержанная торговая информация и в режиме реального времени
- информация об итогах торгов
- архивная, справочная и производная информации
- программный продукт IRIS Finance
- информационный канал в приложении Telegram @KASEInfoBot
- мобильное приложение KASE MOBILE



ТЕХНОЛОГИЧЕСКИЕ РЕШЕНИЯ

- три торговые системы
- расчетная и клиринговая системы
- FIX-шлюзы и FAST-протоколы
- веб-сайт и веб-сервисы

Миссия и цель KASE

KASE – высокотехнологичная торговая площадка, оказывающая **полный спектр биржевых услуг**, доступная для отечественных эмитентов и открытая локальным и международным инвесторам

Миссия

Содействие экономическому росту РК посредством:

- **Обеспечения широкого спектра инструментов для привлечения финансирования** отечественными эмитентами
- **Обеспечения платформы для перераспределения ликвидности** в финансовой системе
- **Предоставления прозрачной инвестиционной среды** для локальных и иностранных инвесторов

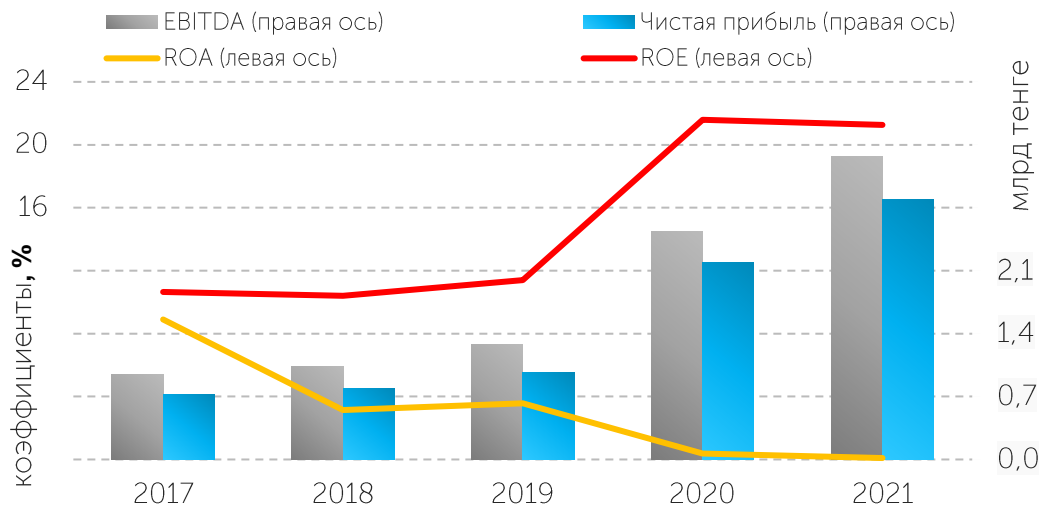
Цель

Достижение и **поддержание статуса ведущей биржевой площадки в регионе** и повышение ценности KASE для стейкхолдеров

Ключевые показатели KASE



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

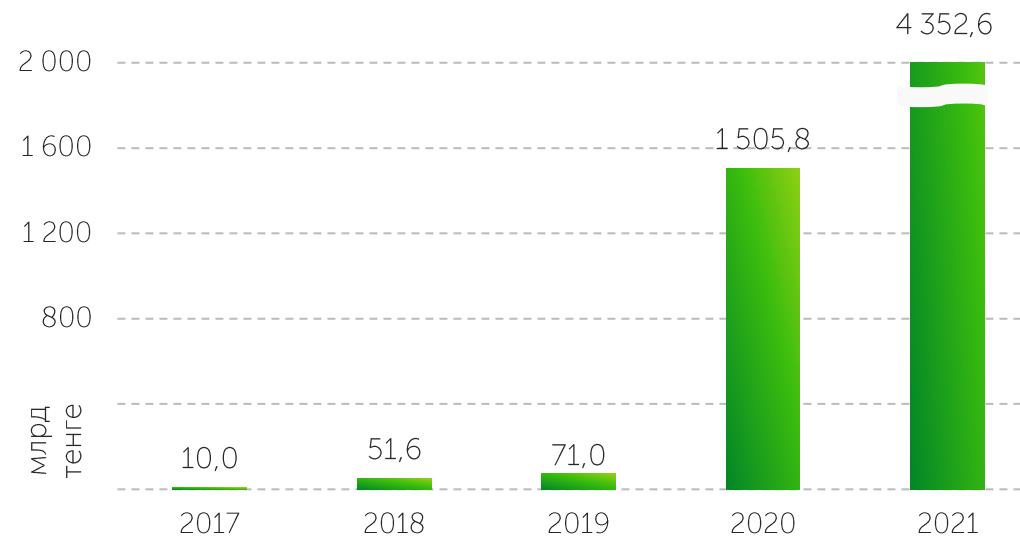
Примечание: ROA, ROE рассчитаны на основании среднегодовых показателей активов и капитала
 Источник: KASE

Акции и капитал KASE

На 01 января 2023 года:

собственный капитал	26 571,0 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	24 711,9 KZT

Активы



Члены KASE



43

Фондовая

33

Валютная

27

Деривативы

52 всего участников рынка, в том числе:

21 банк второго уровня
резиденты РК

22 брокерские компании
резиденты РК

46 локальных участников

4 иностранных участника

2 МФО

12 участников, предоставляющих услуги прямого доступа (DMA)

Новые члены KASE 2022 года:

IV квартал

- Freedom Finance Global PLC/ **фондовая**
- АО "Инвестиционная компания Standard"/ **валютная**

III квартал

- АО "NGDEM Finance" / **деривативы**

II квартал

- АО "ЕвроЦентрАстана" / **фондовая и деривативы**
- АО "UD Capital" / **фондовая и деривативы**

I квартал

- АО "Инвестиционная компания Standard" / **фондовая**
- АО "Дочерняя организация Народного Банка Казахстана "Halyk Finance" / **валютная**

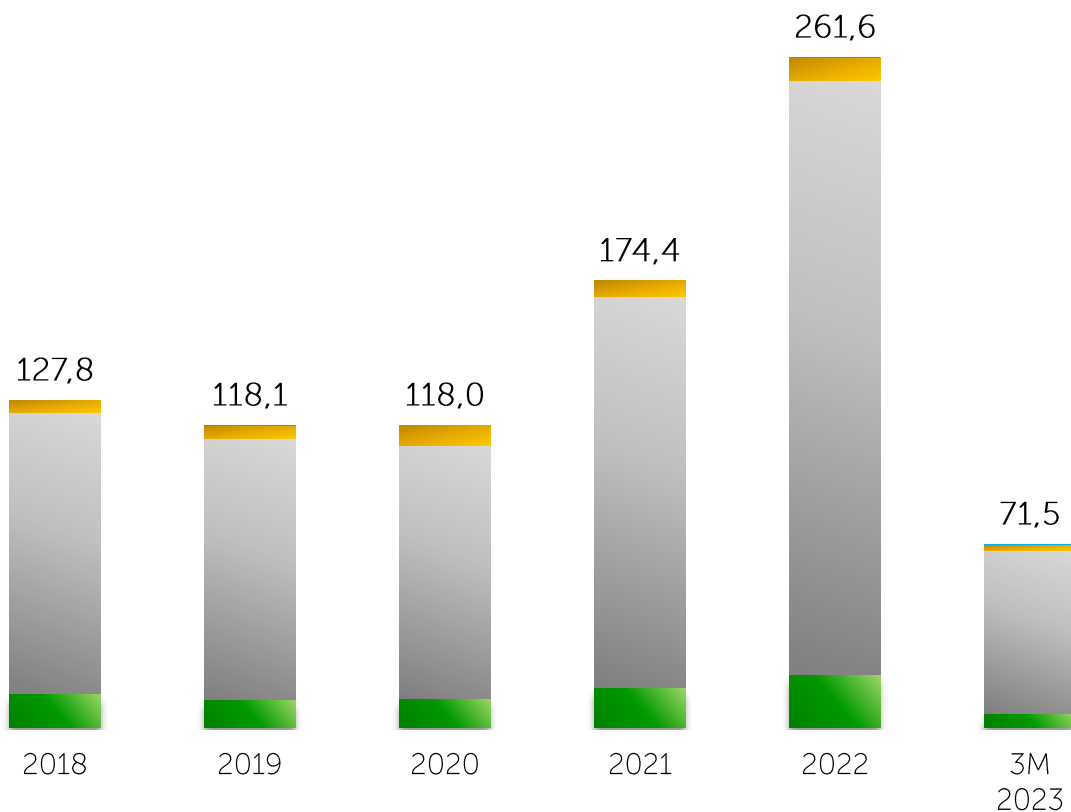
Показатели биржевого рынка за три месяца 2023 года

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	2 108,4	4 635,5	2 993	35 735,1	11,9
Акции	62,9	138,5	2 541	1 066,8	0,4
KASE Global	5,5	11,9	241	92,4	0,4
Корпоративные долговые ЦБ	466,8	1 031,1	136	7 911,6	58,3
ГЦБ	1 446,8	3 174,6	17	24 522,5	1 457,0
Облигации МФО	124,6	275,5	2	2 112,3	916,4
ЦБ инвестиционных фондов	1,4	3,1	47	23,7	0,5
Производные ценные бумаги	0,3	0,7	9	5,7	0,6
Рынок иностранных валют	5 612,6	12 356,5	415	95 128,3	229,3
Рынок денег	63 759,9	140 240,9	1 254	1 080 677,1	862,1
Операций репо	51 651,1	113 582,5	1 229	875 441,8	712,3
Операций валютного свопа	12 108,9	52 532,7	25	205 235,3	8 356,7
Деривативы	19,1	41,6	<1	323,9	2 123,2
Итого	71 500,0	157 274,5	4 662	1 211 864,3	260,0

Объем и структура рынка

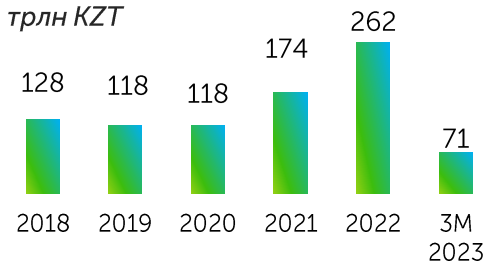


Динамика объема торгов по секторам, трлн KZT



Источник: KASE

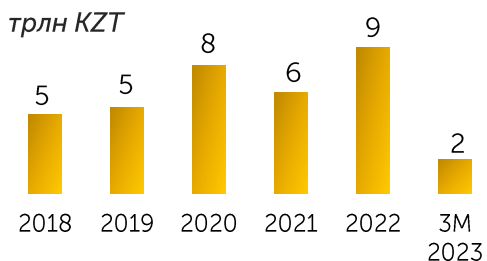
трлн KZT



Всего объем торгов

2022	+50%
2021	+80%
2020	+17%
2019	-62%
2018	x2

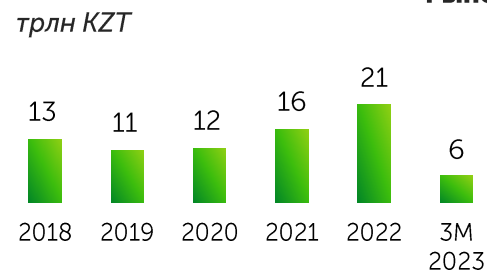
трлн KZT



Рынок ценных бумаг

2022	+44%
2021	-26%
2020	-1%
2019	+18%
2018	x2

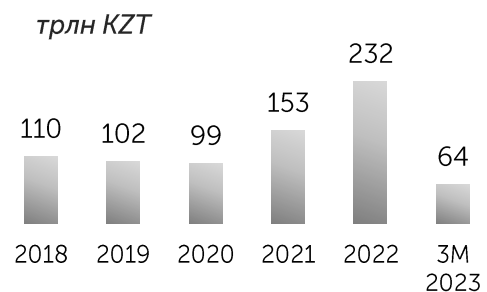
трлн KZT



Рынок иностранных валют

2022	+34%
2021	+34%
2020	+4%
2019	-17%
2018	+9%

трлн KZT



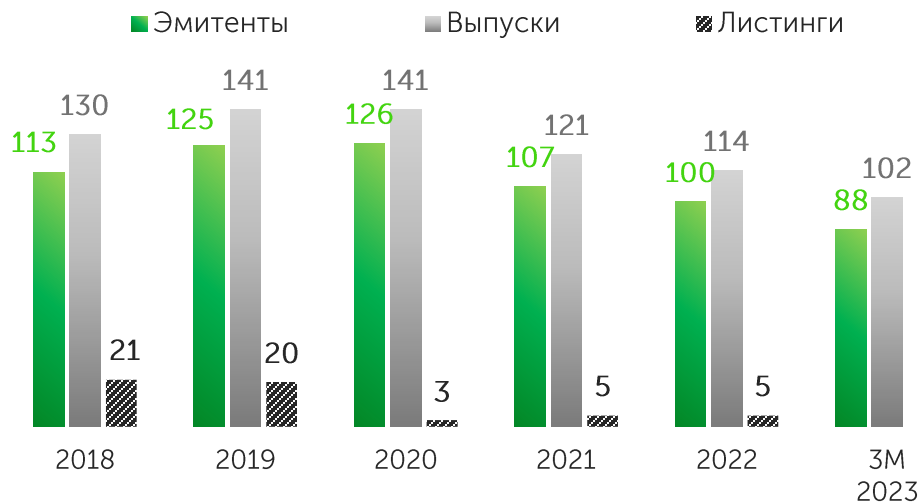
Рынок денег

2022	+52%
2021	+55%
2020	+3%
2019	-7%
2018	-19%

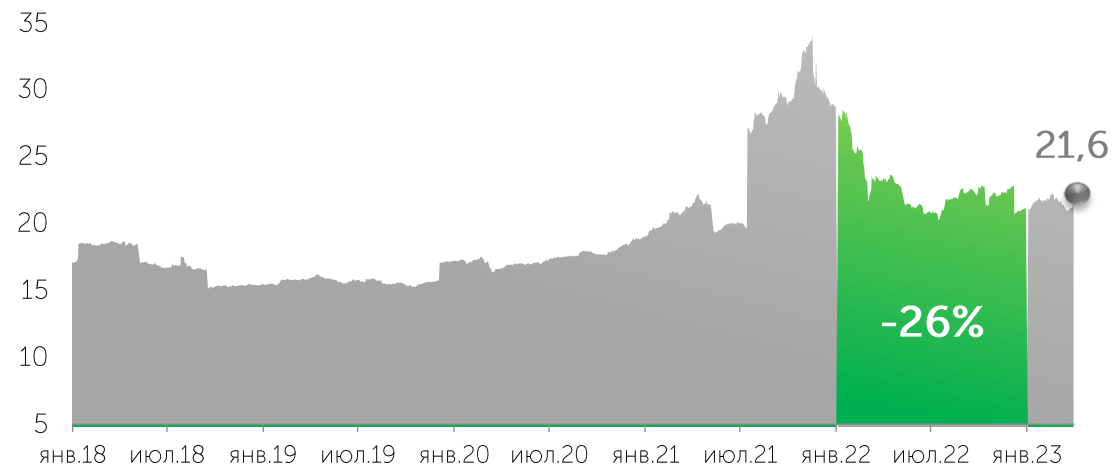
Рынок акций



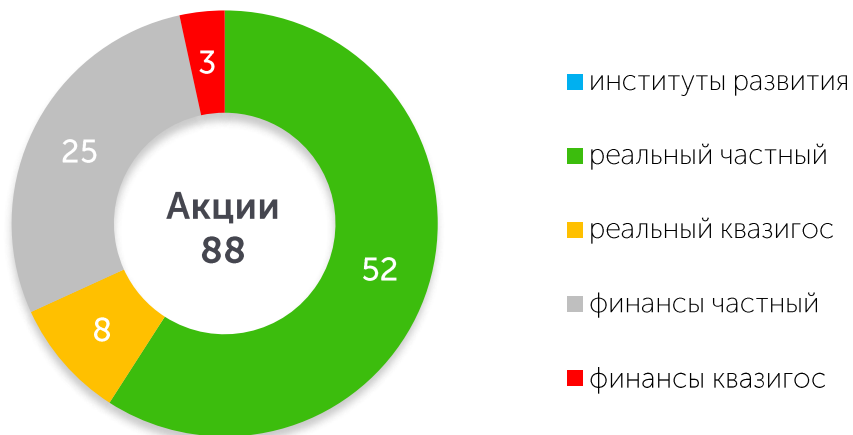
Новые листинги



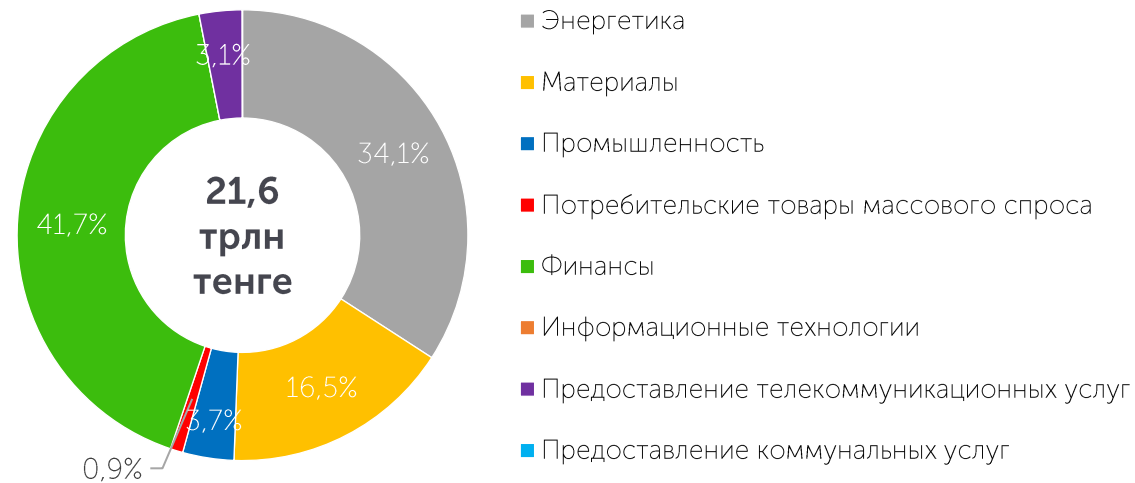
Капитализация рынка акций, трлн KZT



Структура листинговых компаний по сферам деятельности

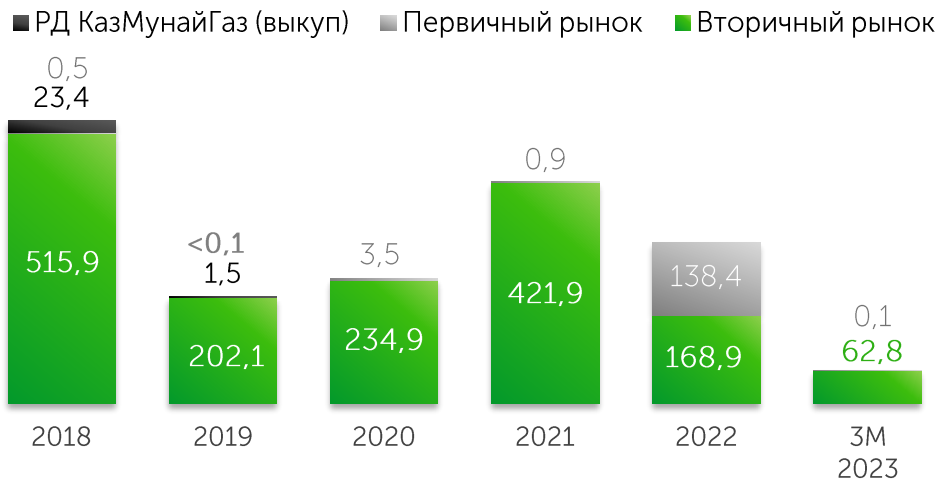


Отраслевая структура списков акций*

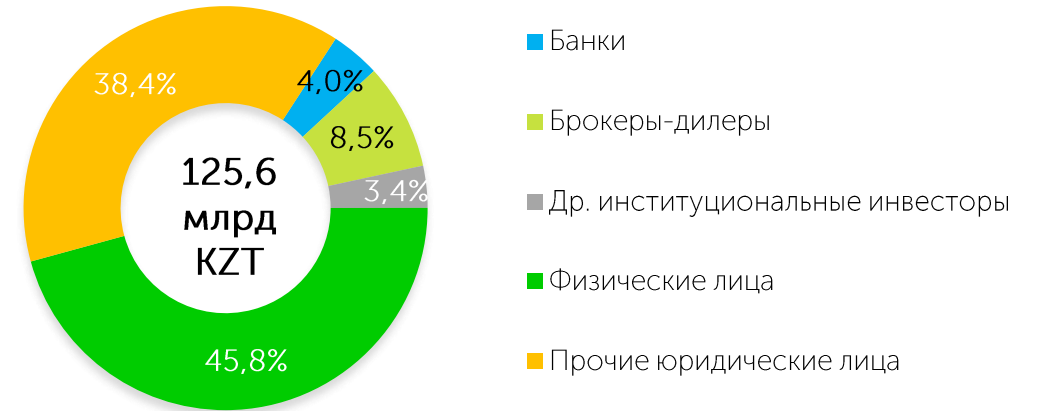


Рынок акций

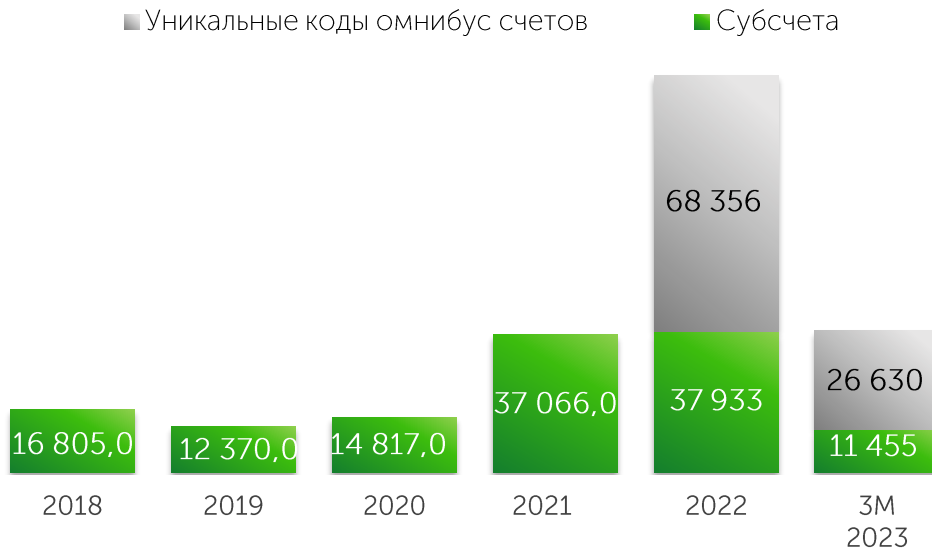
Объем сделок, млрд KZT



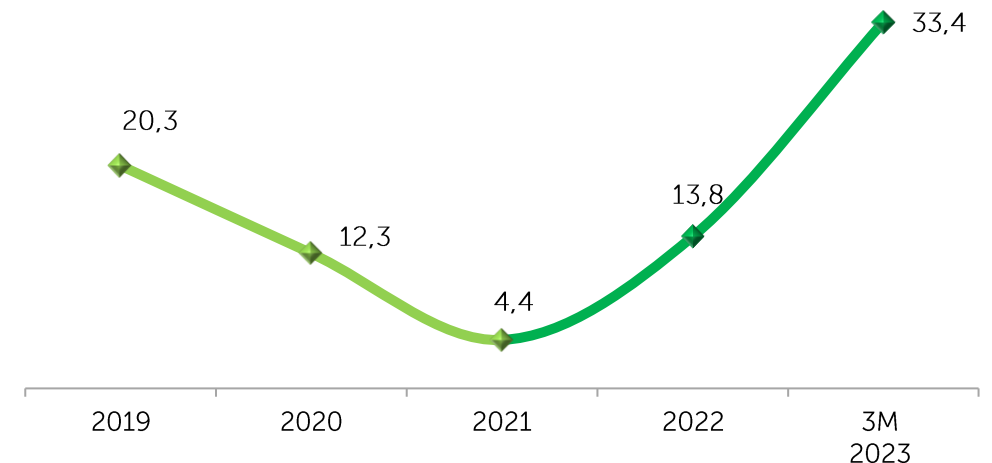
Доли основных категорий инвесторов на вторичном рынке за 3М 2023 года*



Динамика активных розничных инвесторов



Доля нерезидентов в брутто-обороте*, %

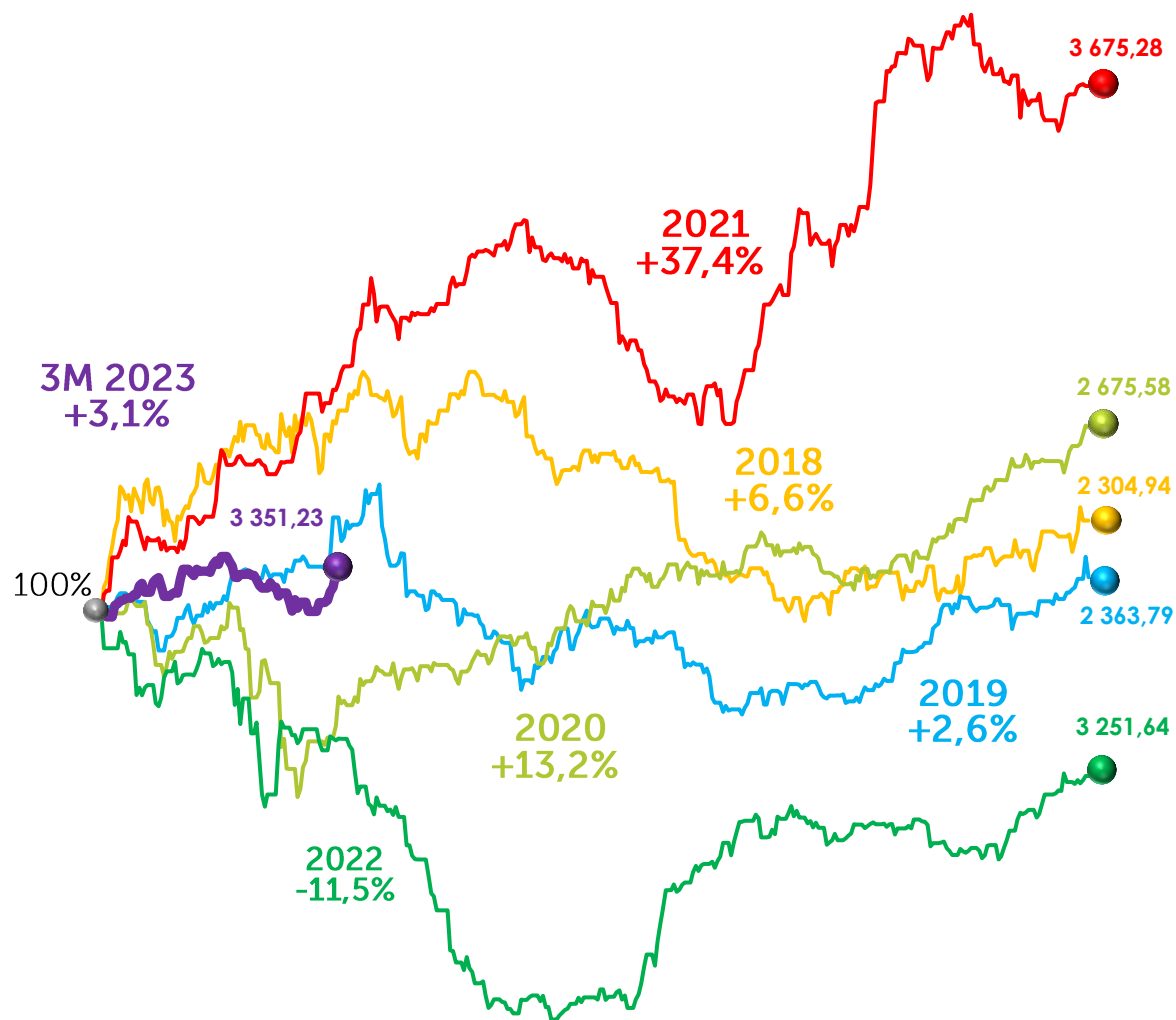


* от общего брутто-оборота торгов акциями без учета крупных сделок

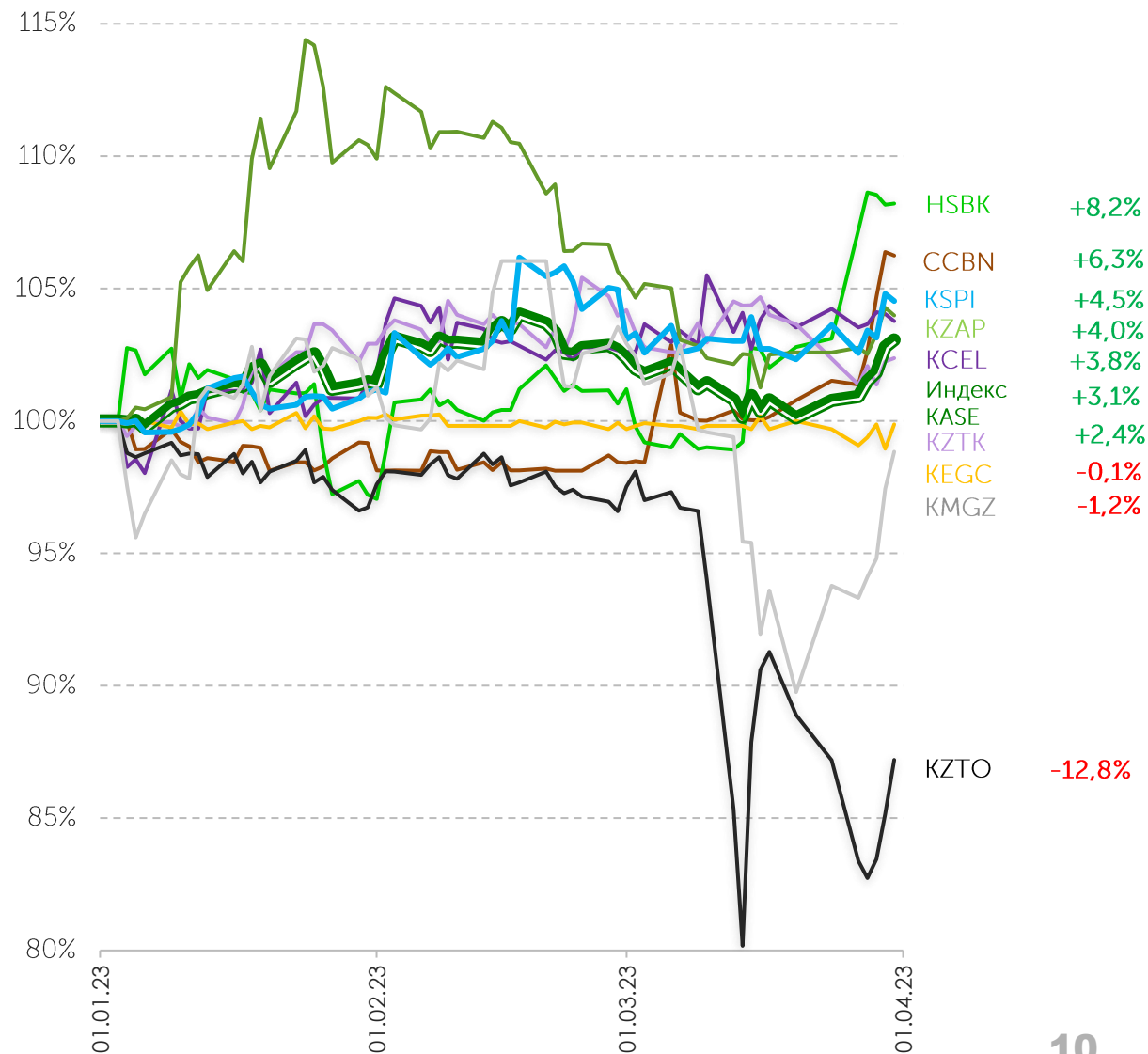
Динамика Индекса KASE



Индекс KASE в 2018 – 3М 2023

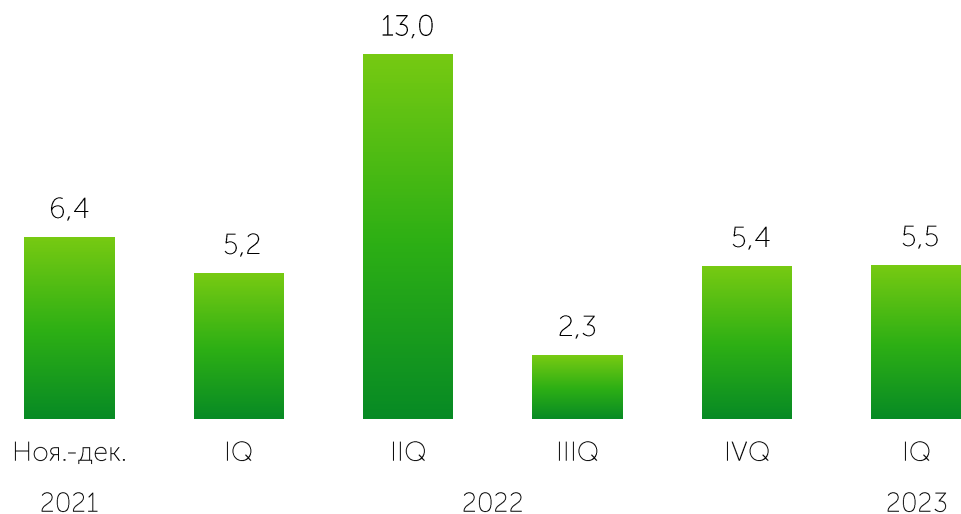


Динамика составляющих Индекса KASE



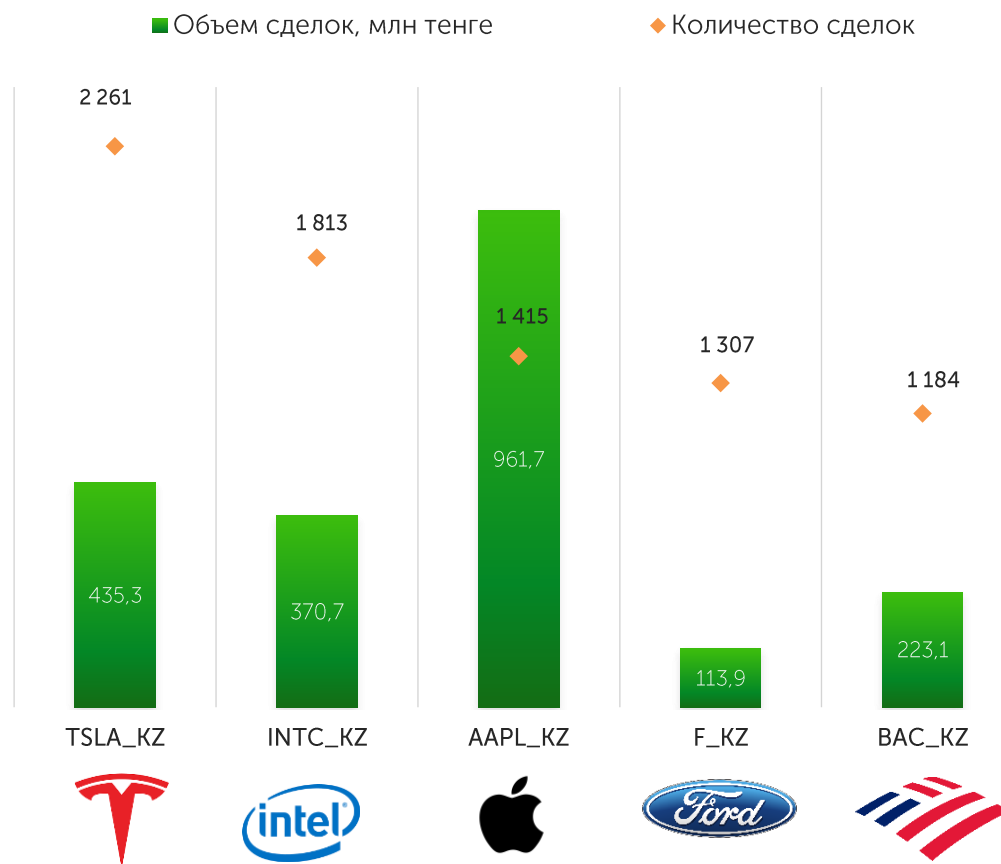
Источник: KASE, Bloomberg

Объем сделок, млрд KZT

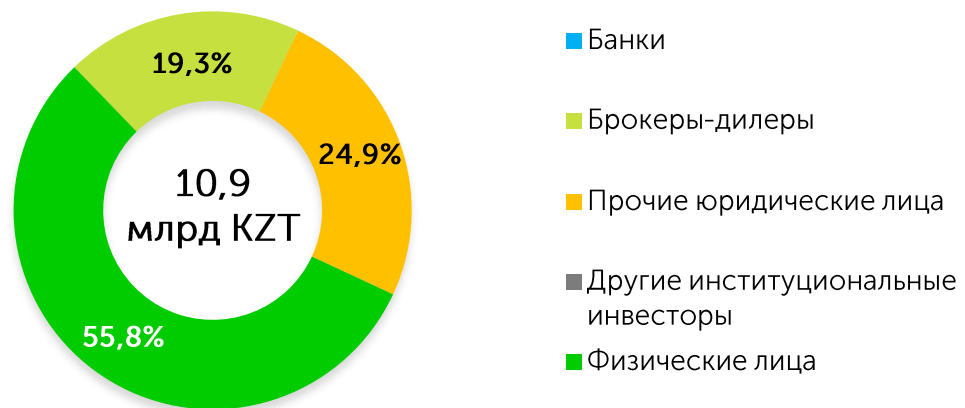


На **01 апреля 2023 года** в официальном списке KASE находятся **44 акций и 12 ETF** в секторе KASE Global

Топ-5 наиболее популярных акций сектора KASE Global по итогам 3М 2023 года



Доли основных категорий инвесторов за 3М 2023 год*

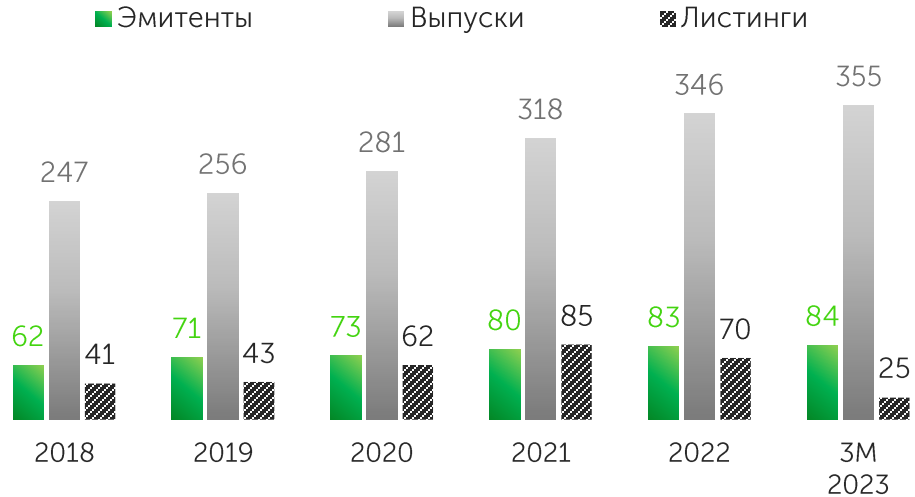


* от общего брутто-оборота торгов в секторе KASE Global без учета крупных сделок

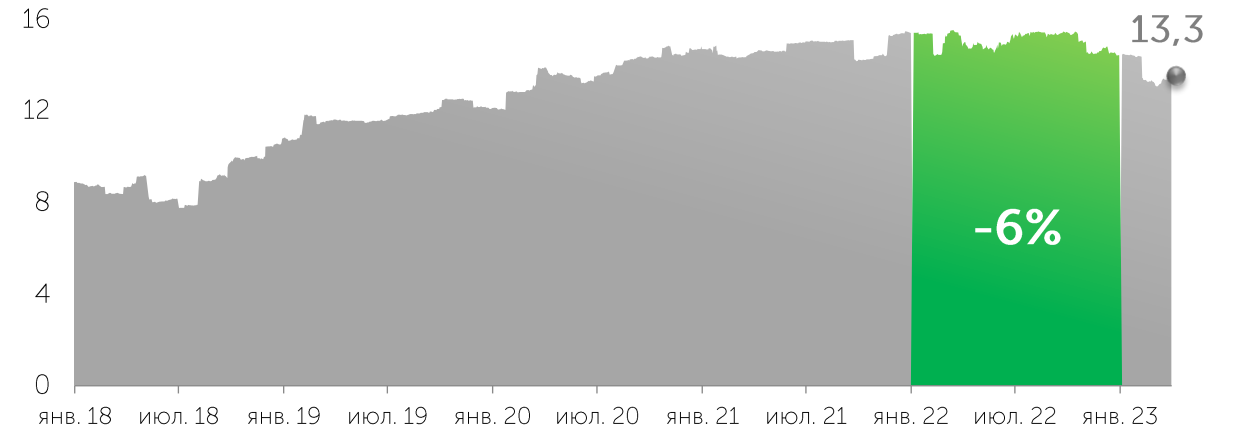
Источник: KASE

Рынок корпоративных облигаций

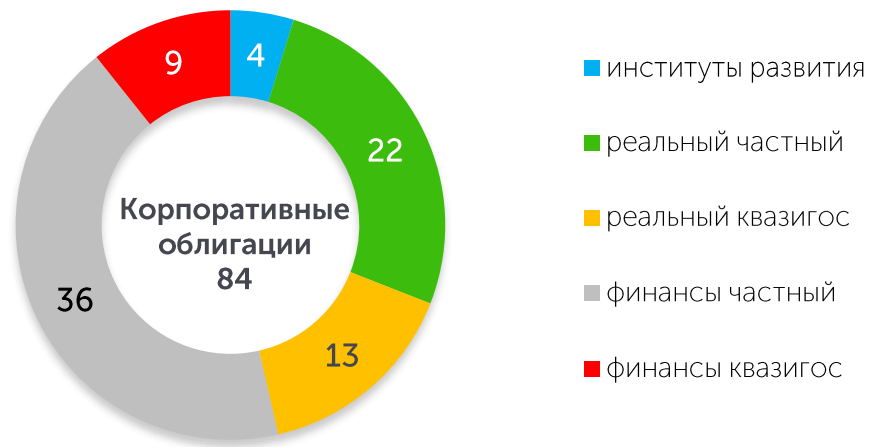
Новые листинги



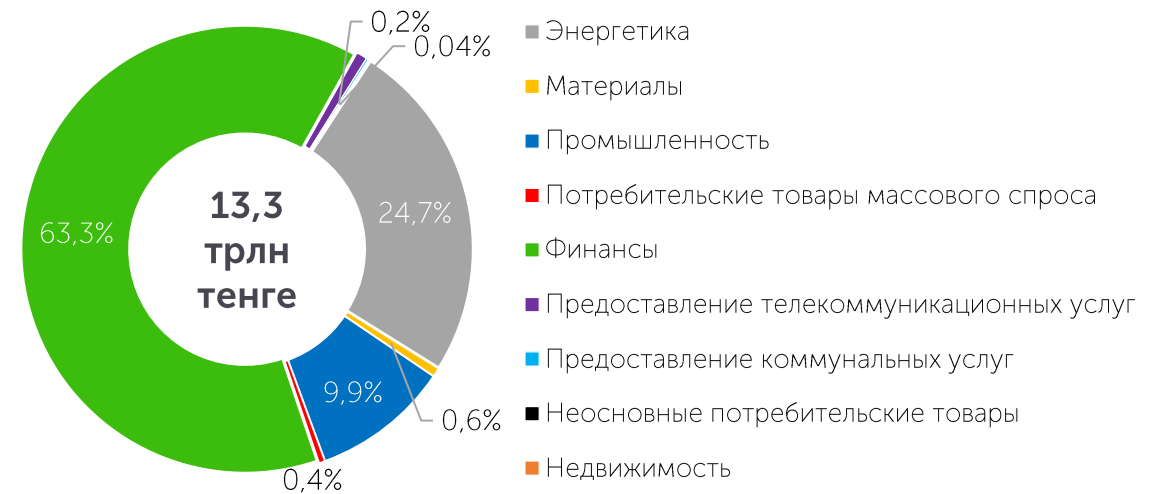
Объем корпоративного долга в обращении, трлн KZT



Структура листинговых компаний по сферам деятельности

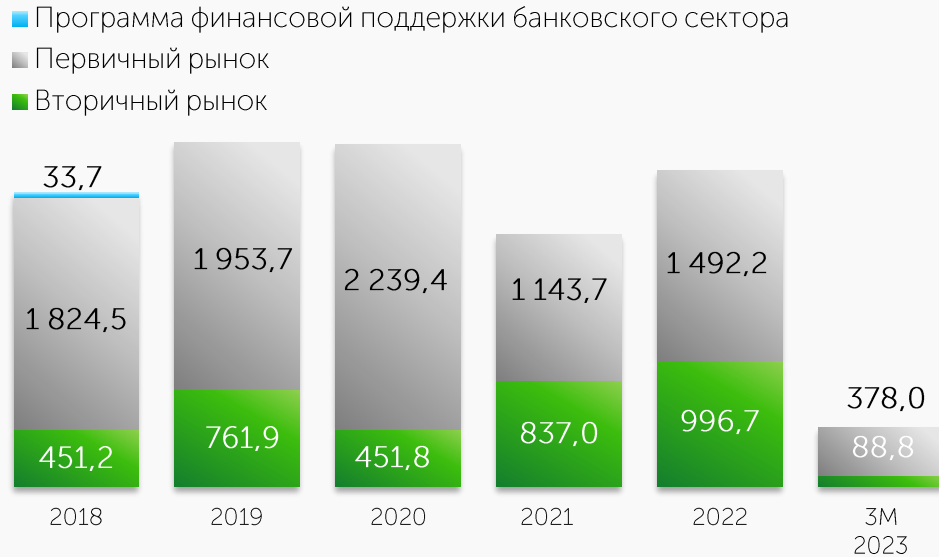


Отраслевая структура списков облигаций

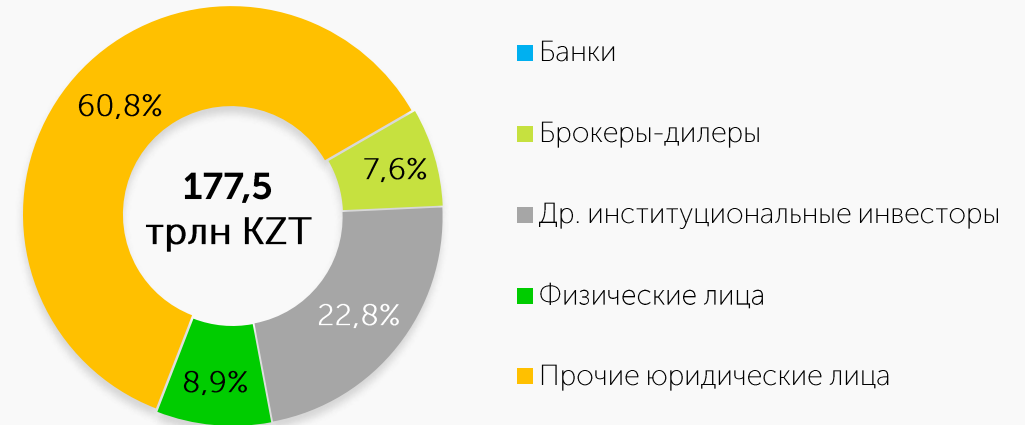


Рынок корпоративных облигаций

Объем сделок, млрд KZT

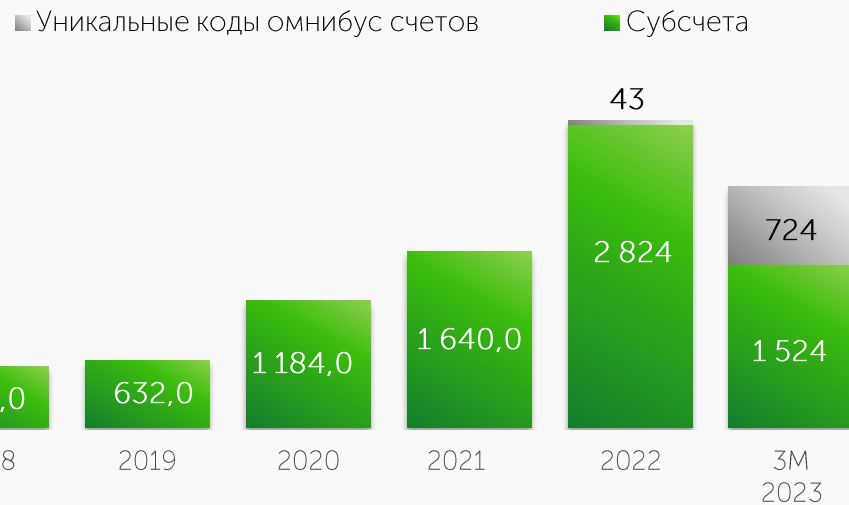


Доли основных категорий инвесторов на вторичном рынке 3М 2023 год*

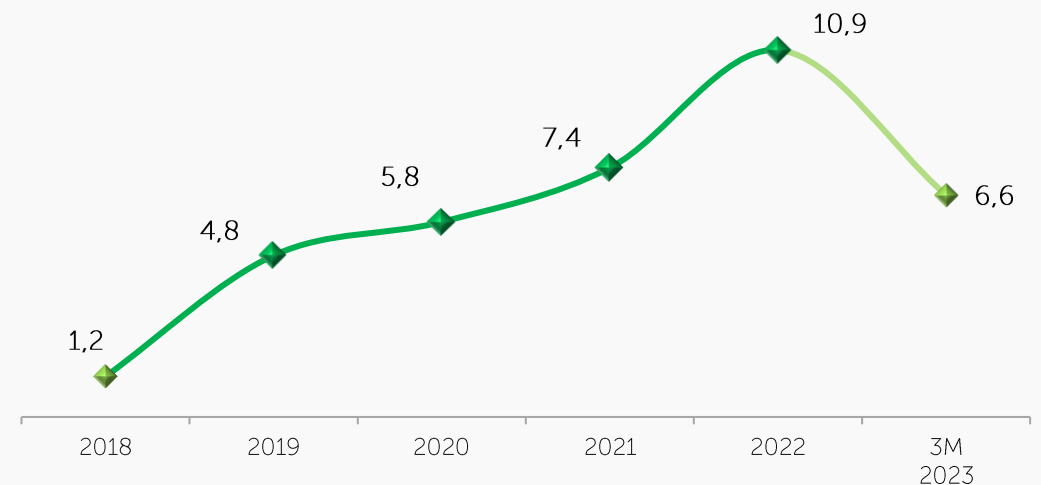


* от общего брутто-оборота торгов корпоративными облигациями на вторичном рынке

Динамика активных розничных инвесторов



Доля нерезидентов в брутто-обороте, %



Первичный рынок корпоративных облигаций

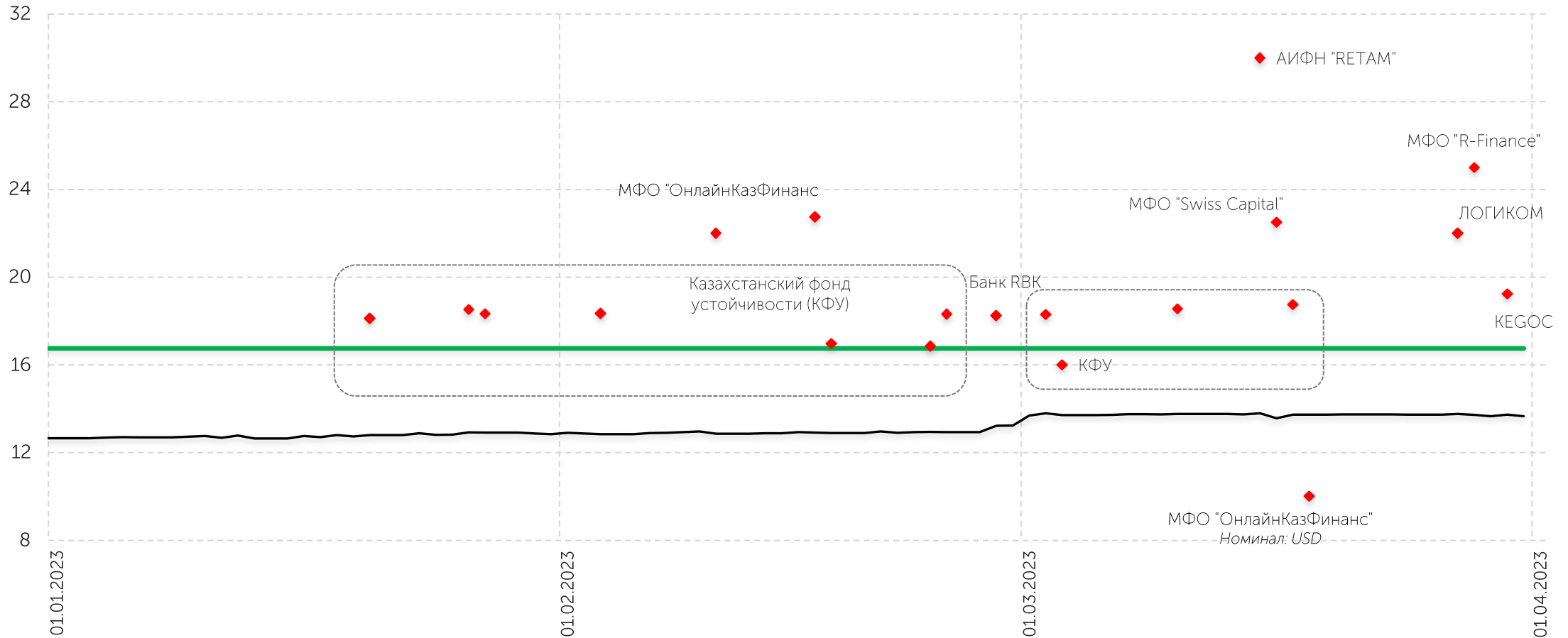
Рыночные размещения за 3М 2023

— Базовая ставка

— KASE_BMY

◆ Доходность, % годовых

от 10,0% до 30,0% годовых





Размещения корпоративных облигаций за 3М 2023 года



АО "Казахстанский фонд устойчивости"

6 выпусков

Срок

1,0-7,0 года

Объем:

125,1 млрд KZT

Доходность к погашению:

16,00-18,76 % годовых



АО "KEGOC"

Срок

14,7 лет

Объем:

16,9 млрд KZT

Доходность к погашению:

19,51% годовых



АО "Банк "Bank RBK"

2 выпуска

Срок

9,6-9,8 года

Объем:

20,0 млрд KZT

Доходность к погашению:

18,25 % годовых



Банк развития
Казахстана

АО "Банк Развития
Казахстана"

2 выпуска

Срок

3,0-12,0 лет

Объем:

25,0 млрд KZT

Доходность к погашению:

0,50 % годовых /

2,0%+TONIA



АО "МФО
ОнлайнКазФинанс"

3 выпуска

Срок

1,0-1,7 года

Объем:

11,2 млрд KZT

Доходность к погашению:

22,00-22,75% /

10,00% (в USD) годовых



Микрофинансовая
организация "R-Finance"

Срок

3,0 года

Объем:

300,0 млн KZT

Доходность к погашению:

25,00 % годовых



ЛОГИКОМ

Срок

5 лет

Объем:

5,0 млрд KZT

Доходность к погашению:

22,00% годовых



RETAM

"АИФН "RETAM"

Срок

7,0 лет

Объем:

6,5 млрд KZT

Доходность к погашению:

30,00 % годовых



ТОО "МФО "Swiss Capital
(Свисс Капитал)"

Срок

1,6 лет

Объем:

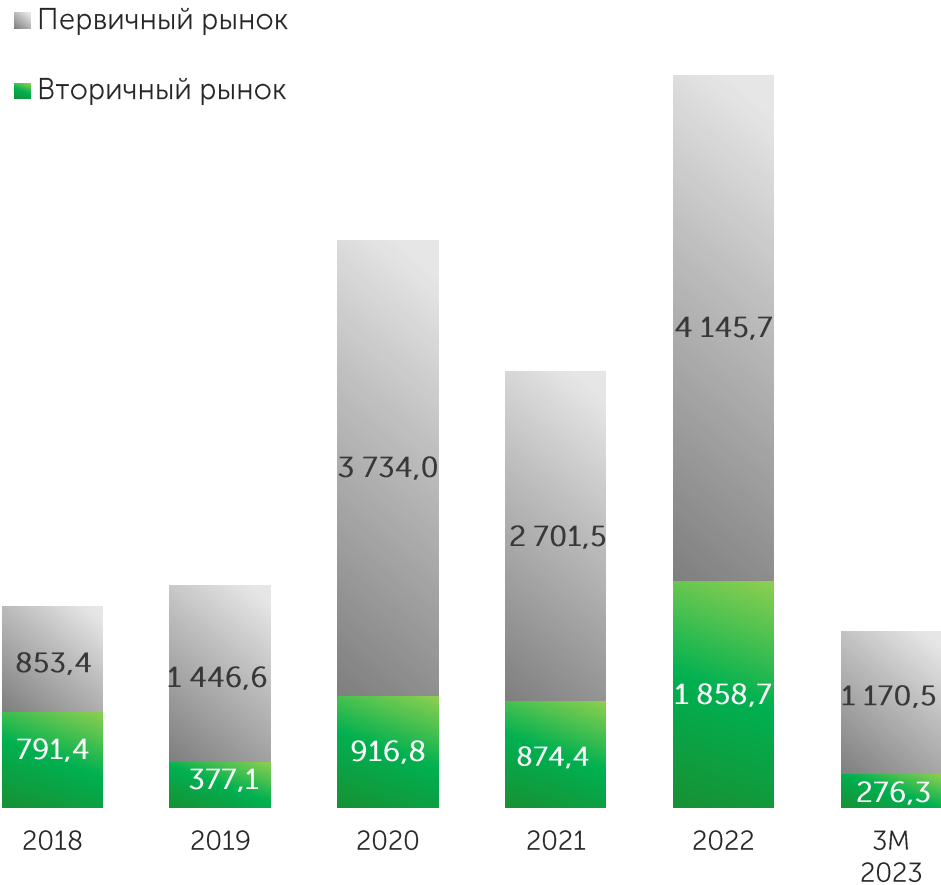
1,0 млрд KZT

Доходность к погашению:

22,50 % годовых

Рынок ГЦБ

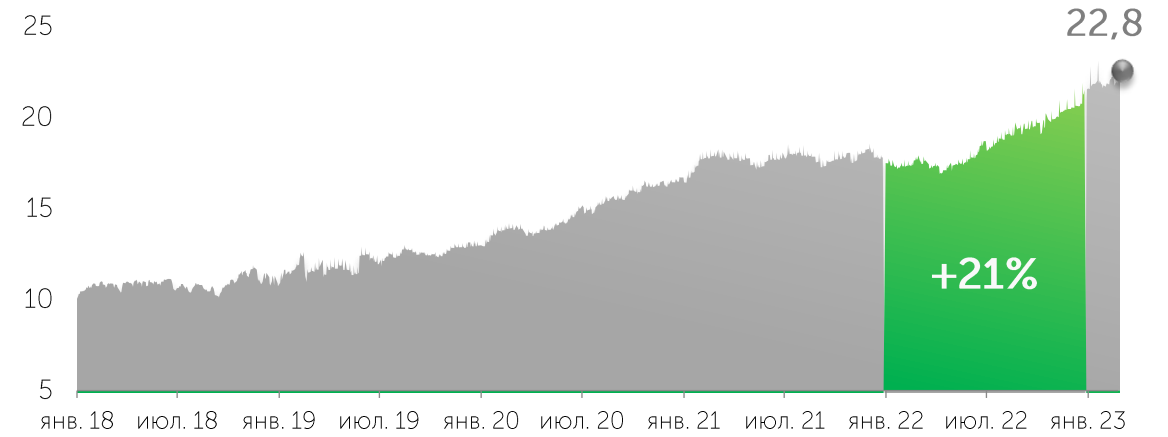
Объем сделок, млрд KZT



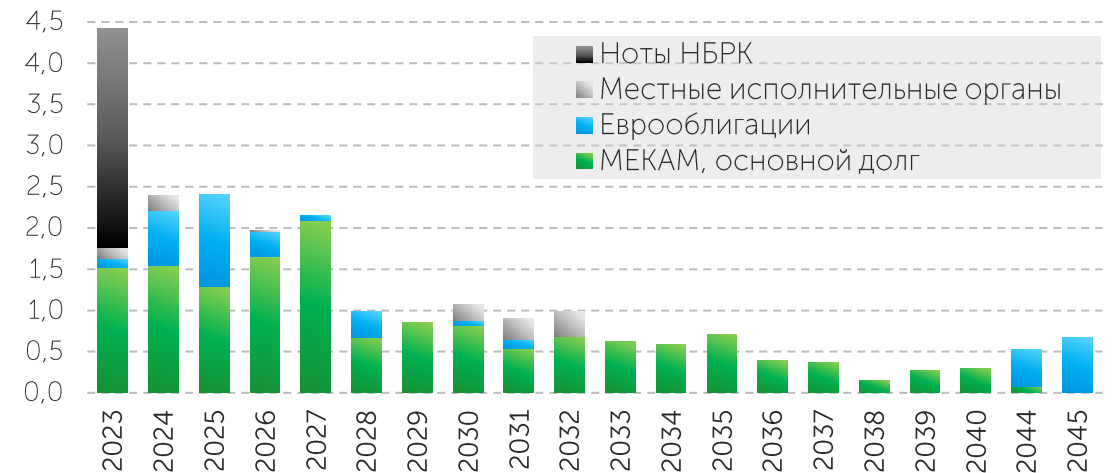
Более подробно с рынком ГЦБ можно ознакомиться в документе [Обзор рынка ГЦБ](#)

Источник: KASE

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



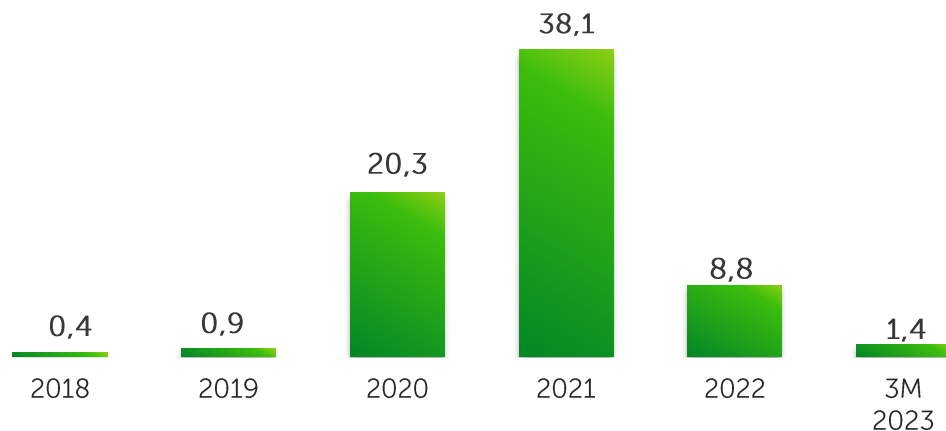
Динамика выплат по госдолгу, трлн KZT



Ценные бумаги инвестиционных фондов

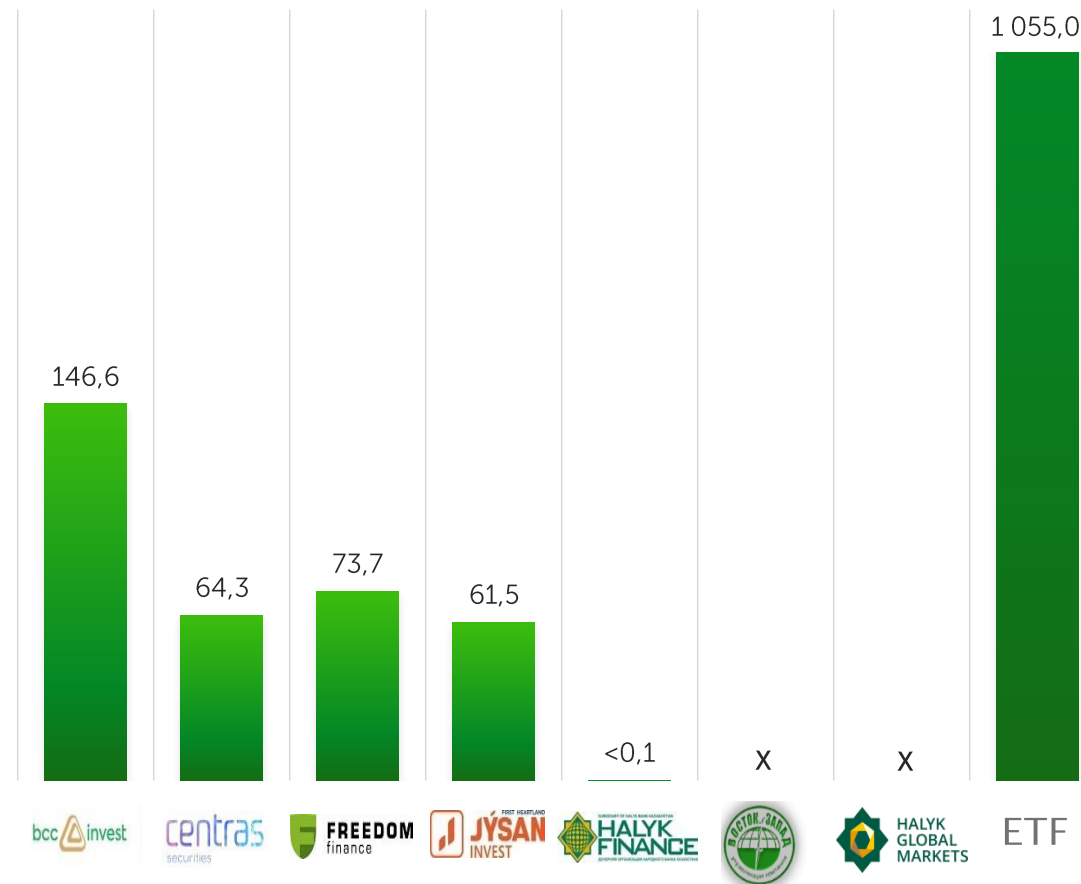


Объем сделок, млрд KZT

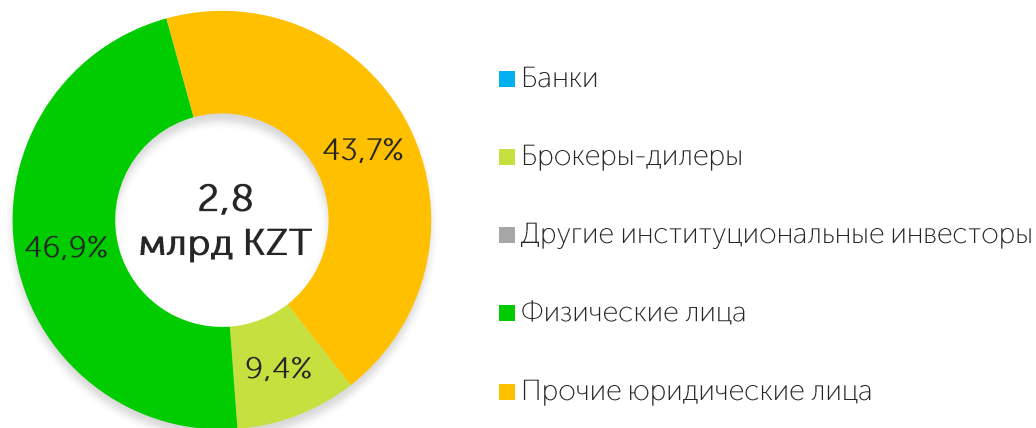


На 01 апреля 2023 в официальном списке KASE находится 18 инструментов 5 управляющих организаций и 6 ETF

Объем торгов в разбивке по инструментам за 3М 2023 года, млн KZT



Доли основных категорий инвесторов за 3М 2023 года*

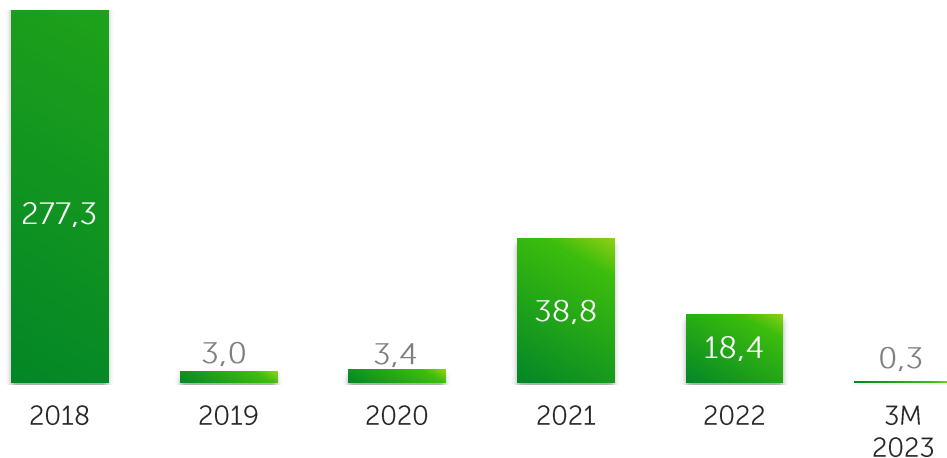


*от общего брутто-оборота торгов ценными бумагами инвестиционных фондов

Источник: KASE

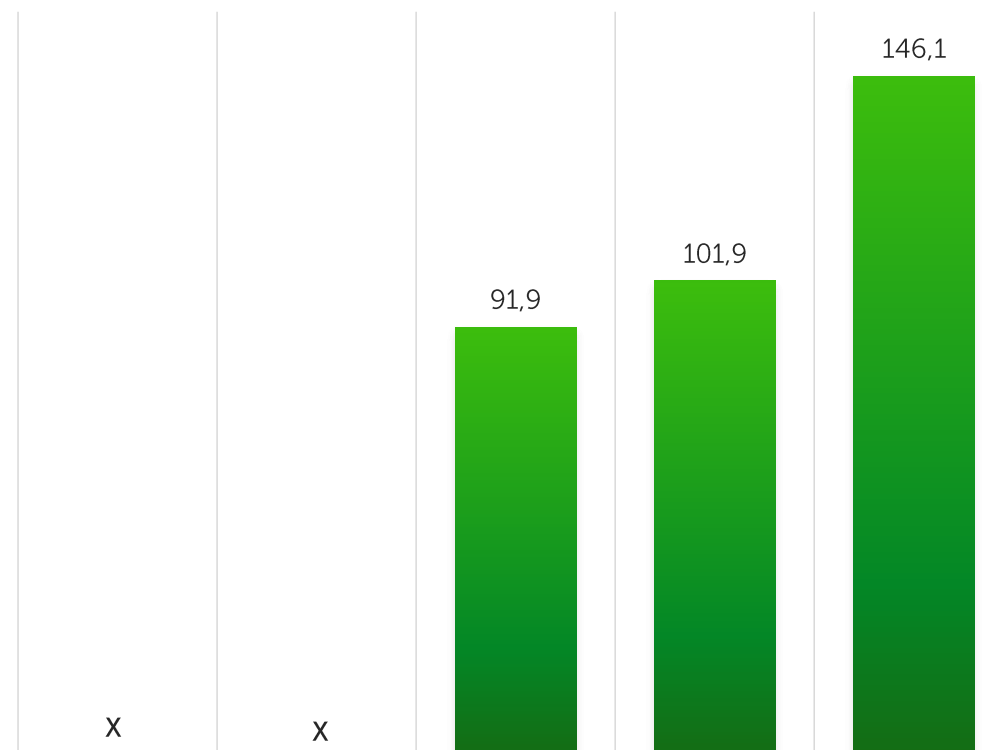
Производные ценные бумаги

Объем сделок, млрд KZT

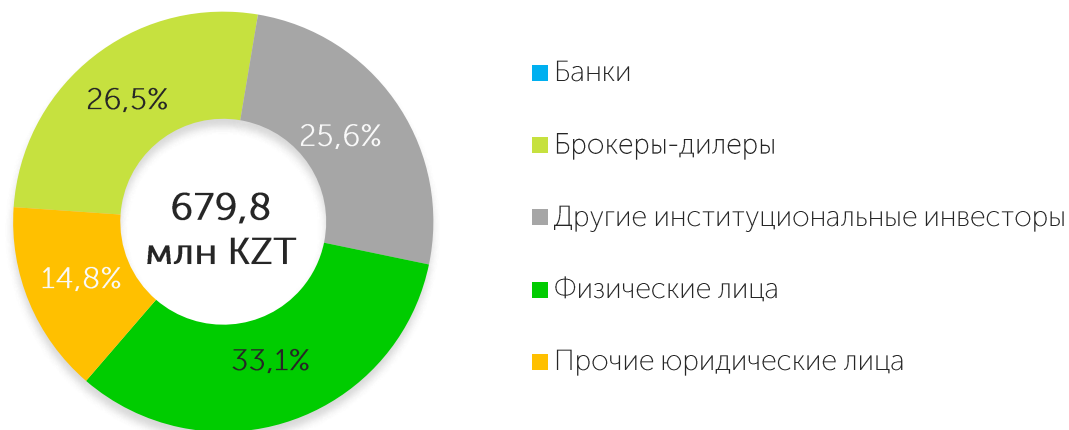


На 01 апреля 2023 в официальном списке KASE находятся 5 глобальных депозитарных расписок

Объем торгов в разбивке по инструментам за 3М 2023 года, млн KZT



Доли основных категорий инвесторов за 3М 2023 года*

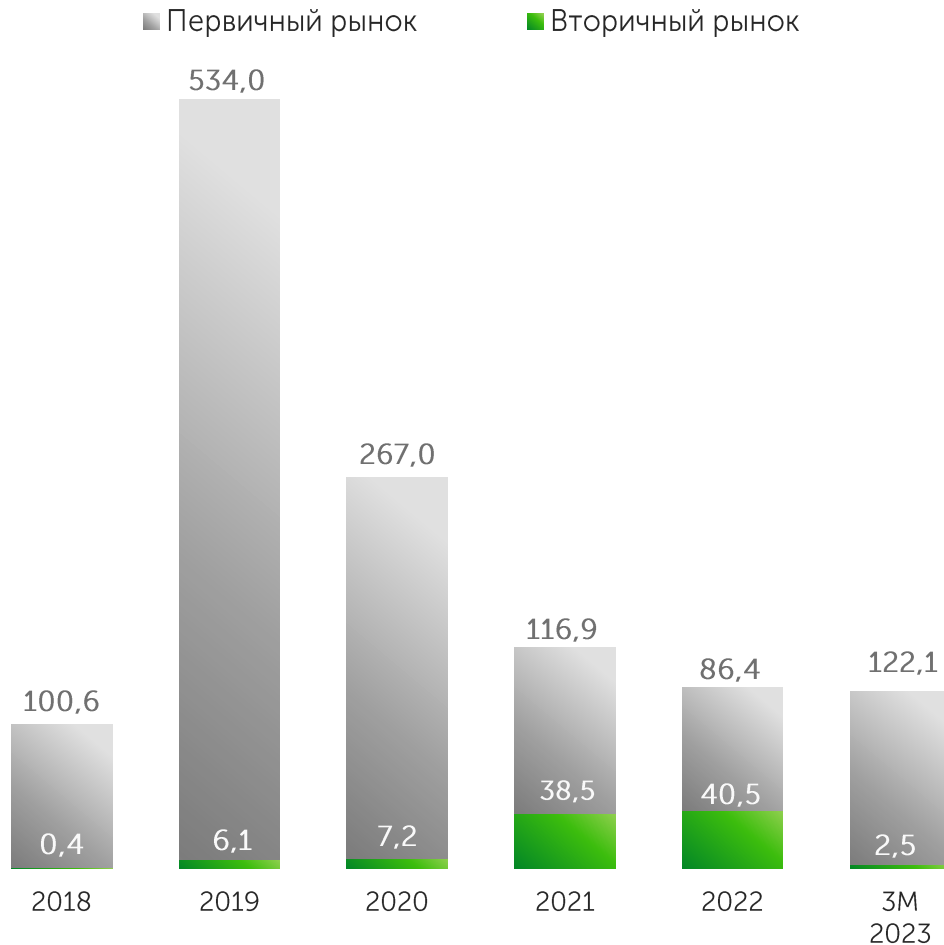


*от общего брутто-оборота торгов производными ценными бумагами

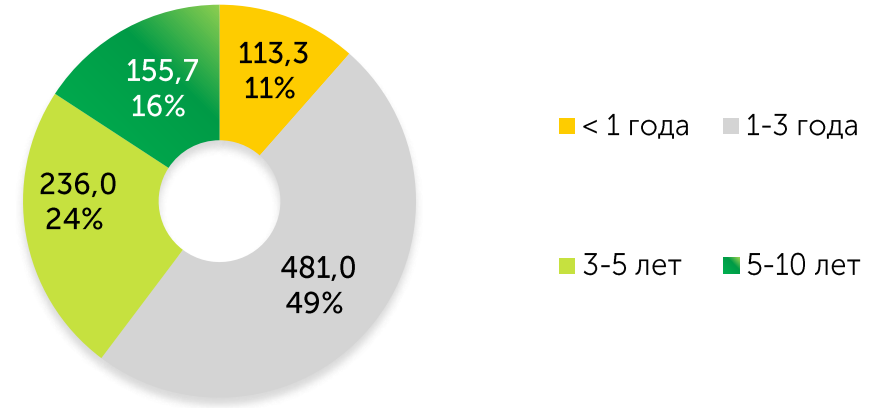
Облигации МФО

На 01 апреля 2023 года в официальном списке KASE находятся 51 выпуск облигаций 4 организаций

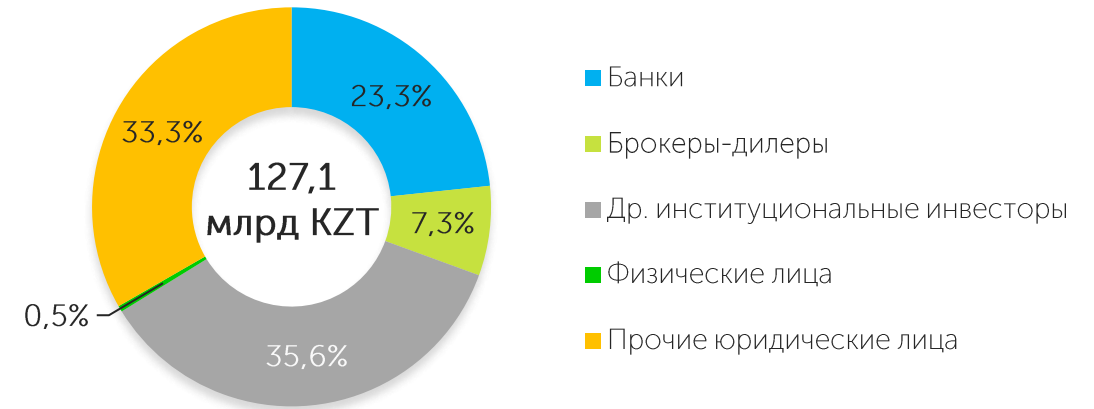
Объемы торгов, млрд KZT



Структура долга облигаций МФО в обращении по срокам до погашения (по номинальной стоимости)



Доли основных категорий инвесторов за 3М 2023 года*

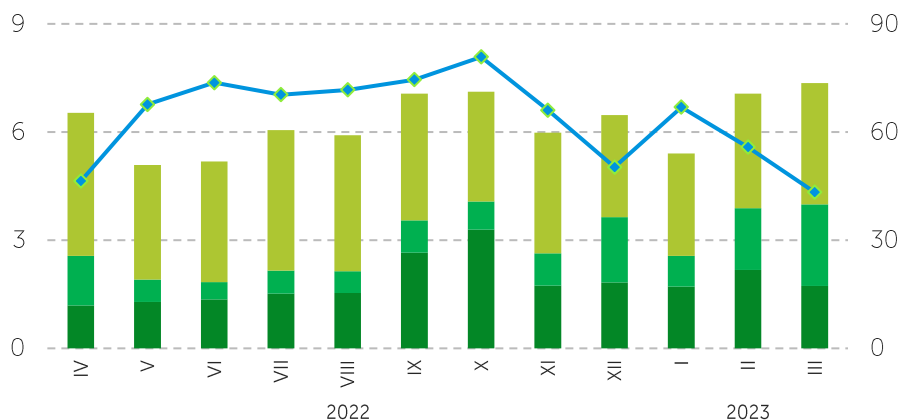


* от общего брутто-оборота торгов облигациями МФО, из расчета исключена позиция инициатора специализированных торгов

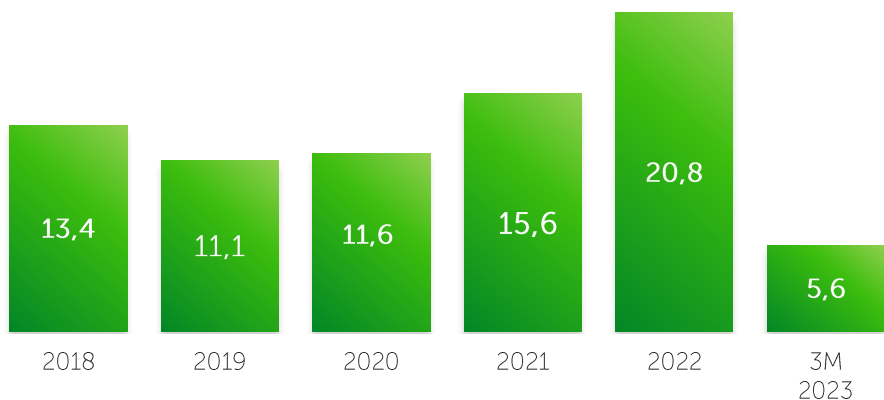
Иностраннные валюты

Соотношение биржевых и внебиржевых валютных операций

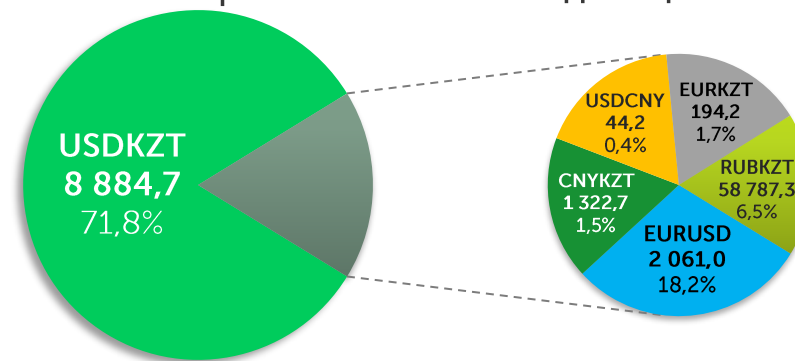
- Внебиржевые операции между банками-резидентами РК и банками-нерезидентами РК
- Внебиржевые операции между банками-резидентами РК
- Операции на спот-рынке KASE
- Доля операций на спот-рынке KASE в общем объеме валютных операций по покупке между банками-резидентами РК



Объем торгов на спот-рынке, трлн KZT

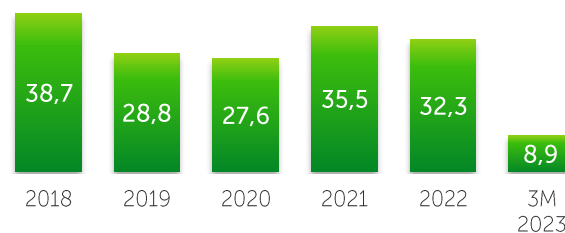


Структура биржевого рынка за 3М 2023 года в объеме торгов. Объем в млн единиц валюты

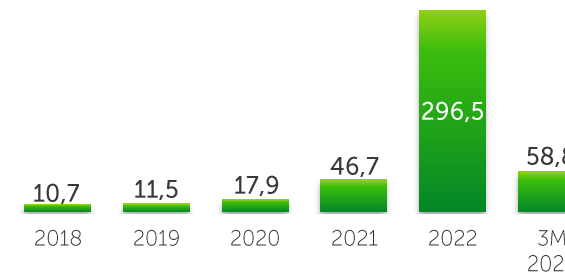


Примечание: доли рассчитаны от объема торгов в KZT

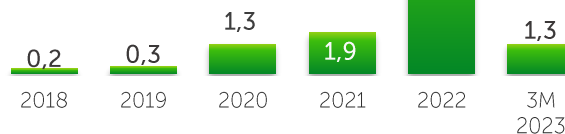
Объем торгов, млрд USD



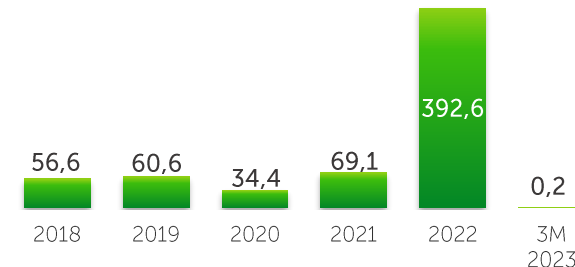
Объем торгов, млрд RUB



Объем торгов, млрд CNY

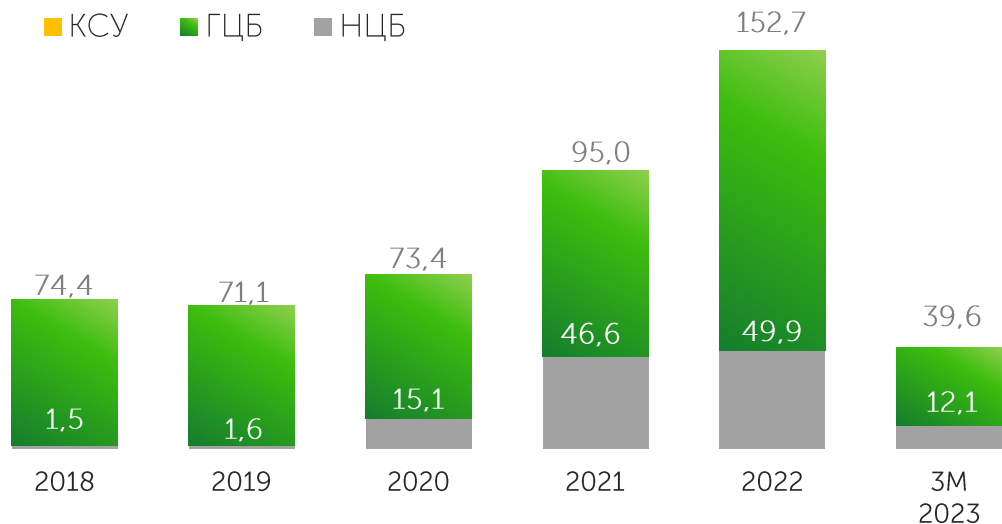


Объем торгов, млн EUR

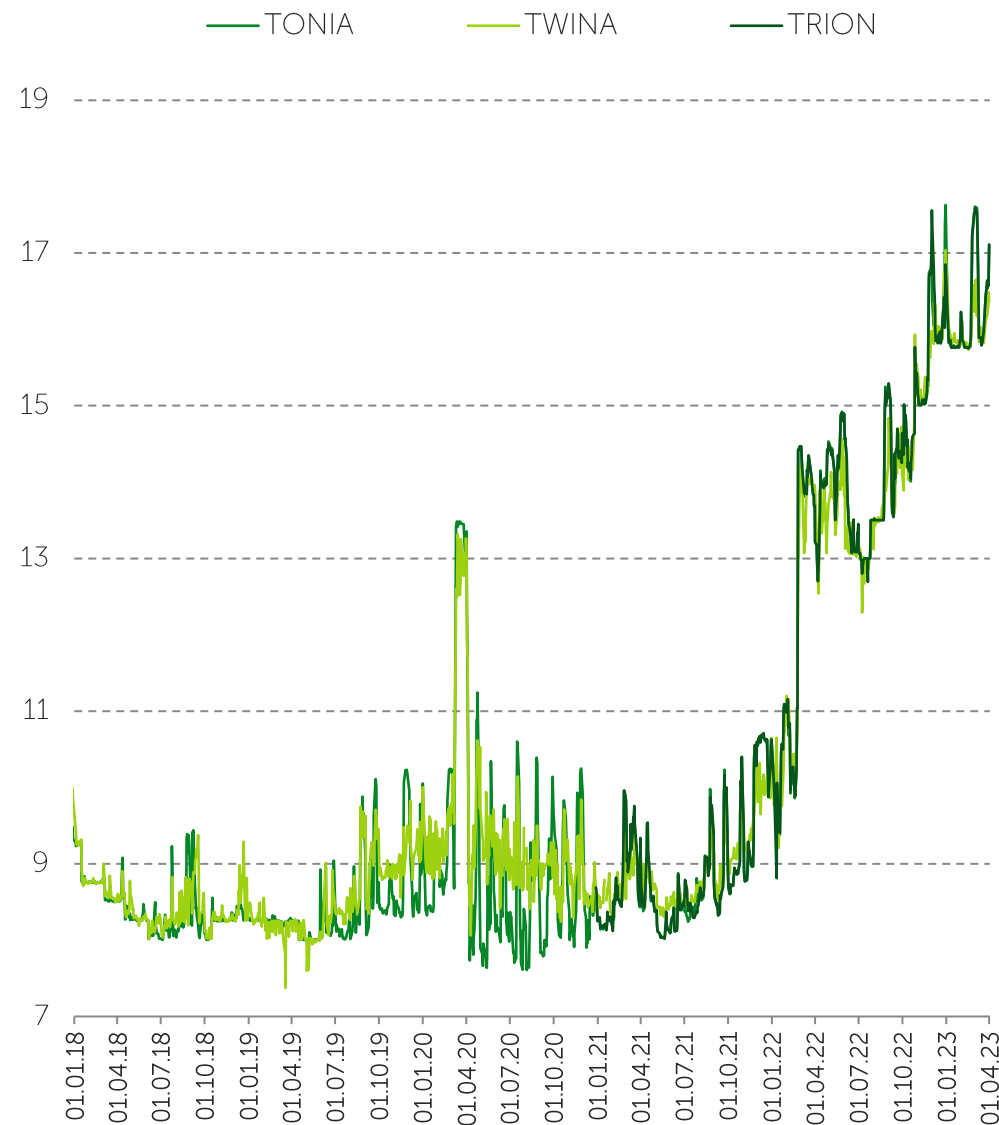


Рынок операций репо

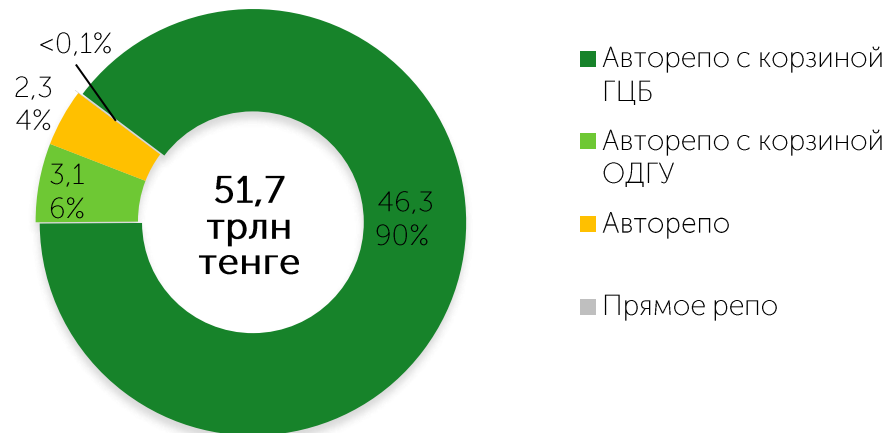
Объем торгов, трлн KZT



Индикаторы репо, % годовых

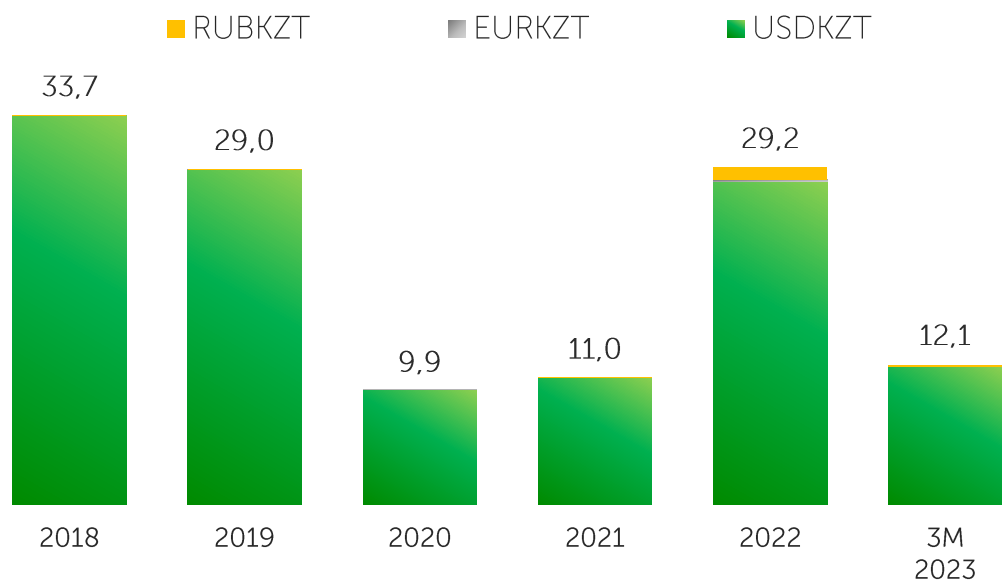


Инструменты рынка репо, трлн KZT

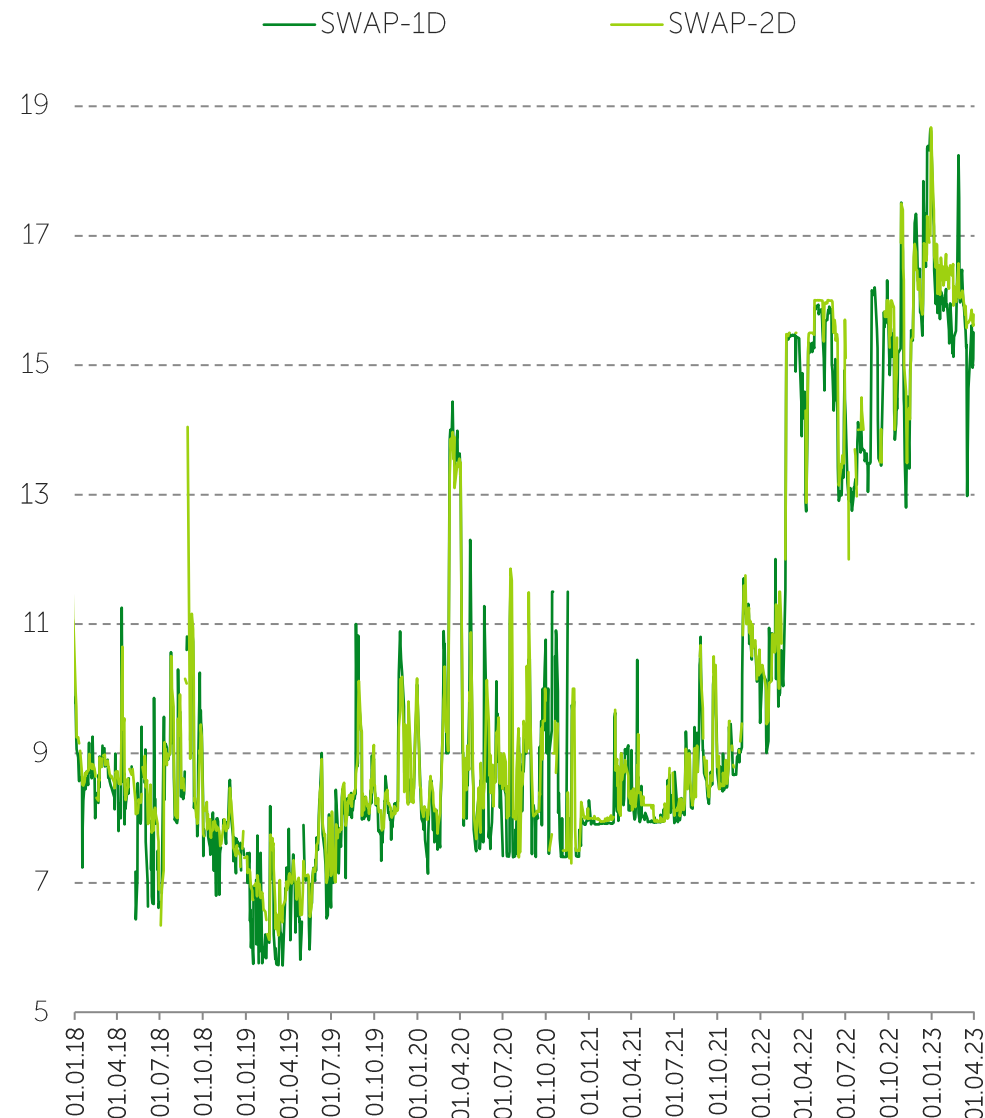


Рынок операций валютного свопа

Объем торгов, трлн KZT



Индикаторы своп-рынка, % годовых



Инструменты рынка операций валютного свопа
(объем за 3М 2023/ доля):

		Объем, млрд тенге	Доля
USDKZT	USDKZT_0_001	4 170,4	34,4 %
	USDKZT_0_002	7 718,9	63,7 %
	USDKZT_0_01W	4,3	0,04 %
	USDKZT_0_01M	4,6	0,04 %
	USDKZT_0_03M	33,8	0,3%
RUBKZT	RUBKZT_0_002	176,9	1,5 %



Спасибо за внимание!

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

