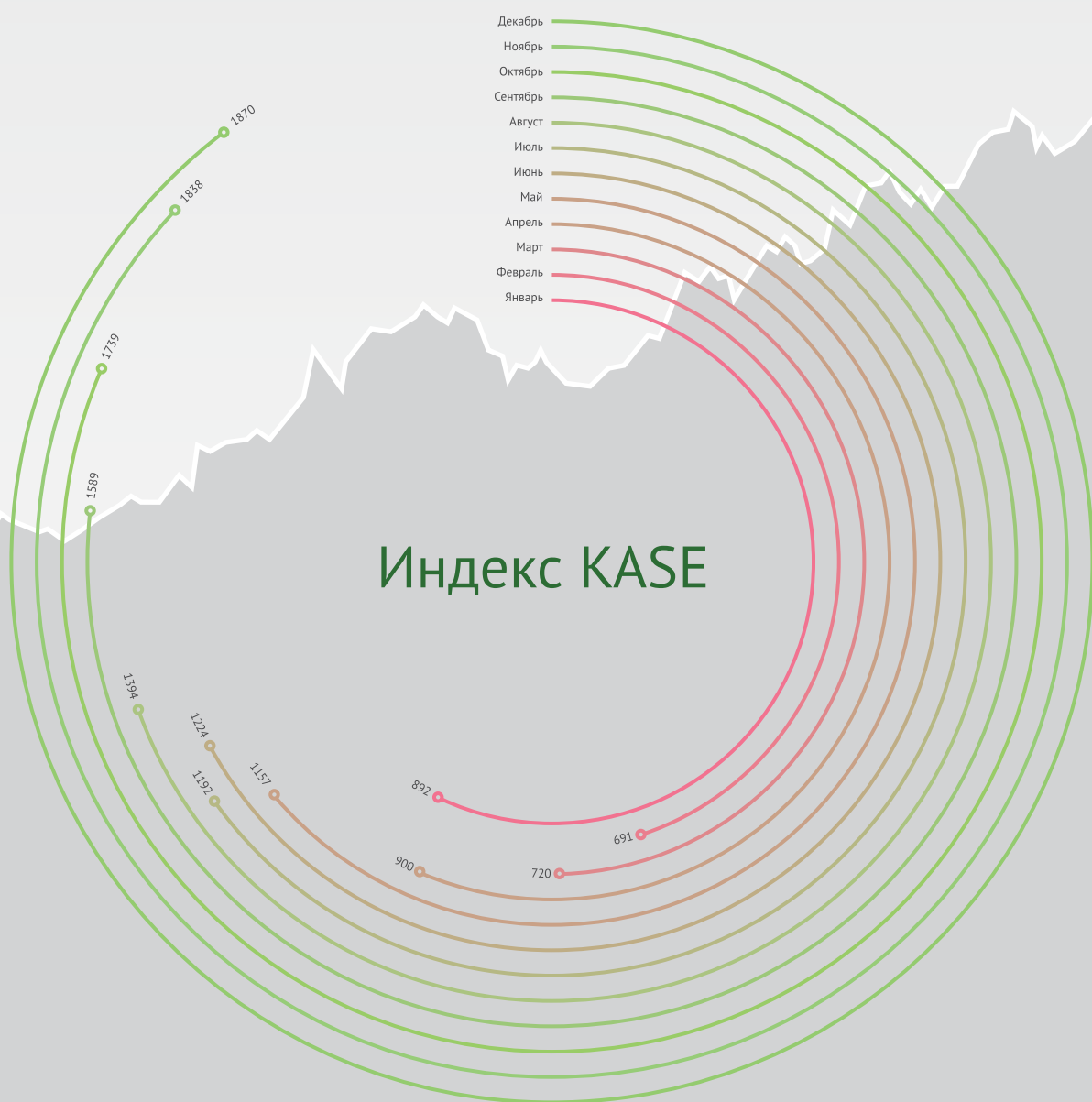


ГОДОВОЙ ОТЧЕТ 2009

Казахстанская фондовая биржа



Обращение Президента



Уважаемые коллеги!

2009 год принес экономике Казахстана и особенно финансовому рынку страны не только новые испытания на прочность, но и опыт принятия и реализации антикризисных решений.

Достаточно развитая инфраструктура финансового рынка Республики Казахстан, одной из важнейших составляющих которой является KASE, позволила государственным органам успешно осуществить целый ряд мер антикризисного реагирования, опираясь на возможности отечественной биржи.

Мероприятия, которые были проведены для сохранения и дальнейшего развития финансовой системы, в том числе со стороны KASE, во многом были ориентированы в 2009 году не на достижение максимальных коммерческих результатов, а на стабилизацию и повышение надежности

отечественного финансового рынка. При этом важно отметить, что профессиональные участники рынка ценных бумаг – акционеры и члены KASE – ответственно и конструктивно отнеслись к реализации данных мероприятий.

В 2009 году рынок продолжал испытывать последствия всемирного кризиса. Снижение биржевого оборота явилось объективным следствием глобальных экономических катаклизмов, которые не могли обойти своим влиянием и нашу страну. Как следствие упали обороты на валютном и денежном рынках. Впервые в 2009 году KASE столкнулась с серией дефолтов листинговых компаний на фоне их ухудшившегося финансового состояния, а также с неисполнением обязательств участниками на рынке операций репо. Отрицательно продолжал влиять на рынок и начавшийся еще в 2008 году отток инвесторов, обусловивший снижение ликвидности.

В этих условиях тем не менее KASE закончила год с положительными финансовыми результатами. Во многом этого удалось достичь благодаря мерам, принятым в 2009 году совместными усилиями KASE, Агентства Республики Казахстан по регулированию и надзору финансового рынка и финансовых организаций и Агентства Республики Казахстан по регулированию деятельности регионального финансового центра города Алматы.

Безусловно, негативные макроэкономические факторы еще будут оказывать влияние на наш рынок в течение ряда лет. При этом есть основания полагать, что „дно“ кризиса уже пройдено. Поддержка государства, наших акционеров, профессионализм специалистов KASE и всего казахстанского финансового сообщества дали возможность Бирже в столь сложный год продолжить реализацию масштабных проектов и позволяют с уверенностью говорить об устойчивом развитии KASE в будущем.

Президент АО „Казахстанская фондовая биржа“
Дамитов К.К.

A handwritten signature in blue ink, consisting of stylized, cursive letters.

Оглавление

Глоссарий	6
Раздел I. Краткое описание конъюнктуры рынка в 2009 году	9
Раздел II. Основные события 2009 года	15
Исполнение Стратегии KASE	16
Развитие через антикризисное регулирование	20
Повышение уровня корпоративного управления	23
Раздел III. Финансовые итоги 2009 года	27
Анализ активов и обязательств	28
Анализ доходов и расходов	28
Основные финансовые показатели деятельности Биржи	30
Раздел IV. Консолидированная финансовая отчетность группы KASE за 2009 год	33
Отчет независимых аудиторов	34
Заявление об ответственности за подготовку консолидированной финансовой отчетности за 2009 год	35
Консолидированный отчет о финансовом состоянии	36
Консолидированный отчет о совокупном доходе	38
Консолидированный отчет об изменениях в собственном капитале	39
Консолидированный отчет о движении денег	40
Раздел V. Книга фактического материала	43

Глоссарий

В тексте используются следующие сокращения и аббревиатуры:

ALT	алматинское время (GMT + 06:00, зима)
GAAP	General Accepted Accounting Principles (общепринятые принципы бухгалтерского учета, применяемые в США и некоторых других странах)
EBITDA	показатель объема прибыли до вычета расходов по процентам, уплаты налогов и амортизационных отчислений
EUR	евро
IAS / IFRS	International Accounting Standards / International Financial Reporting Standards (международные стандарты финансовой отчетности)
IPO	Initial Public Offering (первичное публичное размещение)
ISIN	International Securities Identification Number (международный идентификационный номер ценной бумаги)
KASE	АО „Казахстанская фондовая биржа“
KazPrime	среднее значение ставок размещения денег на депозиты, заявленных банками наилучшего для Казахстана кредитного качества
KIBOR	среднее значение индикативных ставок размещения на межбанковские депозиты в Казахстане
KIBID	среднее значение индикативных ставок привлечения на межбанковские депозиты в Казахстане
KIMEAN	среднее значение между KIBOR и KIBID
KZT	казахстанский тенге
RUB	российский рубль
SPT	условие осуществления расчетов, при котором исполнение сделки происходит на второй рабочий день со дня ее заключения (от английского слова „spot“)
T+0	см. TOD
T+1	см. TOM
T+2	см. SPT
T+N	условие осуществления расчетов, при котором исполнение сделки происходит на n-ый рабочий день со дня ее заключения
TOD	условие осуществления расчетов, при котором исполнение сделки происходит в день ее заключения (от английского слова „today“)
TOM	условие осуществления расчетов, при котором исполнение сделки происходит на следующий рабочий день со дня ее заключения (от английского слова „tomorrow“)
TONIA	средневзвешенная процентная ставка по сделкам открытия операций репо сроком на один день на рынке автоматического репо с государственными ценными бумагами Республики Казахстан
USD	доллар США
АИФН	акционерный инвестиционный фонд недвижимости
АРД РФЦА	Агентство Республики Казахстан по регулированию деятельности регионального финансового центра города Алматы
АО	акционерное общество
АФН	Агентство Республики Казахстан по регулированию и надзору финансового рынка и финансовых организаций
БВУ	банк (банки) второго уровня
Биржа	АО „Казахстанская фондовая биржа“
ВВП	валовой внутренний продукт (Республики Казахстан, если не указано иное)
ГПА	государственные пакеты акций
группа KASE	АО „Казахстанская фондовая биржа“ и ее дочерние организации ТОО „Информационное агентство финансовых рынков „ИРБИС“ и ТОО „eTrade.kz“
ГЦБ	государственные эмиссионные ценные бумаги
ДБ	дочерний банк
ЗАО	закрытое акционерное общество
ИГЦБ	иностранные государственные ценные бумаги
Индекс KASE	индекс рынка акций KASE
МАОКАМ	государственные специальные среднесрочные казначейские обязательства Министерства финансов Республики Казахстан (со сроками обращения два и три года) (аббревиатура названия ценных бумаг на казахском языке)

МАОКО	государственные специальные компенсационные казначейские облигации Министерства финансов Республики Казахстан (со сроками обращения один, два и три года) (аббревиатура названия ценных бумаг на казахском языке)
МЕИКАМ	государственные индексированные казначейские обязательства Министерства финансов Республики Казахстан (со сроком обращения три месяца и более) (аббревиатура названия ценных бумаг на казахском языке)
МЕКАМ	государственные казначейские обязательства Министерства финансов Республики Казахстан (аббревиатура названия ценных бумаг на казахском языке)
МЕККАМ	государственные краткосрочные казначейские обязательства Министерства финансов Республики Казахстан (со сроком обращения до одного года включительно) (аббревиатура названия ценных бумаг на казахском языке)
МЕОКАМ	государственные среднесрочные казначейские обязательства Министерства финансов Республики Казахстан (со сроком обращения свыше года до пяти лет включительно) (аббревиатура названия ценных бумаг на казахском языке)
МЕУЖКАМ	государственные долгосрочные сберегательные казначейские обязательства Министерства финансов Республики Казахстан (со сроком обращения свыше пяти лет), размещаемые среди накопительных пенсионных фондов (аббревиатура названия ценных бумаг на казахском языке)
МЕУКАМ	государственные долгосрочные казначейские обязательства Министерства финансов Республики Казахстан (со сроком обращения свыше пяти лет) (аббревиатура названия ценных бумаг на казахском языке)
Министерство финансов	Министерство финансов Республики Казахстан
млн	миллион
млрд	миллиард
МРП	месячный расчетный показатель для исчисления пособий и иных социальных выплат, а также для применения штрафных санкций, налогов и других платежей в соответствии с законодательством Республики Казахстан, значение которого устанавливается законами Республики Казахстан о республиканском бюджете на соответствующие годы
МСФО	международные стандарты финансовой отчетности
МУИКАМ	государственные долгосрочные индексированные казначейские обязательства Министерства финансов Республики Казахстан (со сроком обращения свыше пяти лет) (аббревиатура названия ценных бумаг на казахском языке)
МФО	международная финансовая организация (международные финансовые организации)
н/с	данные не приводятся по причине несовместимости
н/т	инструмент не торговался или операции не осуществлялись
Национальный Банк, НБК, НБ РК	Национальный Банк Республики Казахстан
НИН	национальный идентификационный номер ценной бумаги, присвоенный в соответствии с законодательством Республики Казахстан
НЦБ	негосударственные эмиссионные ценные бумаги
ООИУПА	организация, осуществляющая (организации, осуществляющие) инвестиционное управление пенсионными активами
ОТП KASE	основная торговая площадка KASE (в отличие от СТП РФЦА)
ПА	пенсионные активы
РГП	республиканское государственное предприятие
рис.	рисунок
РФЦА	региональный финансовый центр города Алматы
см.	смотри
СТП РФЦА	специальная торговая площадка регионального финансового центра города Алматы
Стратегия	внутренний документ Биржи „Стратегия развития АО „Казахстанская фондовая биржа“ на 2007–2010 годы“
США	Соединенные Штаты Америки
тыс.	тысяча
таб.	таблица
ТОО	товарищество с ограниченной ответственностью
Торговая система, ТС	торговая система АО „Казахстанская фондовая биржа“
ФНБ	Фонд национального благосостояния
ЦБ	ценные бумаги
ЦД	АО „Центральный депозитарий ценных бумаг“

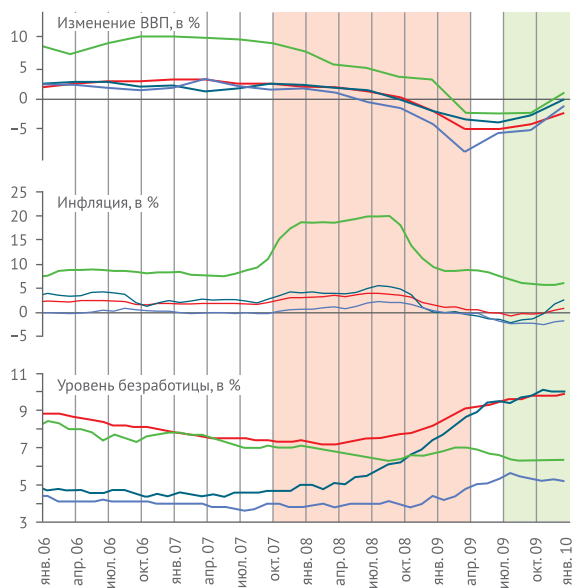
Если в тексте настоящего отчета не указываются ссылки на источники приведенной информации, то подразумевается, что Биржа использовала данные, которые собирались и систематизировались ее персоналом в процессе его деятельности.



Краткое описание конъюнктуры
рынка в 2009 году

Отчетный год оказался переломным для мировой и казахстанской экономик. После двухлетнего периода экономической рецессии и stagflation основные глобальные и казахстанские экономические индикаторы в 2009 году достигли своих минимальных экстремумов, ознаменовав тем самым начало восстановительного цикла (рис. 1).

Рисунок 1
Основные макроэкономические показатели Европы, США, Японии и Казахстана



Показатели изменения ВВП и инфляции достигли минимума в середине 2009 года, ознаменовав тем самым начало выхода глобальной экономики из состояния stagflation. Снижение показателей безработицы в конце 2009 года также может свидетельствовать о начале экономического роста. Период перелома отмечен зеленым. Красным сектором отмечен предшествующий период снижения темпов экономического роста при относительно высоком уровне инфляции (период stagflation).

Неоднородность отчетного периода вылилась в разнонаправленную динамику основных макроэкономических показателей и индикаторов финансового рынка. Сложный период конца 2008 – начала 2009 года сменился более благоприятным вторым полугодием 2009 года.

В начале отчетного года крупнейшие мировые экономики демонстрировали снижение показателей производства и внешней торговли. ВВП США по итогам четвертого квартала 2008 года снизился на 6,2 %, что оказалось значительно

ниже прогнозов аналитиков. Финансовая отчетность корпоративного сектора и национализация крупнейших банков только подтверждали отрицательную макроэкономическую статистику.

Под воздействием негативных новостей аналитики снижали прогнозы по показателям потребления и производства, в то время как инвесторы распродавали долевые и долговые инструменты, контракты на углеводороды и основные металлы. Индекс S&P 500 достиг 12-летнего минимума на отметке 684 пункта, стоимость нефти марки Brent опустилась ниже 40 USD за баррель, а цена трехмесячного фьючерсного контракта на медь упала до 3 000 USD за тонну (рис. 2).

Рисунок 2
Динамика индекса товарных рынков UBS CMCI Composite USD Total Return, пункты



Сокращение объема экспортной валютной выручки привело к ухудшению показателей казахстанской внешнеторговой статистики. Дефицит текущего счета платежного баланса Казахстана во втором квартале 2009 года достиг 2,4 млрд USD, положительное сальдо торгового баланса снизилось до 2,1 млрд USD (рис. 3). Начавшийся в конце 2008 года нетто-отток иностранной валюты из Казахстана ослабил позиции тенге, в результате чего 04 февраля Национальный Банк был вынужден провести одномоментную девальвацию на 25 %. Новый курс был зафиксирован на уровне 150 тенге за доллар США с коридором допустимых колебаний $\pm 3\%$ в течение последующего года.

В условиях ухудшающегося положения компаний корпоративного сектора и невозможности привлечения зарубежного финансирования банки второго уровня практически прекратили кредитование экономики в 2008 и 2009 годах (рис. 4). Последовавший рост межкорпоративной

Рисунок 3

Динамика показателей платежного баланса Республики Казахстан в 2008 и 2009 годах, млрд USD

Сальдо торгового баланса

Сальдо текущего счета платежного баланса

Общее сальдо платежного баланса

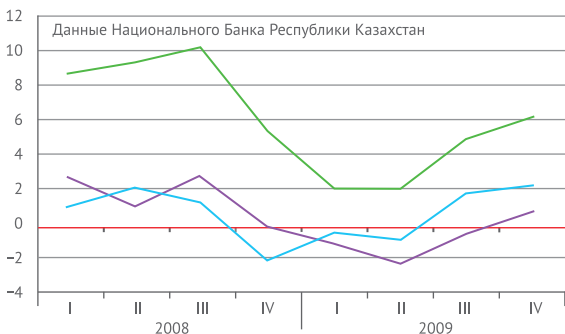
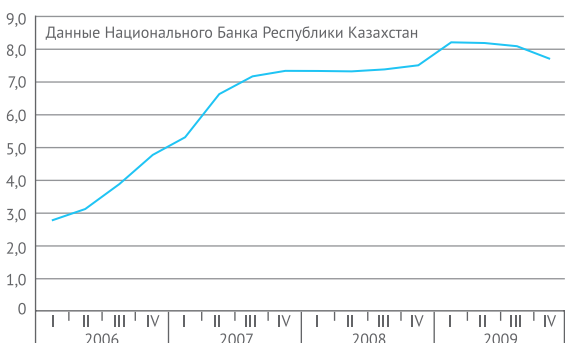


Рисунок 4

Итоговый объем выданных экономике кредитов в 2006–2009 годах, трлн KZT



задолженности привел к неплатежеспособности крупных заемщиков, еще больше увеличил долю неработающих кредитов в экономике и спровоцировал возникновение дефолтов на казахстанском облигационном рынке (см. раздел „Создание буферной категории“).

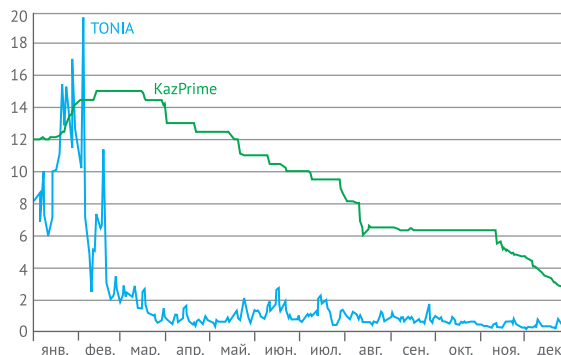
Проблемы банков привели к критическому снижению показателей достаточности их капитала. В конце 2008 года АО „ФНБ „Самрук-Казына“ подписало меморандумы о взаимопонимании с четырьмя системообразующими банками второго уровня, где были оговорены основные принципы их докапитализации. В январе 2009 года на счетах АО „Казкоммерцбанк“ и АО „Народный сберегательный банк Казахстана“ были размещены депозиты по 120 млрд тенге. 02 февраля АФН рекомендовало АО „ФНБ „Самрук-Казына“ произвести докапитализацию АО „БТА Банк“ путем выкупа дополнительно размещенных 29,9 млн про-

стых акций на сумму 251,3 млрд тенге (78,14 % от размещенных акций). В тот же день АО „ФНБ „Самрук-Казына“ объявило о выкупе у АО „Финансовая Корпорация Сеймар Альянс“ 76 % акций АО „Альянс Банк“ и размещении на счете банка дополнительных 24 млрд тенге в качестве специального депозита для поддержания финансовой устойчивости АО „Альянс Банк“ и его дальнейшей докапитализации.

Проблемы казахстанской экономики проецировались на казахстанский денежный рынок. В конце 2008 – начале 2009 года спекуляции на тему обесценения национальной валюты, а также недоступность зарубежного фондирования обострили дефицит краткосрочной тенговой ликвидности. Ставки денежного рынка в первом квартале 2009 года достигли исторически максимальных значений: индикатор TONIA в феврале превысил 19 % годовых, трехмесячный KazPrime – 15 % годовых (рис. 5).

Рисунок 5

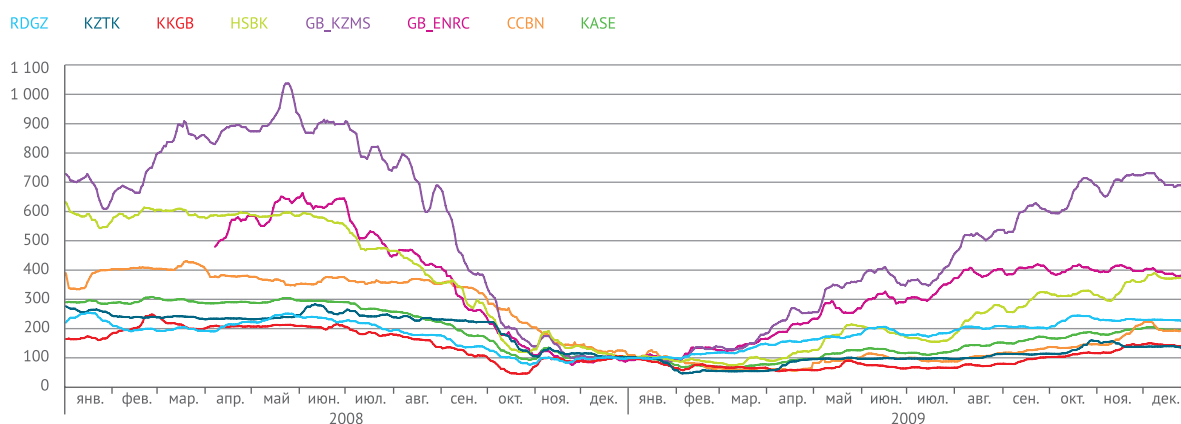
Динамика индикаторов денежного рынка в 2009 году, % годовых



На фоне поступающей негативной информации и острой нехватки ликвидности инвесторы закрывали длинные позиции по высокорисковым на тот момент казахстанским акциям и облигациям. К февралю 2009 года Индекс KASE достиг минимального с 2006 года значения – 576,89 пункта (рис. 6). Наиболее негативная динамика наблюдалась по простым акциям АО „Казактелеком“ (–56,6 % с начала года, либо –672 % в годовом выражении), простым акциям АО „Казкоммерцбанк“ (–45,9 %, –544 % в годовом выражении); лучше рынка вели себя простые акции добывающих компаний KAZAKHMY S PLC (–5,1 %) и АО „Разведка Добыча „КазМунайГаз“ (–7,6 %).

Рисунок 6

Динамика Индекса KASE и цен акций представительского списка в 2009 и 2008 годах, % (01.01.09 = 100)



Индекс KASE вырос по итогам 2009 года на 98,2 %. Основными „источниками“ роста являлись компании добывающего сектора, цены акций которых росли вслед за мировыми ценами на нефть и металлы.

Обвал цен на фондовом рынке привел к тому, что стоимость созданных при помощи операций репо портфелей оказалась значительно ниже стоимости обязательств по ним. В связи с ужесточением 25 января 2009 года Правил осуществления операций репо¹ обладатели таких портфелей были лишены возможности пролонгировать свои проблемные обязательства и фактически оказались в дефолте (см. раздел „Мероприятия по снижению уровня рисков“). В результате казахстанский рынок операций „прямого“ репо поразила череда неплатежей, пик которых пришелся на февраль–март 2009 года, когда доля просроченных обязательств превысила 25 % от всего объема открытых на тот момент операций в данном секторе казахстанского денежного рынка.

Тем временем, вопреки прогнозам, снижение потребительских и сырьевых цен, а также рост уровня безработицы в первом квартале создали благоприятную основу для начала восстановительных процессов в западных странах. С лета 2009 года начали поступать первые позитивные данные из США и Еврозоны. По итогам второго, третьего и четвертого кварталов показатели роста ВВП и инфляции ведущих мировых экономик стали демонстрировать улучшение, а показатель безработицы в США и Еврозоне достиг своего пика в четвертом квартале (рис. 1). Кроме того,

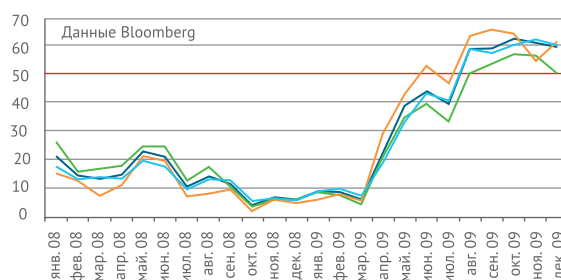
важно отметить стабильность экономических процессов в Китае как один из важнейших глобальных факторов.

Долгожданные вести были позитивно восприняты участниками финансового рынка. Индикатор настроений Bloomberg Professional Confidence Index в августе 2009 года впервые превысил 50 пунктов, обозначив рыночные ожидания скорого роста экономики (рис. 7). Ведущие мировые фондовые индексы, достигнув „дна“ во втором квартале 2009 года, устремились вверх, завершив год на 20–50 % выше конца 2008 года (рис. 8).

Рисунок 7

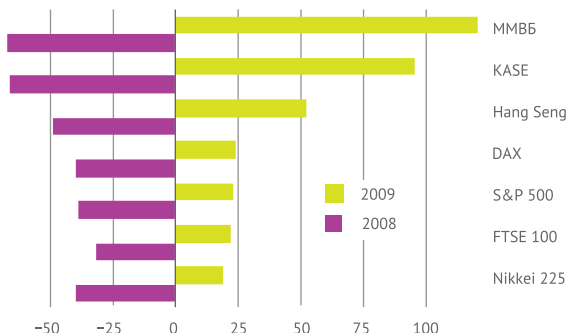
Динамика показателей серии Bloomberg Professional Confidence Index (BPCI), пункты

Bloomberg Professional Confidence Index Global Economy
Bloomberg Professional Confidence Index North America
Bloomberg Professional Confidence Index Asia
Bloomberg Professional Confidence Index Western Europe



¹ Внутренний документ KASE „Правила осуществления операций репо“, утвержденный решением Общего собрания членов ЗАО „Казахстанская фондовая биржа“ от 23 декабря 2002 года.

Рисунок 8
Динамика мировых фондовых индексов в 2009 и 2008 годах, %



В 2009 году большинство зарубежных индексов выросло на 20–50 %. Росту способствовало восстановление мировых сырьевых рынков, а также позитивные новости и статистика из США и стран Европы. Наиболее позитивную динамику продемонстрировал российский индекс ММВБ в ответ на значительный рост цен на углеводороды.

Растущий спрос оказал позитивное влияние на рынки сырьевых товаров (рис. 2). К примеру, цена нефти марки Brent стабилизировалась в четвертом квартале в коридоре 70–80 USD за баррель, что оказалось в два раза выше годового минимума.

В это время в Казахстане принимались дополнительные меры государственной поддержки в рамках программы, начатой еще в середине 2008 года. В результате правительственных мер стимулирования в экономику поступило более 10 млрд USD, часть которых в том или ином виде осталась на корреспондентских счетах банков второго уровня.

В середине марта 2009 года был запущен механизм предоставления НБ РК дополнительной краткосрочной ликвидности наиболее нуждавшимся АО „Альянс Банк“ и АО „БТА Банк“. Указанными банками был произведен листинг своих долговых обязательств с последующим свопом на облигации АО „ФНБ „Самрук-Казына“, которые использовались ими в качестве предмета операций репо с НБ РК. При реализации данного механизма в полной мере была использована биржевая инфраструктура.

На фоне снижения темпов кредитования по-

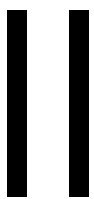
ступление государственных денег в экономику привело к насыщению денежного рынка ликвидностью во второй половине отчетного года, стабилизации индикатора TONIA в рамках 0,5–1,0 % годовых и снижению объемов привлечения на рынке операций репо. Начиная с апреля 2009 года, индикатор KazPrime постоянно снижался и достиг к концу года 3 % годовых (рис. 5).

Дефицит государственного бюджета в размере 3,1 % ВВП привел к росту показателя государственного долга с 6,3 % ВВП до 10,1 % ВВП. Министерство финансов активно наращивало эмиссию МЕКАМ, в результате чего объем торгов на рынке ГЦБ вырос в 2009 году на 50 % и составил 1 408,1 млрд тенге.

Казахстанский рынок долевого инструментария позитивно отреагировал на поступающие внутренние и внешние новости. К концу года Индекс KASE прибавил 98,2 % (206,5 % по отношению к годовому минимуму), капитализация рынка акций выросла на 84,3 %. В плюсе оказались все акции представительского списка Индекса KASE (рис. 6). Лидерами роста здесь стали простые акции ресурсодобывающих KAZAKHMYN PLC (+704 %), EURASIAN NATURAL RESOURCES CORPORATION (+382 %), АО „Разведка Добыча „КазМунайГаз“ (+238 %), а также простые акции АО „Народный сберегательный банк Казахстана“ (+381 %).

Необходимо также отметить, что в результате совместных действий АФН и Биржи был введен в действие ряд поправок во внутренние документы KASE, направленных на стабилизацию и качественное улучшение рынка операций „прямого“ репо. В результате к апрелю отчетного года удалось свести к минимуму объем и количество вновь регистрируемых в данном секторе биржевого рынка дефолтов, а во втором полугодии дефолтов здесь не наблюдалось (см. раздел „Мероприятия по снижению уровня рисков“).

Приведенное выше позволяет утверждать, что 2009 год оказался годом позитивных перемен. Впервые с осени 2007 года мы увидели не только признаки стабилизации в экономике и на рынках, но и появились первые надежды на последующий рост.



Основные события 2009 года

В отчетном году была продолжена работа над реализацией Стратегии развития АО „Казахстанская фондовая биржа“ на 2007–2010 годы. Ее положения стали базисом для составления Плана основных работ на 2009 год (см. главу „Повышение уровня корпоративного управления“). Однако ситуация на казахстанском рынке, вызванная

финансовым кризисом, требовала от KASE значительной корректировки своих стратегических планов и реализации крупных проектов, которые не были предусмотрены Стратегией. Ниже приводится описание наиболее значимых работ, выполненных KASE в 2009 году, по реализации Стратегии и в рамках антикризисных программ.

Исполнение Стратегии KASE

Объединение торговых площадок на основе новых листинговых требований

Одним из основных достижений KASE в 2009 году стало выполнение положения Стратегии о распространении правового и налогового режимов, относящихся к специальной торговой площадке регионального финансового центра города Алматы, на весь организованный финансовый рынок Казахстана. Данная задача была решена 09 ноября 2009 года через объединение СТП РФЦА и ОТП KASE.

Со вступлением в силу 07 января 2007 года приказа Председателя АРД РФЦА от 15 декабря 2006 года № 14, определяющего KASE в качестве оператора СТП РФЦА, казахстанский организованный фондовый рынок де-факто был поделен на два сектора – СТП РФЦА и ОТП KASE.

Разделение биржевого рынка оказалось малоэффективным. В 2007 году объем торгов на СТП РФЦА не превысил 3,9 % от всего объема биржевых торгов на рынке акций и корпоративных облигаций, в 2008 году – 15,2 %. Наличие двух площадок с различными правовым и налоговым режимами, на которых торгуются практически одни и те же бумаги, внесло неясность в вопросы листинга и инвестирования на казахстанском фондовом рынке.

В марте 2007 года с целью определения путей взаимодействия между АРД РФЦА и KASE была создана Согласительная комиссия, одним из результатов деятельности которой стало принятие решения об объединении двух торговых площадок – СТП РФЦА и ОТП KASE. С этого момента KASE и регуляторами (АРД РФЦА и АФН) проводилась активная работа по восстановлению единства рынка.

15 января 2008 года были введены в действие дополнения во внутренний документ KASE „Правила

организации и функционирования специальной торговой площадки регионального финансового центра города Алматы“, которые сняли запрет на получение членами категории „А“² членства на KASE по другим категориям и наоборот. Это стало первым шагом на пути к объединению.

Благодаря деятельности рабочей группы, созданной в октябре 2007 года при АРД РФЦА для разработки новых листинговых требований СТП РФЦА и ОТП KASE, 02 июня и 01 сентября 2008 года были введены в действие два новых документа:

- приказ Председателя АРД РФЦА „Об установлении требований к эмитентам, чьи ценные бумаги предполагаются к включению или включены в список специальной торговой площадки регионального финансового центра города Алматы, а также к таким ценным бумагам“³ от 08 мая 2008 года № 04.2-09/119;
- постановление Правления АФН „О требованиях к эмитентам и их ценным бумагам, допускаемым (допущенным) к обращению на фондовой бирже, а также к отдельным категориям списка фондовой биржи“⁴ от 26 мая 2008 года № 77.

Названные Приказ и Постановление установили новую структуру официальных списков и листинговые требования для СТП РФЦА и ОТП KASE соответственно. Таким образом, была выполнена основная работа по унификации листинговых требований двух площадок, что позволило в 2009 году перейти к последнему этапу – окончательному слиянию.

Однако достаточно сложная ситуация на финансовом рынке Казахстана в первой половине 2009 года обусловила необходимость трехкратного внесения поправок в Приказ и Постановление. Наиболее существенными из них были:

- установление величины, до которой допу-

² С правом участия в торгах всеми инструментами, обращающимися (торгуемыми) на СТП РФЦА.

³ Далее в настоящем разделе – Приказ.

⁴ Далее в настоящем разделе – Постановление.

- скается снижение собственного капитала эмитента во время нахождения его акций в наивысших категориях официального списка (действие распространяется до 01 июля 2012 года);
- снижение требований к наличию чистой прибыли эмитента:
 - во время нахождения его акций в первой категории официального списка (действие распространяется до 01 июля 2012 года);
 - для включения акций во вторую категорию и долговых ценных бумаг в категорию „долговые ценные бумаги без рейтинговой оценки“ официального списка, а также для нахождения данных ценных бумаг в этих категориях;
 - исключение требования к наличию маркет-мейкера у долговых ценных бумаг, включаемых (включенных) в официальный список по второй подкатегории категории „долговые ценные бумаги без рейтинговой оценки“;
 - дополнение сектора „долговые ценные бумаги“ „буферной категорией“ (см. раздел „Создание буферной категории“);
 - установление перечня событий, в результате наступления которых ценные бумаги эмитента подлежат безусловному делистингу;
 - установление дополнительных требований к акционерным инвестиционным фондам и новых требований к фондам недвижимости.

В отчетном году был разработан и 30 июля утвержден Биржевым советом новый внутренний документ KASE „Правила функционирования торговой площадки АО „Казахстанская фондовая биржа“ в качестве специальной торговой площадки регионального финансового центра города Алматы“. Данным документом к СТП РФЦА были отнесены все элементы торговой площадки KASE за исключением предназначенных для организации торгов иностранными валютами. Этим же документом были сохранены особые правовой и налоговый режимы при заключении сделок на биржевом фондовом рынке между организациями, являющимися участниками РФЦА.

Параллельно в отчетном году Биржа завершила разработку внутреннего документа „Листинговые правила“ в новой редакции, который был утверж-

ден Биржевым советом 05 ноября и в тот же день согласован с АФН и АРД РФЦА. Листинговые правила представляют собой принципиально новую редакцию данного документа, в которой были учтены все последние изменения в казахстанском законодательстве, касающиеся листинговых требований, а также накопленный на протяжении последних двенадцати лет опыт KASE по проведению листинговых процедур.

Принципиальным нововведением Листинговых правил стало использование Биржей кредитных рейтингов от рейтинговых агентств в качестве критерия соответствия долговых ценных бумаг и их эмитентов листинговым требованиям, а также наличие требований к рейтинговым агентствам, оценки которых KASE учитывает при листинговых процедурах.

С 09 ноября 2009 года были введены в действие Правила функционирования торговой площадки АО „Казахстанская фондовая биржа“ в качестве специальной торговой площадки регионального финансового центра города Алматы, Листинговые правила в новой редакции, а также официальный список ценных бумаг объединенной торговой площадки KASE и РФЦА (который был утвержден Листинговой комиссией KASE 30 октября). Тогда же, 09 ноября утратили силу Правила организации и функционирования специальной торговой площадки регионального финансового центра города Алматы, утвержденные 28 декабря 2006 года.

Таким образом, с 09 ноября 2009 года прекратили свое существование СТП РФЦА и ОТП KASE и начала функционировать объединенная торговая площадка, регулируемая унифицированными нормативными документами: Приказом и Постановлением, а также Листинговыми правилами в новой редакции (таб. 61 Книги фактического материала). Это завершило более чем двухлетнюю работу KASE, АФН и АРД РФЦА по восстановлению единства организованного рынка ценных бумаг и модернизации требований, предъявляемых к нему и к его участникам.

Концентрация спроса и предложения по неликвидным акциям

12 мая 2009 года Правлением Биржи было принято решение о проведении в период с 01 июня по 01 октября эксперимента по сокращению торгового дня по неликвидным акциям до двух часов (с 15:00 до 17:00 ALT). В соответствии с критериями ликвидности, одобренными Биржевым советом, к неликвидным были отнесены акции 51 наименования (акции 28 наименований были отнесены к ликвидным).

По результатам данного эксперимента 29 октября Биржевой совет принял решение о продлении срока эксперимента до 01 декабря 2009 года и последующем введении в действие нового режима торговли акциями, отнесенными к категории неликвидных. 01 декабря 2009 года решением Правления были внесены поправки во внутренний документ KASE „Регламент торгов и работы Системы подтверждения“⁵, которыми с 01 января 2010 года торговый день по неликвидным акциям был официально сокращен до двух часов.

01 декабря 2009 года Правлением Биржи был утвержден новый внутренний документ KASE „Методика определения показателей ликвидности ценных бумаг“, который установил порядок ежеквартального формирования списков ликвидных и неликвидных акций для применения к ним норм Регламента. На первый квартал 2010 года список неликвидных акций был сформирован из акций 73 наименований, в список ликвидных акций вошли ценные бумаги 10 наименований.

Сокращение сферы использования метода франкфуртских торгов при торговле акциями

01 декабря 2009 года в Регламент были внесены поправки, которыми изменен перечень случаев применения режима ожидания при проведении биржевых торгов акциями. С указанной даты торги акциями стали переводиться в режим ожидания, во время которого они проводятся методом франкфуртских торгов, не в любом случае совпадения или пересечения цен заявок на продажу

и покупку акций, а только если цена предполагаемой сделки отличается от цены последней сделки с данными акциями на 10 % по ликвидным акциям и на 5 % по неликвидным акциям либо при отсутствии сделок с данными акциями в течение 15 календарных дней и более.

Описанное нововведение приблизило рынок KASE к стандартам развитых мировых рынков и, по мнению Правления KASE, должно способствовать росту ликвидности акций на торгах Биржи.

Введение аукционов закрытия

29 сентября 2009 года Правление Биржи утвердило поправки в Регламент, которыми установлена возможность перевода торгов, проводимых методом непрерывного встречного аукциона, в режим франкфуртского аукциона за 15 минут до окончания торгового дня с закрытием данного аукциона в случайно выбранный момент времени.

Применение метода франкфуртских торгов в конце торговой сессии аналогично аукционам закрытия, применяемым на крупных зарубежных биржах. Данный механизм позволяет свести к минимуму возможность манипулирования ценами торгуемых инструментов на последних минутах биржевых торгов, а также способствует формированию более репрезентативных значений цен закрытия.

Аукционы закрытия были запущены на KASE с 05 октября 2009 года при торговле любыми акциями, допущенными к обращению на Бирже. Аукционы начинаются в 16:45 ALT, когда торги акциями из режима непрерывного встречного аукциона переводятся в режим франкфуртских торгов, которые заканчиваются в случайно выбранный торговой системой момент времени в интервале с 16:58 до 17:00 ALT.

Расширение перечня доступных членам KASE финансовых инструментов

Поправками в Регламент от 01 декабря 2009 года был установлен режим торгов новыми финан-

⁵ Внутренний документ KASE „Регламент торгов и работы Системы подтверждения“, утвержденный решением Правления Биржи от 05 августа 2004 года № 108/1, далее в этом разделе – Регламент.

совыми инструментами на рынке иностранных валют. С 14 декабря 2009 года на казахстанском биржевом валютном рынке появились следующие инструменты:

- евро с расчетами в тенге на второй рабочий день после дня заключения сделки (торговый код – EURKZT_SPT);
- евро с расчетами в долларах США в день заключения сделки (торговый код – EURUSD_TOD);
- евро с расчетами в долларах США на следующий рабочий день после дня заключения сделки (торговый код – EURUSD_TOM);
- евро с расчетами в долларах США на второй рабочий день после дня заключения сделки (торговый код – EURUSD_SPT).

В секторе операций валютного свопа с указанной даты стали доступны операции в отношении евро с расчетами в тенге:

- операции валютного свопа, состоящие из сделки купли-продажи евро с исполнением данной сделки в день торгов и одновременно заключенной с данной сделкой и противоположной по направлению к ней сделки купли-продажи евро в том же количестве с исполнением второй из этих сделок на следующий рабочий день после дня торгов (EURKZT_0_001);
- операции валютного свопа, состоящие из сделки купли-продажи евро с исполнением данной сделки в день торгов и одновременно заключенной с данной сделкой и противоположной по направлению к ней сделки купли-продажи евро в том же количестве с исполнением второй из этих сделок на второй рабочий день после дня торгов (EURKZT_0_002);
- операции валютного свопа, состоящие из сделки купли-продажи евро с исполнением данной сделки на следующий рабочий день после дня торгов и одновременно заключенной с данной сделкой и противоположной по направлению к ней сделки купли-продажи евро в том же количестве с исполнением второй из этих сделок на второй рабочий день после дня торгов (EURKZT_1_002).

Запуск перечисленных инструментов и операций на казахстанском рынке иностранных валют

был призван расширить доступный профессиональным участникам инструментарий, а также повысить привлекательность и конкурентность биржевого сегмента данного рынка.

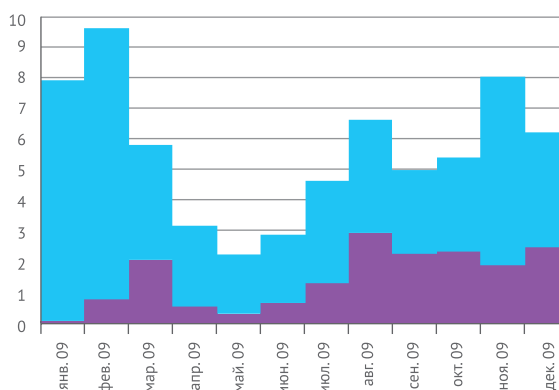
Следует отметить, что отчетный год доказал высокий интерес членов KASE к открытым в конце 2008 года торгам в секторе операций валютного свопа (с 2008 года были доступны операции валютного свопа в отношении доллара США). На эти операции пришлось около 26 % объема торгов на рынке иностранных валют в 2009 году (рис. 9).

Рисунок 9

Объем торгов на рынке иностранных валют в 2009 году, млрд USD

Спот-рынок

Рынок операций валютного свопа



Упрощение системы членства на KASE

В соответствии со Стратегией в 2009 году Биржей разработаны и утверждены Биржевым советом изменения и дополнения во внутренние документы KASE, которые значительно упростили систему членства. С введением в действие 13 января 2010 года указанных поправок члены Биржи разделены на следующие категории:

- „член фондового рынка“ – с правом участия в биржевых торгах ценными бумагами, допущенными к обращению на Бирже;
- „член валютного рынка“ – с правом участия в биржевых торгах иностранными валютами;
- „член срочного рынка“ – с правом участия в биржевых торгах производными финансовыми инструментами.

Развитие через антикризисное регулирование

Создание буферной категории

2009 год характеризовался эскалацией недоверия на рынке корпоративного долга, вызванного чередой дефолтов эмитентов корпоративных облигаций при их обслуживании. Пик неплатежей пришелся на весну–лето отчетного года. К концу года 22 листинговые компании (включая две компании, допустившие дефолт в 2008 году) объявили о неисполнении своих обязательств по облигациям (см. таблицу 65 Книги фактического материала)⁶.

Всего по итогам 2009 года дефолт был допущен по облигациям 58 наименований (14 % от общего количества листинговых инструментов на конец года), а доля таких инструментов в общей капитализации рынка корпоративных облигаций составила почти 25 %. При этом лишь 13,7 % просроченной задолженности было погашено к концу отчетного года.

Среди основных причин допущенных в Казахстане дефолтов можно выделить следующие⁷:

- классическое влияние кризиса на производство, когда снижение спроса на продукцию повлекло за собой неспособность компании и/или ее подрядчиков рассчитаться по долгам на фоне отсутствия возможности рефинансирования по разумным ценам (65,2 % компаний);
- намеренное или вынужденное нарушение законодательства, пруденциальных нормативов, недооценка рисков, приведшие в условиях кризиса к формированию отрицательного собственного капитала (31,8 % компаний);

- классическое влияние кризиса на банки – резкое ухудшение качества ссудного портфеля (невозврат кредитов) на фоне отсутствия возможности рефинансирования на приемлемых условиях (27,3 % компаний);
- инфляционный всплеск конца 2007 года, при котором недооценка эмитентами инфляционных рисков привела к слишком высокой стоимости обслуживания индексированного по инфляции долга (4,5 % компаний);
- недостаточная юридическая проработка условий выпуска обязательств (4,5 % компаний).

Следует также отметить, что большинство аналитиков, изучавших данный вопрос, отмечают в качестве весомой причины дефолтов низкую эффективность использования привлеченных посредством выпуска облигаций денег.

В сложившейся ситуации государственными регуляторами рынка ценных бумаг – АФН и АРД РФЦА – были разработаны поправки в их нормативные правовые акты, которыми определена структура официального списка Биржи и установлены требования к ценным бумагам, находящимся в нем, а также к эмитентам таких ценных бумаг. С вводом в действие данных поправок⁸ структура сектора „долговые ценные бумаги“ была дополнена новой „буферной категорией“, перевод долговых корпоративных ценных бумаг в которую стал возможен при наступлении случаев:

- несоответствия ценных бумаг и их эмитентов требованиям названных нормативных правовых актов, которые необходимы к соблюдению для нахождения ценных бумаг в дру-

⁶ Здесь и далее приводятся данные только о листинговых компаниях KASE либо компаниях, которые являлись таковыми на момент дефолта.

⁷ Приведенные ниже значения в процентах не дают в сумме 100, так как для некоторых компаний актуальны несколько из перечисленных причин.

⁸ Поправки в постановление Правления АФН „О требованиях к эмитентам и их ценным бумагам, допускаемым (допущенным) к обращению на фондовой бирже, а также к отдельным категориям списка фондовой биржи“ от 26 мая 2008 года № 77 были введены в действие с 20 августа 2009 года.

Поправки в приказ Председателя АРД РФЦА „Об установлении требований к эмитентам, чьи ценные бумаги предполагаются к включению или включены в список специальной торговой площадки регионального финансового центра города Алматы, а также к таким ценным бумагам“ от 08 мая 2008 года № 04.2-09/119 были введены в действие с 20 сентября 2009 года.

гих категориях сектора „долговые ценные бумаги“;

- дефолта эмитента по выплате вознаграждения по своим обязательствам;
- реструктуризации обязательств эмитента.

В соответствии с данными поправками обязательным условием перевода ценных бумаг в „буферную категорию“ является наличие разработанного эмитентом и утвержденного его Советом директоров (наблюдательным советом эмитента, созданного в иной, помимо акционерного общества, организационно-правовой форме) Плана мероприятий по устранению оснований для перевода ценных бумаг в „буферную категорию“.

При этом перевод ценных бумаг в „буферную категорию“ в 2009 году осуществлялся только в случае вынесения Листинговой комиссией KASE решения о принятии упомянутого плана с обязательным утверждением этого решения Биржевым советом. В противном случае ценные бумаги подлежали делистингу на KASE.

Поправками установлено также, что максимальный срок нахождения ценных бумаг в „буферной категории“ не может превышать 12 месяцев. После истечения этого срока при условии выполнения упомянутого плана ценные бумаги возвращаются в ту категорию (подкатегорию) сектора „долговые ценные бумаги“ официального списка, листинговым требованиям которой они соответствуют. В случае невыполнения плана ценные бумаги подвергаются делистингу.

Введение описанных в настоящем разделе поправок было направлено прежде всего на защиту интересов инвесторов, поскольку нахождение ценных бумаг в „буферной категории“ не освобождает их эмитентов от соблюдения листинговых требований, включая требования по раскрытию информации, а также обязывает инициатора допуска регулярно отчитываться перед Биржей о ходе исполнения эмитентом Плана мероприятий по устранению оснований для перевода его ценных бумаг в „буферную категорию“. Информация о таких ценных бумагах и их эмитенте остается публичной, а ценные бумаги – доступными на организованном рынке.

Кроме того, в случае устранения причин, повлекших перевод ценных бумаг в „буферную категорию“, данные ценные бумаги имеют шанс возврата в прежнюю категорию сектора „долговые ценные бумаги“ официального списка Биржи.

В 2009 году Листинговой комиссией KASE были рассмотрены Планы мероприятий по устранению оснований для перевода ценных бумаг в „буферную категорию“ 20 листинговых компаний, при этом ценные бумаги пяти компаний были подвергнуты делистингу, ценные бумаги 15 компаний переведены в „буферную категорию“.

Мероприятия по снижению уровня рисков

Отчетный год был насыщен событиями, которые серьезно повлияли на финансовый рынок Казахстана и послужили причиной ввода новых мер по его регулированию. Мировой финансовый кризис выявил слабые места и заставил взглянуть на существующую инфраструктуру рынка под новым углом. Вопросы этики наложились на слабость систем мониторинга и контроля рыночных рисков.

На протяжении всего года KASE совместно с АФН проводили активную законодательную и регуляторную работу, направленную на снижение уровня существующих рисков, а также приведение казахстанского финансового рынка в соответствие с принятыми в мире нормами. Стратегической целью всех изменений являлось создание основы для качественного и количественного развития всех секторов биржевого рынка в посткризисный период.

Изменение правил на рынке операций репо

Наиболее значимые изменения коснулись рынка операций репо – относительно проблемного сегмента биржевого рынка в 2009 году. После бесконтрольного использования отдельными профессиональными участниками рынка и их клиентами операций репо⁹ в финансовых пирамидах и схемах по осуществлению „коротких“ продаж данный сектор биржевого рынка оказался под давлением резко возросших кредитных рисков. Основная причина этих рисков

⁹ Речь идет, прежде всего, об операциях репо, осуществляемых „прямым“ способом.

крылась в беспрецедентном для Казахстана падении стоимости предметов операций репо – акций и корпоративных облигаций – в 2008–2009 годах. Кроме того, риски усиливали проблемы с платежеспособностью компаний, основные причины которых описаны в разделе „Создание буферной категории“.

Первые устойчивые сигналы тревоги прозвучали осенью 2008 года, когда под давлением резкого падения цен на рынке акций существенно выросла доля пролонгированных операций репо. 18 декабря 2008 года был зарегистрирован первый случай неисполнения сделки закрытия операции репо, произошедший по вышеуказанной причине. К концу марта доля дефолтов на рынке операций репо, осуществляемых „прямым“ способом, превысила 25 % от стоимости открытых на тот момент обязательств, а доля обязательств, сроки которых были пролонгированы, – 13 %.

В качестве мер реагирования на проблему неисполнения сделок на рынке операций репо поправками во внутренний документ KASE „Правила осуществления операций репо“¹ с 01 января 2009 года был сокращен до 30 дней максимально разрешенный на биржевом рынке срок операций „автоматического“ репо. А 08 января 2009 года Биржевым советом были утверждены и с 25 января введены в действие изменения и дополнения в тот же документ, которые:

- установили максимальный срок операций репо, осуществляемых „прямым“ способом, на уровне 90 дней с учетом всех возможных пролонгаций;
- ввели запрет на продление сроков операций репо, осуществляемых „автоматическим“ способом.

01 апреля 2009 года были введены в действие поправки в Спецификацию рынка автоматического репо¹⁰, призванные снизить риски, источником которых являлось качество непосредственно самих предметов операций репо. Необходимость данных изменений была обусловлена фактами дефолтов эмитентов корпоративных облигаций, а также снижением уровня транспарентности и качества раскрываемой эмитентами инфор-

мации. С этой даты были запрещены к использованию в качестве предметов операций репо:

- ценные бумаги, эмитент которых своевременно не выплатил вознаграждение и/или сумму основного долга по своим долговым бумагам и/или дивиденды по привилегированным акциям;
- ценные бумаги, инициатор допуска которых существенно нарушил предъявляемые к нему Листинговыми правилами и/или Договором о листинге требования по раскрытию информации.

Значимым событием отчетного года стало утверждение Биржевым советом 28 мая 2009 года „Соглашения об общих условиях осуществления операций репо „прямым“ способом“ – приложения к Правилам осуществления операций репо. Соглашение спроектировано в качестве правовой основы для введения в 2010 году системы mark-to-market – непрерывной переоценки обязательств по операциям „прямого“ репо, а также расчета и перечисления компенсационных платежей участниками таких операций в случае критического изменения цен предмета операций репо. Система mark-to-market, являющаяся атрибутом развитого рынка, позволит своевременно выявлять и эффективно нивелировать почти все виды рисков, возникающих на рынке операций „прямого“ репо.

Реализация KASE и АФН вышеописанных мер по регулированию денежного рынка доказала их эффективность: с середины июля 2009 года не было зарегистрировано новых случаев неисполнения обязательств по операциям репо на биржевом рынке.

Совершенствование расчетных процедур

На протяжении 2009 года KASE вела работу по повышению качества расчетов и снижению расчетных рисков на фондовом рынке. Данная работа особенно важна в свете проводимых мероприятий по привлечению местных и зарубежных инвесторов и эмитентов на отечественный фондовый рынок. Статистика по итогам 2009 года демонстрирует высокий уровень

¹⁰ Внутренний документ Биржи „Спецификация рынка автоматического репо“, утвержденный решением Правления ЗАО „Казахстанская фондовая биржа“ от 24 декабря 2002 года № 137/0.

расчетных рисков практически во всех секторах рынка KASE. Например, в 2009 году 10 из 10 компаний – лидеров в рейтингах активности на рынках акций и корпоративных облигаций допустили неисполнение своих расчетных обязательств, на рынке операций репо – 7 из 10, на рынке ГЦБ – 6 из 10.

В отчетном периоде продолжила деятельность рабочая группа по внедрению гарантированной системы расчетов T+N. Результатом работы группы стала разработка концепции, а затем и плана по внедрению названной системы расчетов в два этапа: первый этап предусматривает введение системы полного преддепонирования (предпоставки) по схеме расчетов T+0, которая послужит базой для внедрения гарантированной системы расчетов со схемой T+N на втором этапе.

Приостановка торгов при критическом падении цен

В целях обеспечения соответствия постановлению Правления АФН № 170 („Об утверждении Правил осуществления деятельности организаторов торгов с ценными бумагами и иными финансовыми инструментами“) 08 января 2009 года были утверждены и 25 января введены

в действие поправки во внутренний документ KASE „Правила биржевой торговли ценными бумагами“¹¹, согласно которым:

- в случае снижения цены акции какого-либо наименования из числа находящихся в официальном списке Биржи по первой категории на 30 % и более KASE автоматически приостанавливает торги данными акциями;
- в случае снижения значения Индекса KASE на 15 % и более относительно последнего значения данного индекса за последний или предпоследний предшествующий торговый день KASE автоматически приостанавливает торги всеми акциями, находящимися в официальном списке Биржи¹².

Если никаких других предписаний со стороны АФН на KASE не поступит, во всех перечисленных случаях торги приостанавливаются до начала следующего торгового дня.

В течение отчетного года KASE 19 раз приостанавливала торги акциями отдельных наименований, в том числе три раза – из-за технических ошибок трейдеров. Условий для приостановки торгов по критическому изменению Индекса KASE не возникало.

Повышение уровня корпоративного управления

Решением Биржевого совета KASE от 30 апреля 2009 года новым Президентом KASE был избран Дамитов К.К. со сроком полномочий два года. Ранее в течение семи лет эту должность занимал Джолдасбеков А.М.

До избрания Президентом KASE Дамитов К.К. занимал руководящие должности в ведущих компаниях Казахстана, являлся Председателем Правления АО „Национальная компания „Социально-предпринимательская корпорация

„Ертіс“, работал Советником Президента Республики Казахстан и Председателем Национального Банка Республики Казахстан.

Приоритетными направлениями работы нового Президента стали дальнейшее развитие Биржи и инфраструктуры рынка ценных бумаг в целом, а также повышение уровня корпоративного управления, включая совершенствование внутрикорпоративных бизнес-процессов.

¹¹ Внутренний документ KASE „Правила биржевой торговли ценными бумагами“, утвержденный постановлением Директората Национальной комиссии Республики Казахстан по ценным бумагам от 26 октября 1999 года № 462.

¹² Приводится редакция части упомянутого внутреннего документа с учетом поправок от 11 февраля 2009 года.

Переход к планированию основных бизнес-процессов

В начале отчетного года по заданию Биржевого совета Правлением KASE был разработан План основных работ на 2009 год¹³, который был одобрен Биржевым советом 05 марта и утвержден решением Правления KASE от 25 марта 2009 года. Таким образом, в отчетном году впервые в истории Биржи ее деятельность осуществлялась в соответствии с планом, который был утвержден органом управления.

План разрабатывался в соответствии со Стратегией развития АО „Казахстанская фондовая биржа“ на 2007–2010 годы и охватывал основные направления развития KASE, а также вопросы совершенствования порядков и технологий, которые используются на Бирже. Правление ежемесячно отчитывалось Биржевому совету о ходе выполнения Плана. Итоговый отчет по исполнению Плана в 2009 году был принят Биржевым советом 28 января 2010 года, при этом к Правлению со стороны Биржевого совета замечаний высказано не было.

Подготовка к внедрению системы оценки деятельности работников

В 2009 году в результате изучения нескольких концепций, используемых в международной и казахстанской практике при оценке деятельности персонала, Правлением Биржи были разработаны и согласованы с Биржевым советом основные принципы оценки деятельности работников KASE, которые легли в основу нового внутреннего документа „Порядок оценки деятельности работников АО „Казахстанская фондовая биржа“. 31 декабря 2009 года документ был утвержден Правлением с вводом его в действие с 01 января 2010 года.

Таким образом, в результате проделанной в отчетном году работы на KASE с начала 2010 года запущен механизм оценки деятельности ее персонала, который включает в себя как персональную оценку каждого работника, так и оценку деятельности каждого подразделения. Оценка осуществляется ежемесячно по разработанным

показателям эффективности деятельности, перечень которых установлен вышеуказанным документом.

Создание Службы внутреннего аудита и Комитета по аудиту

В рамках реализации стратегии по совершенствованию системы корпоративного управления в 2009 году был предпринят ряд мер по развитию и укреплению внутреннего контроля и повышению уровня корпоративной прозрачности деятельности KASE.

В июне 2009 года была организована Служба внутреннего аудита, для работы в которой привлечен специалист с опытом работы более 10 лет в финансовом секторе, в том числе девять лет – на управленческих должностях и два года – в роли руководителя службы внутреннего аудита в одном из ведущих иностранных банков в Республике Казахстан.

В августе отчетного года Решением Биржевого совета сформирован Комитет по внутреннему аудиту. В соответствии с рекомендуемыми стандартами корпоративного управления для достижения объективности и независимости в работе этого органа его состав сформирован в основном из членов Биржевого совета, которые не являются членами исполнительного органа KASE. Возглавил комитет один из независимых директоров Биржи.

В течение 2009 года Службой внутреннего аудита проведены внутренние аудиты финансовой отчетности дочернего ТОО „РТРС“, процесса инвентаризации и инвестирования собственных активов Биржи, а также составлен план аудитов на первый и второй кварталы 2010 года, которые охватывают области основной деятельности KASE, либо области с наиболее высокими рисками.

Получение полного контроля над дочерними организациями

С целью повышения прозрачности корпоративной структуры биржевой группы и исключе-

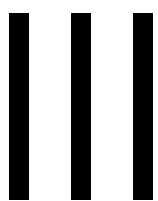
¹³ Далее в настоящем разделе – План.

ния возможности возникновения потенциальных конфликтов интересов в 2009 году Биржей были предприняты действия по получению полного контроля над двумя своими дочерними организациями.

27 августа Биржевой совет принял решение о выкупе доли в ТОО eTrade.kz в размере 48,6 %, которая принадлежала четырем физическим лицам – работникам Биржи. 26 ноября Биржевой совет принял решение о выкупе у ТОО „Кенес Сервис К“ 20%-ной доли в ТОО „Информационное агентство финансовых рынков „ИРБИС“. Обе сделки были закрыты в отчетном году.

Преследуя цели, изложенные в начале этого раздела, в дополнение к описанному Правление

KASE инициировало внесение поправок в устав ТОО „Информационное агентство финансовых рынков „ИРБИС“, меняющих структуру управления товариществом. 24 декабря 2009 года Биржевой совет утвердил поправки, согласно которым контроль за текущей деятельностью товарищества должен осуществлять Наблюдательный совет, состоящий из трех человек – руководящих работников KASE. Первый состав Наблюдательного совета был избран Биржевым советом 28 января 2010 года на двухлетний срок. В совет вошли Президент KASE и два члена Биржевого совета.



Финансовые итоги 2009 года

Анализ активов и обязательств¹⁴

По состоянию на 31 декабря 2009 года активы Биржи составили 1 808,6 млн тенге, что на 26,7 % выше, чем годом ранее. Рост активов происходил в основном за счет нераспределенного дохода за отчетный период, основная часть которого аккумулировалась Биржей в виде краткосрочных активов. Деньги и их эквиваленты увеличились в 2009 году в два раза с 452,6 млн тенге до 906,6 млн тенге и составили почти половину всех активов Биржи или 87,6 % от суммы краткосрочных активов.

Аккумуляция входящих денежных потоков от операционной деятельности в течение 2009 года осуществлялась Биржей в целях создания дополнительных резервов, за счет которых Биржа могла бы покрыть все необходимые расходы в случае непредвиденных ситуаций, а также в целях накопления достаточной суммы для приобретения собственного здания, что в будущем позволит Бирже получить существенную экономию на расходах по арендной плате (см. ниже).

Следует также отметить, что в связи с долгосрочными инвестиционными целями Биржи ее портфель ценных бумаг был реклассифицирован в бухгалтерском балансе в 2009 году с „имеющегося в наличии для продажи“ на „удерживаемый до погашения“. Доля финансовых активов, удерживаемых до погашения, составила в 2009 году 26,7 % от всех активов Биржи (в 2008 году доля активов, имевшихся в наличии для продажи, составляла 23,7 % от всех активов).

В 2009 году долгосрочные обязательства Биржи состояли только из отложенных налоговых обязательств, объем которых не превысил 15,0 млн тенге. Показатель долгосрочного долга к активам по итогам года составил 0,8 %, показатель долгосрочного долга к капиталу – 0,9 %. При этом получение Биржей чистого дохода в 2009 году в размере 369,7 млн тенге увеличило объем ее собственного капитала на 27,5 % до 1 717,3 млн тенге.

Анализ доходов и расходов

Доходы Биржи в 2009 году составили 1 297,6 млн тенге, что на 17,5 % выше показателя предыдущего года. Доходы от основной деятельности (рис. 10) выросли в отчетном году на 25,6 % до 1 197,0 млн тенге, из которых около 90 % пришлось на комиссионные и листинговые сборы, а также членские взносы. Структура комиссионных сборов Биржи приведена на рис. 11.

Доходы по членским взносам

Членские взносы выросли в отчетном периоде на 7,4 % с 198,9 млн тенге (22,4 % от доходов) до 213,6 млн тенге (18,9 %). Рост данной статьи дохода был связан с увеличением на 8,9 % размера МРП (который служит базисом для расче-

та членских взносов), в то время как количество членов Биржи в течение 2009 года снизилось с 98 до 83. Последнее объясняется добровольным выходом из числа членов KASE компаний, которые являлись членами Биржи по категории „А“ (в связи с объединением СТП РФЦА и ОТП KASE) и прекращением деятельности некоторых брокерских компаний.

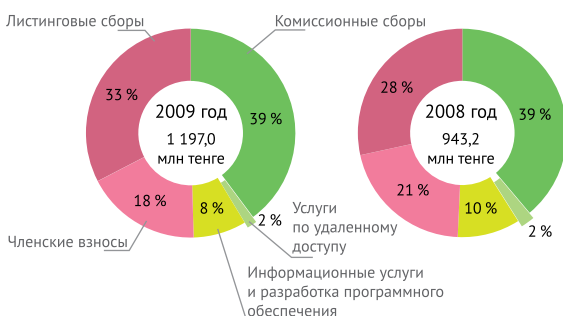
Доходы по листинговым сборам

Несмотря на снижение общего количества листинговых компаний в 2009 году со 144 до 127, количество корпоративных ценных бумаг, находящихся в официальном списке KASE, увеличилось к концу года до 415 (с 376 годом ранее).

¹⁴ Здесь и далее в настоящем разделе, если не указано иное, используются данные аудированной консолидированной финансовой отчетности KASE, а сравнение приводится относительно соответствующего периода 2008 года.

Рисунок 10

Структура доходов Биржи от основной деятельности в 2009 и 2008 годах



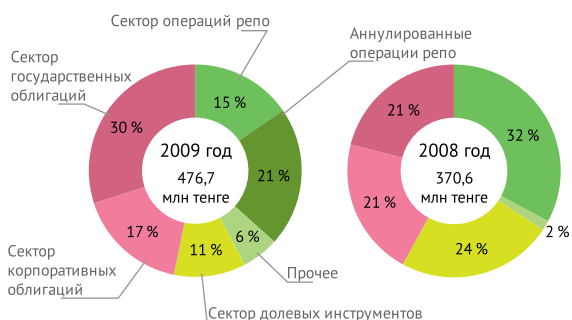
Вследствие этого, а также под влиянием событий разового характера (см. ниже), объем вступительных и ежегодных листинговых сборов в 2009 году вырос на 44,1% и достиг 390,4 млн тенге. Позитивное влияние на объем листинговых сборов также оказала унификация листинговых требований в 2008 году и объединение в 2009 году СТП РФЦА и ОТП KASE, что в итоге внесло ясность в вопросы листинга и инвестирования на казахстанском фондовом рынке. В то же время существенное негативное влияние на количество листингов долговых ценных бумаг (и как следствие на объем листинговых сборов) оказал „кризис доверия“, вызванный неисполнением некоторыми листинговыми компаниями своих обязательств по обслуживанию облигаций. Под воздействием данного фактора стоимость фондирования на местном рынке выросла до величин, неприемлемых для большинства отечественных эмитентов ценных бумаг.

Доходы по комиссионным сборам

В результате неблагоприятной обстановки на отечественном фондовом рынке во второй половине 2008 – первой половине 2009 года в отчетном периоде наблюдался отток инвестиций в другие классы активов или на зарубежные площадки. На ситуацию повлияло также ужесточение правил в смежном с рынками акций и облигаций секторе операций „прямого“ репо (см. Краткое описание конъюнктуры рынка в 2009 году), что в итоге ограничило возможности участников осуществлять на фондовом рынке продажи без покрытия и торговлю с кредитным плечом.

Рисунок 11

Структура комиссионных сборов Биржи в 2009 и 2008 годах



В итоге объем комиссионных сборов со сделок купли-продажи долевого инструмента (без учета сделок, заключенных в режиме специализированных торгов) снизился на 40,6% до 52,0 млн тенге при падении объема торгов на 45,1%.

Снижение объема торгов корпоративными облигациями на 12,1% в отчетном периоде было компенсировано ростом доли „прямых“ сделок с данным видом ценных бумаг с 1,0% до 2,0%, в результате чего объем комиссионных сборов с данного рынка вырос на 2,8%.

На рынке государственных ценных бумаг объем комиссионных сборов вырос на 84% до 142,9 млн тенге (30% от итогового объема комиссионных сборов), что явилось результатом сравнительно высокой эмиссионной активности Министерства финансов, повышенного спроса на инструменты с минимальным риском (см. Краткое описание конъюнктуры рынка в 2009 году) и, как следствие, увеличения объема торгов ГЦБ на 50,1%.

Предоставление денег банкам второго уровня в рамках государственной поддержки вкупе с замедлением темпов кредитования экономики сказалось на снижении ставок и объемов торгов на рынке операций репо. В течение большей части отчетного периода на казахстанском финансовом рынке наблюдалась избыточная ликвидность по тенге, в результате чего объем комиссионных сборов с рынка операций репо (за вычетом доходов по аннулированным операциям) составил 73,4 млн тенге, что ниже показателя 2008 года на 39,6%¹⁵.

¹⁵ Размер комиссионного сбора с операций репо зависит как от объема самой операции, так и от величины ставки репо.

Доходы от событий разового характера

Нужно отметить, что на финансовые результаты деятельности KASE в 2009 году значительное влияние оказали события разового характера.

В течение отчетного года на KASE был проведен листинг нескольких выпусков облигаций, которые не обращались на открытом рынке и были использованы в качестве предмета операций репо при получении проблемными банками ликвидности от Национального Банка Республики Казахстан. Суммарные листинговые сборы по названным выпускам составили в 2009 году 96,9 млн тенге при общем доходе Биржи от ежегодных и вступительных листинговых сборов в сумме 390,4 млн тенге. То есть почти 25 % доходов по листинговым сборам в отчетном году пришлось на специфические ценные бумаги, которые де-факто не торговались на KASE.

Кроме того, в 2009 году KASE было собрано 101,4 млн тенге комиссионных сборов с аннулированных операций репо. Эти доходы явились следствием череды дефолтов по операциям „прямого“ репо, которые, в свою очередь, стали результатом высоких кредитных, рыночных и расчетных рисков в первом полугодии 2009 года и, в немалой степени, были вызваны изменениями в Правилах осуществления операций репо (см. Мероприятия по снижению уровня рисков). В случае регламентного закрытия названных операций репо доходы KASE были бы меньше.

Следует также напомнить, что 25 ноября 2009 года в ТС KASE были проведены специализированные торги по продаже компанией Central Asia Petroleum Ltd акций АО „Мангистаунайгаз“ компании Mangistau Investments

В.В., являющейся совместным предприятием АО „Национальная компания „КазМунайГаз“ и CNPC Exploration and Development Company Ltd. Объем сделки составил 387,6 млрд тенге, а объем комиссионных сборов с данной транзакции достиг 19,4 млн тенге – 24,7 % от всех комиссионных сборов с биржевого рынка акций.

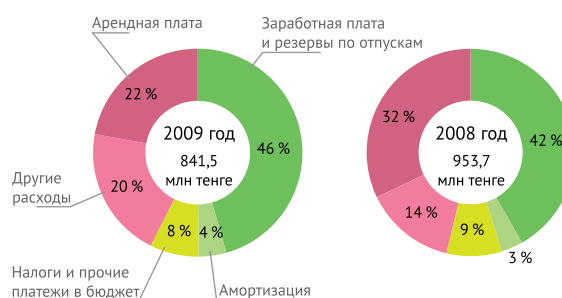
Все вышеуказанные события рассматриваются Биржей как события разового характера с малой вероятностью повторения их в будущем. Суммарный доход от них оценивается в 217,7 млн тенге, что составляет 16,8 % от всех доходов KASE за 2009 год.

Расходы

В 2009 году Биржей были предприняты усилия по уменьшению ее основных расходов. В результате предпринятых действий руководству Биржи удалось снизить стоимость аренды фронт-офиса приблизительно на 39 %. В 2008 году на данную статью расходов приходилось около 32 % всех расходов; в 2009 году доля аренды снизилась до 22 % (рис. 12). В итоге общие расходы Биржи сократились на 11,8 % до 841,5 млн тенге.

Рисунок 12

Структура расходов Биржи в 2009 и 2008 годах



Основные финансовые показатели деятельности Биржи

В результате роста доходов KASE на 17 % и снижения расходов на 11,8 % в 2009 году консолидированный чистый доход Биржи вырос по сравнению с 2008 годом в 3,1 раза до 369,7 млн тенге.

Показатель EBITDA оценивается в 492,4 млн тенге (183,5 млн тенге в 2008 году), операционная прибыль (ЕБИТ) составила 456,1 млн тенге (151,0 млн тенге в 2008 году).

Показатель рентабельности активов (ROA) составил в 2009 году 20,4 % (8,5 % в 2008 году), показатель возврата на капитал (ROE) – 21,5 % (9,0 % соответственно). Рост последнего стал возможным благодаря улучшению показателя маржи чистой прибыли (net profit margin) с 10,9 % до 28,4 % при относительно низком показателе финансового левереджа (отношение активов к капиталу составило 1,05х).

Помимо этого, Биржа в течение отчетного периода имела хорошие ликвидные позиции. Коэффициент абсолютной ликвидности (cash ratio) составил 11,9х, коэффициент текущей ликвидности (current ratio) – 13,6х (6,6х и 10,1х в 2008 году соответственно).

IV

Консолидированная
финансовая отчетность группы
KASE за 2009 год



31 марта 2010 г.

Отчет независимых аудиторов

Мы провели аудит прилагаемой консолидированной финансовой отчетности АО „Казахстанская фондовая биржа“ и ее дочерних компаний (далее – Группы), состоящей из отчета о финансовом состоянии по состоянию на 31 декабря 2009 года, отчета о совокупном доходе, отчета об изменениях в собственном капитале и отчета о движении денежных средств за период, закончившийся на указанную дату, а также краткого описания существенных элементов учетной политики и прочей пояснительной информации.

Ответственность руководства субъекта за консолидированную финансовую отчетность

Ответственность за подготовку и справедливое представление этой консолидированной финансовой отчетности в соответствии с Международными стандартами финансовой отчетности несет руководство Группы. Эта ответственность включает: разработку, внедрение и поддержание внутреннего контроля, связанного с подготовкой и справедливым представлением консолидированной финансовой отчетности, не содержащей существенных искажений, вызванных мошенничеством или ошибкой; выбор и применение надлежащей учетной политики, и обоснованность расчетных оценок.

Ответственность аудитора

Наша ответственность заключается в выражении мнения об этой консолидированной финансовой отчетности на основании проведенного нами аудита. Мы провели аудит в соответствии с Международными стандартами аудита. Данные стандарты обязывают нас выполнять этические требования, а также планировать и проводить аудит таким образом, чтобы обеспечить разумную уверенность в том, что консолидированная финансовая отчетность не содержит существенных искажений. Аудит включает выполнение процедур для получения аудиторских доказательств по суммам и раскрытиям информации в консолидированной финансовой отчетности. Выбранные процедуры зависят от суждения аудитора, включая оценку рисков существенных искажений в консолидированной финансовой отчетности, вызванных мошенничеством или ошибкой. При оценке таких рисков, с целью разработки аудиторских процедур, соответствующих обстоятельствам, но не с целью выражения мнения об эффективности внутреннего контроля субъекта, аудитор должен изучить внутренний контроль, связанный с подготовкой и справедливым представлением консолидированной финансовой отчетности субъекта. Аудит также включает оценку приемлемости характера применяемой учетной политики и обоснованность расчетных оценок, сделанных руководством, а также оценку общего представления консолидированной финансовой отчетности. Мы считаем, что полученные нами аудиторские доказательства, являются достаточными и надлежащими для предоставления основы для выражения нашего аудиторского мнения.

Мнение

По нашему мнению, консолидированная финансовая отчетность представляет справедливо во всех существенных аспектах финансовое состояние Группы по состоянию на 31 декабря 2009 года, финансовые результаты деятельности и движение денежных средств за год, закончившийся на указанную дату, в соответствии с Международными стандартами финансовой отчетности.

Аудитор

Таипова Р.К.

Квалификационное свидетельство аудитора № 497,
выданное Квалификационной комиссией
по аттестации аудиторов РК от 18.02.2000 г.

Заявление об ответственности за подготовку консолидированной финансовой отчетности за 2009 год

Мы, нижеподписавшиеся, представляющие руководство АО „Казахстанская фондовая биржа“ (далее – Биржа) и отвечающие за подготовку ее консолидированной финансовой отчетности, заявляем, что финансовая отчетность Биржи на конец 31 декабря 2009 года достоверно отражает во всех существенных аспектах результаты ее деятельности, движение денег и изменения в собственном капитале за 2009 финансовый год в соответствии с Международными стандартами финансовой отчетности (МСФО).

При подготовке консолидированной финансовой отчетности Биржи ее руководство несет ответственность за:

- выбор надлежащих принципов бухгалтерского учета и их последовательное применение
- применение обоснованных оценок и расчетов
- соблюдение требований МСФО или раскрытие всех существенных отклонений от МСФО в примечаниях к консолидированной финансовой отчетности
- подготовку консолидированной финансовой отчетности Биржи, исходя из допущения, что она будет продолжать свою деятельность в обозримом будущем, за исключением случаев, когда такое допущение неправомерно

Руководство Биржи также несет ответственность за:

- разработку, внедрение и обеспечение функционирования эффективной и надежной системы внутреннего контроля внутри Биржи
- поддержание системы бухгалтерского учета, позволяющей в любой момент подготовить с достаточной степенью точности информацию о финансовом положении Биржи и обеспечить соответствие ее консолидированной финансовой отчетности требованиям МСФО
- ведение бухгалтерского учета в соответствии с законодательством Республики Казахстан
- принятие мер в пределах своей компетенции для защиты активов Биржи
- выявление и предотвращение фактов мошенничества и прочих злоупотреблений

Данная финансовая отчетность утверждена руководством Биржи в лице Президента и главного бухгалтера.

Президент

Дамитов К.К.

Главный бухгалтер

Рябушкина Л.А.

Консолидированный отчет о финансовом состоянии¹⁶

тыс. тенге			
Показатели	Прим.	На 31 декабря 2009 года ¹⁷	На 31 декабря 2008 года
Активы			
I. Краткосрочные активы			
Деньги и их эквиваленты	5	906 550	452 598
Деньги, ограниченные в использовании	6	1 504	5 460
Торговая и прочая дебиторская задолженность	7	52 203	64 160
Предварительно оплаченная аренда и прочие авансы выданные	8	38 399	119 964
Запасы	9	1 091	1 728
Авансовые платежи по корпоративному подоходному налогу		-	28 175
Текущие налоговые активы	10	2 190	5 634
Финансовые активы, имеющиеся в наличии для продажи	11	-	9 830
Финансовые активы, удерживаемые до погашения	11	34 859	-
Итого краткосрочных активов		1 036 796	687 549
II. Долгосрочные активы			
Финансовые активы, оцениваемые по справедливой стоимости через прибыль или убыток	11	-	68 387
Финансовые активы, имеющиеся в наличии для продажи	11	27 814	337 734
Финансовые активы, удерживаемые до погашения	11	483 533	-
Инвестиции, учитываемые методом долевого участия	12	35 053	82 143
Основные средства	13	221 206	242 798
Нематериальные активы	14	3 576	4 386
Отложенные налоговые активы	17	612	4 000
Итого долгосрочных активов		771 794	739 448
Итого активов		1 808 590	1 426 997
Обязательства и капитал			
III. Краткосрочные обязательства			
Обязательства перед членами биржи по деньгам, ограниченным в использовании	6	1 504	5 460
Обязательства по корпоративному подоходному налогу		12 075	-
Обязательства по налогам и платежам в бюджет	15	5 604	2 597
Торговая и прочая кредиторская задолженность	16	7 897	2 950
Предварительно оплаченная субаренда и прочие авансы полученные	16	31 762	42 139
Краткосрочные оценочные обязательства	16	17 493	15 161
Итого краткосрочных обязательств		76 335	68 307
IV. Долгосрочные обязательства			
Отложенные налоговые обязательства	17	14 947	12 065
Итого долгосрочных обязательств		14 947	12 065
V. Капитал			
Акционерный капитал	18	194 418	165 020
Резервы	11	(572)	7 185

¹⁶ Консолидированный отчет о финансовом состоянии следует читать вместе с примечаниями к консолидированной финансовой отчетности, являющимися ее неотъемлемой частью (http://www.kase.kz/files/for_shareholders/kasef6_2009.pdf).

¹⁷ Здесь и далее в консолидированном отчете о финансовом состоянии под 31 декабря какого-либо года понимается 24:00 алматинского времени 31 декабря данного года.

Консолидированный отчет о финансовом состоянии (продолжение)

Показатели	Прим.	тыс. тенге	
		На 31 декабря 2009 года	На 31 декабря 2008 года
Нераспределенный доход		1 523 462	1 159 251
Доля меньшинства		-	15 169
Итого капитала		1 717 308	1 346 625
Итого обязательств и капитала		1 808 590	1 426 997

Президент

Дамитов К.К.

Главный бухгалтер

Рябушкина Л.А.

Консолидированный отчет о совокупном доходе¹⁸

тыс. тенге, если не указано иное

Показатели	Прим.	За 2009 год	За 2008 год
Доходы от основной деятельности	21	1 196 993	953 242
Доход от аренды		60 968	130 450
Прочие доходы		11 251	8 820
Нетто-доходы от реализации финансовых активов	21	(2 709)	6 158
Нереализованный доход по финансовым активам		4 271	6 206
Полученные штрафы и неустойки		26 858	24 159
Убыток, ранее признанный в капитале, от реализации финансовых активов, имеющих в наличии для продажи		-	(24 270)
Итого доходов		1 297 632	1 104 765
Расходы по заработной плате и резервам по отпускам		(383 540)	(398 581)
Налоги и прочие платежи в бюджет		(63 628)	(81 795)
Амортизация		(36 292)	(32 482)
Командировочные и представительские расходы		(17 382)	(24 343)
Расходы на связь и Интернет		(16 753)	(17 099)
Списание материалов		(8 974)	(13 122)
Расходы по обслуживанию S.W.I.F.T., членским взносам и услугам сертификации		(6 309)	(5 815)
Арендная плата		(186 406)	(306 191)
Нетто-убыток от реализации основных средств		(1 863)	(132)
Услуги финансовых консультантов		-	(12 100)
Прочие расходы	22	(120 365)	(62 082)
Итого расходов		(841 512)	(953 742)
Прибыль за период от операционной деятельности		456 120	151 023
Процентные доходы	23	55 829	29 203
Процентные доходы по депозиту	23	27 558	565
Процентные расходы	23	(326)	(381)
Процентный доход за период		83 061	29 387
Доля прибыли/убытка организаций, учитываемых по методу долевого участия		(47 090)	(4 468)
Прибыль до налогообложения		492 091	175 942
Расходы по корпоративному подоходному налогу	17	(122 421)	(54 784)
Чистая прибыль за период		369 670	121 158
Прочие изменения за год		(7 757)	7 185
Совокупный доход		361 913	128 343
Итого совокупный доход за год		361 913	128 343
Прибыль, относящаяся к основным акционерам		369 670	115 435
Прибыль, относящаяся к меньшинству		-	5 723
Прибыль на акцию (базовая и разводненная), тенге	20	820,29	257,52

Президент

Дамитов К.К.

Главный бухгалтер

Рябушкина Л.А.

¹⁸ Консолидированный отчет о совокупном доходе следует читать вместе с примечаниями к консолидированной финансовой отчетности, являющимися ее неотъемлемой частью (http://www.kase.kz/files/for_shareholders/kasef6_2009.pdf).

Консолидированный отчет об изменениях в собственном капитале¹⁹

	тыс. тенге					
	Акционерный капитал ²⁰	Выкупленные собственные акции	Резерв по переоценке ²¹	Нераспределенный доход ²²	Доля меньшинства	Итого
На 31 декабря 2007 года ²³	165 020	(2 567)	(16 179)	1 043 816	11 091	1 201 181
Проданные выкупленные собственные акции в отчетном периоде	-	2 567	-	-	-	2 567
Изменение стоимости ценных бумаг, имеющих в наличии для продажи	-	-	(906)	-	-	(906)
Убыток, ранее признанный в капитале от реализации финансового актива для продажи	-	-	24 270	-	-	24 270
Нераспределенный доход отчетного периода	-	-	-	115 435	5 723	121 158
Дивиденды	-	-	-	-	(1 645)	(1 645)
На 31 декабря 2008 года	165 020	-	7 185	1 159 251	15 169	1 346 625
Дополнительно размещенные собственные акции в отчетном периоде	29 398	-	-	-	-	29 398
Приобретение доли меньшинства	-	-	-	(5 459)	(13 528)	(18 987)
Уменьшение доли меньшинства в части уставного капитала	-	-	-	-	(1 115)	(1 115)
Совокупный доход отчетного периода	-	-	(7 757)	369 670	-	361 913
Дивиденды	-	-	-	-	(526)	(526)
На 31 декабря 2009 года	194 418	-	(572)	1 523 462	-	1 717 308

Президент

Дамитов К.К.

Главный бухгалтер

Рябушкина Л.А.

¹⁹ Консолидированный отчет об изменениях в собственном капитале следует читать вместе с примечаниями к консолидированной финансовой отчетности, являющимися ее неотъемлемой частью (http://www.kase.kz/files/for_shareholders/kasef6_2009.pdf).

²⁰ Акционерный капитал представляет собой суммарную стоимость размещенных акций по цене их размещения.

²¹ Резерв по переоценке представляет собой амортизируемую часть после реклассификации финансовых активов из категории „имеющиеся в наличии для продажи“ в категорию „удерживаемые до погашения“.

²² Нераспределенный доход представляет собой накопленную прибыль Группы (АО „Казахстанская фондовая биржа“ и его дочерних организаций).

²³ Здесь и далее в консолидированном отчете об изменениях в собственном капитале под 31 декабря какого-либо года понимается 24:00 алматинского времени 31 декабря данного года.

Консолидированный отчет о движении денег²⁴

Показатели	тыс. тенге	
	За 2009 год	За 2008 год
Денежные потоки от операционной деятельности		
Прибыль до налогообложения	492 091	175 943
Корректировка чистой прибыли, в том числе на:	94 475	(150 800)
амортизацию	36 292	32 482
нереализованный доход от переоценки финансовых активов	(4 271)	(6 206)
убыток от выбытия основных средств	1 863	132
доход от выбытия финансовых активов	2 709	(6 158)
амортизацию премии или дисконта по финансовым активам	326	381
процентный доход	(55 829)	(29 203)
начисленный доход по депозитам	(19 588)	-
долю прибыли/убытка организаций, учитываемых по методу долевого участия	47 090	4 468
убыток, ранее признанный в капитале, от реализации финансовых активов, имеющих в наличии для продажи	-	24 270
убыток от обесценения финансовых активов	65 292	-
увеличение запасов	637	1 826
увеличение торговой и прочей дебиторской задолженности, предварительно оплаченной аренды и прочих авансов выданных	93 522	21 181
увеличение (уменьшение) предварительно оплаченной субаренды и прочих авансов полученных	(10 377)	(13 396)
увеличение (уменьшение) задолженности по налогам	6 451	(2 505)
увеличение (уменьшение) торговой и прочей кредиторской задолженности, краткосрочных оценочных обязательств	7 279	2 043
увеличение (уменьшение) обязательств перед членами биржи по деньгам, ограниченным в использовании	(3 956)	(137 196)
корпоративный подоходный налог уплаченный	(72 965)	(42 919)
Чистые денежные потоки от операционной деятельности	586 566	25 143
Денежные потоки от инвестиционной деятельности		
Приобретение основных средств и нематериальных активов	(16 269)	(100 648)
Поступления от продажи основных средств и нематериальных активов	567	-
Приобретение финансовых активов	(1 213 305)	(858 762)
Погашение финансовых активов	1 005 920	1 150 160
Вознаграждение, полученное по финансовым активам	40 995	28 292
Вознаграждение, полученное по депозитам	16 650	-
Перечисление (поступление) денег, ограниченных в использовании	3 956	137 196
Чистые денежные потоки от инвестиционной деятельности	(161 486)	356 238
Денежные потоки от финансовой деятельности		
Поступление от размещения акций	29 398	-
Поступления от продажи выкупленных собственных акций	-	2 567
Выплаченные дивиденды меньшинству	(526)	(1 645)
Чистые денежные потоки от финансовой деятельности	28 872	922

→

²⁴ Консолидированный отчет о движении денег следует читать вместе с примечаниями к консолидированной финансовой отчетности, являющимися ее неотъемлемой частью (http://www.kase.kz/files/for_shareholders/kasef6_2009.pdf).

Консолидированный отчет о движении денег (продолжение)

Показатели	тыс. тенге	
	За 2009 год	За 2008 год
Чистое увеличение денег и их эквивалентов	453 952	382 303
Деньги и их эквиваленты на начало года	452 598	70 295
Деньги и их эквиваленты на конец года	906 550	452 598

Президент

Дамитов К.К.

Главный бухгалтер

Рябушкина Л.А.

V

Книга фактического
материала

Содержание:

Акции и акционеры	46
Члены KASE	47
Статистическая характеристика биржевого рынка Казахстана в 2009 году	51
Рынок долевых ценных бумаг	54
Рынок корпоративных долговых ценных бумаг	67
Рынок государственных ценных бумаг	83
Рынок облигаций МФО	91
Рынок операций репо	92
Рынок иностранных валют	98
Индикаторы межбанковских депозитов	103
Справочная информация	104
Пояснения к книге фактического материала	140

Акции и акционеры

Таблица 1

Список акционеров KASE по состоянию на 01 января 2010 года

Наименования акционеров KASE	Число принадлежащих акций, шт.	Доля в общем количестве размещенных акций, %
АО „Региональный финансовый центр города Алматы“	55 200	12,05
АО „Kaspi Bank“	24 000	5,24
АО „ДОЧЕРНИЙ БАНК „КАЗАХСТАН-ЗИРААТ ИНТЕРНЕШНЛ БАНК“	18 000	3,93
ТОО „Сентрас Капитал“	12 538	2,74
ТОО „Управление проектами“	√ 12 538	2,74
АО „Казкоммерц Секьюритиз“ (дочерняя организация АО „Казкоммерцбанк“)	12 369	2,70
АО „Банк ЦентрКредит“	12 266	2,68
АО „Регистраторская система ценных бумаг“	√ 12 266	2,68
ТОО „VISOR Holding“ (ВИЗОР холдинг)	√ 12 266	2,68
АО „Инвестиционный Финансовый Дом „RESMI“	12 000	2,62
АО Дочерний Банк „RBS (Kazakhstan)“	12 000	2,62
АО „Астана-Финанс“	11 244	2,46
АО „Сентрас Секьюритиз“	6 402	1,40
АО „VISOR Capital“ (ВИЗОР Капитал)	6 268	1,37
АО „Дочерняя организация Народного Банка Казахстана „Nalyk Finance“	6 268	1,37
АО „Накопительный пенсионный фонд Народного Банка Казахстана, дочерняя организация АО „Народный Банк Казахстана“	6 268	1,37
ТОО „АКВАЛЮКС“	√ 6 268	1,37
АО „Компания „CAIFC“	6 183	1,35
АО „Seven Rivers Capital“ („Севен Риверс Капитал“)	6 180	1,35
АО „Народный сберегательный банк Казахстана“	6 134	1,34
АО „BCC Invest“ – дочерняя организация АО „Банк ЦентрКредит“	6 133	1,34
АО „НОМЕБРОКЕР“	6 133	1,34
АО „Альянс Банк“	6 133	1,34
АО „Дочерняя организация акционерного общества „БТА Банк“ „БТА Секьюритис“	6 133	1,34
АО „Казкоммерцбанк“	6 133	1,34
АО „Накопительный пенсионный фонд „ГНПФ“	6 133	1,34
АО „Нурбанк“	6 133	1,34
АО „Тенгри Финанс“	6 133	1,34
АО „Цесна Капитал“	6 133	1,34
АО „Цеснабанк“	6 133	1,34
АО Организация, осуществляющая инвестиционное управление пенсионными активами „GRANTUM Asset Management“ (дочерняя организация АО „Казкоммерцбанк“)	6 133	1,34
Дочерний Банк АО „HSBC Банк Казахстан“	6 133	1,34
ТОО „КАУЖАР“	6 133	1,34
АО „СЕНИМ-БАНК“	6 010	1,31
АО „Delta Bank“	6 000	1,31
АО „Алан Секьюритис“	6 000	1,31
АО „Алматинский Финансовый Центр“	6 000	1,31
АО „АТФБанк“	6 000	1,31
АО „БанкПозитив Казахстан (Дочерний банк Банка Апоалим Б.М.)“	6 000	1,31
АО „Банк Развития Казахстана“	6 000	1,31
АО „БТА Банк“	6 000	1,31
АО „ДБ Секьюритиз (Казахстан)“	6 000	1,31

→

Таблица 1 (продолжение)

Наименования акционеров KASE	Число принадлежащих акций, шт.	Доля в общем количестве размещенных акций, %
АО „Казинвестбанк“	6 000	1,31
АО „Ситибанк Казахстан“	6 000	1,31
АО „Управляющая компания „Алем“	6 000	1,31
АО „Хоум Кредит Банк“	6 000	1,31
Дочерний Банк АО „Сбербанк России“	6 000	1,31
Дочерняя организация Акционерного общества „БТА Банк“-АО „Темірбанк“	6 000	1,31
АО „Финансовая компания „REAL-INVEST.kz“	√ 5 087	1,11
Goodmorning Shinhan Securities Co., Ltd	5 000	1,09
Prime Global Co, Ltd	5 000	1,09
АО „General Asset management“	3 066	0,67
АО „REAL ASSET MANAGEMENT“	1 022	0,22
АО „Брокерская компания „Астана-Финанс“	1 022	0,22
АО „Финансовая компания „Альянс Капитал“	1 000	0,22
АО „Финансовая компания „Greenwich Capital Management“	22	<0,1
АО „Страховая компания „Алатау“	√ 1	<0,1
Физические лица	10 290	2,25
Итого 63 акционера, из них 6 – новых	457 907	100,00

См. раздел „Пояснения к книге фактического материала“

Таблица 2

Список компаний, ставших акционерами KASE в 2009 году

Имена акционеров KASE	Количество приобретенных акций, шт.
ТОО „Управление проектами“	12 538
АО „Регистраторская система ценных бумаг“	12 266
ТОО „VISOR Holding“ (ВИЗОР холдинг)	12 266
ТОО „АКВАЛЮКС“	6 268
АО „Финансовая компания „REAL-INVEST.kz“	5 087
АО „Страховая компания „Алатау“	1
Всего 6 акционеров	48 426

Члены KASE

Таблица 3

Список членов KASE по состоянию на 01 января 2010 года

Наименование члена KASE	Код категории членства					
	„А“	„В“	„С“	„К“	„Р“	„Н“
АО „Aibn Asset Management“	√			√	√	√
АО „AsiaCredit Bank (АзияКредит Банк)“		√		√	√	
АО „BCC Invest“ – дочерняя организация АО „Банк ЦентрКредит“	√			√	√	√
АО „Delta Bank“		√		√	√	
АО „FATTAN FINANCE“	√			√	√	√
АО „HOMEBROKER“	√	√		√	√	√
АО „Kaspi Bank“		√		√	√	

→

Таблица 3 (продолжение)

Наименование члена KASE	Код категории членства					
	„А“	„В“	„С“	„К“	„Р“	„Н“
АО „NOMAD FINANCE“	√			√	√	√
АО „Premier Capital“	√			√	√	√
АО „Prime Financial Solutions“	√			√	√	√
АО „Seven Rivers Capital“ („Севен Риверс Капитал“)	√			√	√	√
АО „Smart Group“	√			√	√	√
АО „Unicorn IFC“	√			√	√	√
АО „VISOR Capital“ (ВИЗОР Капитал)	√			√	√	√
АО „VOSTOK CAPITAL“	√			√	√	√
АО „Zurich Invest Management“	√			√	√	√
АО „Алиби Секьюритиз“	√			√	√	√
АО „Альянс Банк“		√		√	√	
АО „АСЫЛ-ИНВЕСТ“	√			√	√	√
АО „АТФБанк“		√		√	√	
АО „Банк Развития Казахстана“		√		√	√	
АО „Банк ЦентрКредит“		√		√	√	
АО „БанкПозитив Казахстан (Дочерний банк Банка Апоалим Б.М.)“		√		√	√	
АО „Брокерская компания „Астана-Финанс“	√			√	√	√
АО „БТА Банк“		√	√	√	√	
АО „Верный Капитал“	√			√	√	√
АО „ДБ Секьюритиз (Казахстан)“				√	√	√
АО „ДОЧЕРНИЙ БАНК „КАЗАХСТАН-ЗИРААТ ИНТЕРНЕШНЛ БАНК“		√		√	√	
АО „Дочерняя организация акционерного общества „БТА Банк“ „БТА Секьюритис“	√		√	√	√	√
АО „Дочерняя организация АО „Нурбанк“ „MONEY EXPERTS“	√			√	√	√
АО „Дочерняя организация Народного Банка Казахстана „Halyk Capital“	√			√	√	√
АО „Дочерняя организация Народного Банка Казахстана „Halyk Finance“	√			√	√	√
АО „Евразийский банк“	√	√	√	√	√	
АО „Евразийский Капитал“	√			√	√	√
АО „Жилищный строительный сберегательный банк Казахстана“		√		√	√	
АО „Инвестиционный Финансовый Дом „RESMI“	√		√	√	√	√
АО „Инвестментс Компани „ЦентрИнвест“	√			√	√	√
АО „Информационно-учетный центр“						√
АО „ИФГ КОНТИНЕНТ“	√			√	√	√
АО „Казахстан Финсервис“				√	√	√
АО „Казахстанский инновационный коммерческий банк“		√				
АО „Казинвестбанк“		√		√	√	
АО „Казкоммерц Секьюритиз“ (дочерняя организация АО „Казкоммерцбанк“)	√			√	√	√
АО „Казкоммерцбанк“		√		√	√	
АО „Казпочта“				√	√	√
АО „Компания „CAIFC“	√			√	√	√
АО „Накопительный пенсионный фонд „ГНПФ“				√	√	
АО „Накопительный пенсионный фонд Народного Банка Казахстана“, дочерняя организация	√			√	√	
АО „Народный Банк Казахстана“						
АО „Народный сберегательный банк Казахстана“	√	√	√	√	√	
АО „Нурбанк“		√		√	√	
АО „Организация, осуществляющая инвестиционное управление пенсионными активами „GRANTUM Asset Management“ (дочерняя организация АО „Казкоммерцбанк“)				√	√	
АО „Организация, осуществляющая инвестиционное управление пенсионными активами „Жетысу“	√			√	√	
АО „Организация, осуществляющая инвестиционное управление пенсионными активами „Орлеу“				√	√	

→

Таблица 3 (продолжение)

Наименование члена KASE	Код категории членства					
	„А“	„В“	„С“	„К“	„Р“	„Н“
АО „Открытый накопительный пенсионный фонд „Отан“ (Дочерняя организация АО „АТФ Банк“)				√	√	
АО „Ренессанс Капитал Инвестментс Казахстан“	√			√	√	√
АО „СЕНИМ-БАНК“		√		√	√	
АО „Сентрас Секьюритиз“	√			√	√	√
АО „Ситибанк Казахстан“		√		√	√	
АО „Тенгри Финанс“	√			√	√	√
АО „Тор Инвест“	√			√	√	
АО „Тройка Диалог Казахстан“	√			√	√	√
АО „Управляющая компания „Asia Capital“				√	√	√
АО „Управляющая компания „Алем“	√			√	√	√
АО „Управляющая компания „Альфа Траст“				√	√	
АО „Управляющая компания „АСЫЛ-КАПИТАЛ“	√			√	√	√
АО „Финансовая компания „Greenwich Capital Management“				√	√	√
АО „Финансовая компания „REAL-INVEST.kz“	√	√	√	√	√	√
АО „Финансовая компания „Альянс Капитал“				√	√	√
АО „Хоум Кредит Банк“		√				
АО „Цесна Капитал“				√	√	√
АО „Цеснабанк“		√		√	√	
АО „Эксимбанк Казахстан“		√		√	√	
АО Дочерний Банк „RBS (Kazakhstan)“		√		√	√	
АО Дочерний Банк „Альфа-Банк“		√		√	√	
АО Дочерний Банк „Банк Китая в Казахстане“		√				
АО „Алматинский Финансовый Центр“	√			√	√	√
АО „Накопительный пенсионный фонд Казахмыс“				√	√	
АО „Управляющая компания „ОРДА Капитал“				√	√	
Государственное учреждение „Национальный Банк Республики Казахстан“		√	√	√	√	
Дочерний Банк АО „HSBC Банк Казахстан“		√		√	√	
Дочерний Банк АО „Сбербанк России“		√		√	√	
Дочерняя организация акционерного общества „АТФБанк“ – АО „АТФ Финанс“	√			√	√	√
Дочерняя организация Акционерного общества „БТА Банк“-АО „Темірбанк“		√		√	√	
Итого 83 члена	41	31	7	79	79	44

Таблица 4

Изменения в списках членов KASE в 2009 году

Наименование члена KASE	Даты:	
	принятия	исключения
Категория „А“		
АО „BCC Invest“ – дочерняя организация АО „Банк ЦентрКредит“	29.01.09	
АО „Premier Capital“	26.02.09	
АО „VISOR Investment Solutions“ (ВИЗОР Инвестмент Солюшнз)		27.02.09
ТОО „Centras Financial“		27.02.09
ТОО „MAG Capital“		27.02.09
ТОО „Казкоммерц Инвест РФЦА“		27.02.09
АО „Алматы Инвестмент Менеджмент“		27.03.09
АО „Капиталист Секьюритиз“		27.03.09
АО „Zurich Invest Management“	30.04.09	
АО „AIM Capital“		04.05.09
АО „Глобал Секьюритиз (Казахстан)“		04.05.09

→

Таблица 4 (продолжение)

Наименование члена KASE	Даты:	
	принятия	исключения
ТОО „RESMI Investment House Almaty“		29.05.09
АО „GLOTUR INVEST“		31.07.09
АО „REAL-INVEST RFCA“ (Казахстан)“		31.07.09
АО „Алан Секьюритис“		31.07.09
АО „Asia Broker Services“		28.08.09
АО „BCC Securities“ - дочерняя организация АО „Банк ЦентрКредит“		28.08.09
АО „Aibn Asset Management“	01.10.09	
АО „The Royal Bank of Scotland Securities (Kazakhstan)“		30.10.09
Итого по категории „А“	4	15
Категория „К“		
АО „VISOR Investment Solutions“ (ВИЗОР Инвестмент Солюшнз)		27.02.09
АО „Алматы Инвестмент Менеджмент“		27.03.09
АО „Zurich Invest Management“	30.04.09	
АО „Глобал Секьюритиз (Казахстан)“		04.05.09
АО „GLOTUR INVEST“		31.07.09
АО „REAL-INVEST RFCA“ (Казахстан)“		31.07.09
АО „Алан Секьюритис“		31.07.09
АО „КАЗЭКСПОРТАСТЫК-СЕКЬЮРИТИЗ“		31.07.09
АО „FATTAN FINANCE“	27.08.09	
АО „Asia Broker Services“		28.08.09
АО „Aibn Asset Management“	01.10.09	
АО „The Royal Bank of Scotland Securities (Kazakhstan)“		30.10.09
АО „Астана-Финанс“		30.10.09
Итого по категории „К“	3	10
Категория „Р“		
АО „VISOR Investment Solutions“ (ВИЗОР Инвестмент Солюшнз)		27.02.09
АО „Алматы Инвестмент Менеджмент“		27.03.09
АО „Zurich Invest Management“	30.04.09	
АО „Глобал Секьюритиз (Казахстан)“		04.05.09
АО „GLOTUR INVEST“		31.07.09
АО „REAL-INVEST RFCA“ (Казахстан)“		31.07.09
АО „Алан Секьюритис“		31.07.09
АО „КАЗЭКСПОРТАСТЫК-СЕКЬЮРИТИЗ“		31.07.09
АО „FATTAN FINANCE“	27.08.09	
АО „Asia Broker Services“		28.08.09
АО „Aibn Asset Management“	01.10.09	
АО „The Royal Bank of Scotland Securities (Kazakhstan)“		30.10.09
АО „Астана-Финанс“		30.10.09
Итого по категории „Р“	3	10
Категория „Н“		
АО „VISOR Investment Solutions“ (ВИЗОР Инвестмент Солюшнз)		27.02.09
АО „Алматы Инвестмент Менеджмент“		27.03.09
АО „Zurich Invest Management“	30.04.09	
АО „Глобал Секьюритиз (Казахстан)“		04.05.09
АО „GLOTUR INVEST“		31.07.09
АО „REAL-INVEST RFCA“ (Казахстан)“		31.07.09
АО „Алан Секьюритис“		31.07.09
АО „КАЗЭКСПОРТАСТЫК-СЕКЬЮРИТИЗ“		31.07.09
АО „FATTAN FINANCE“	27.08.09	

→

Таблица 4 (продолжение)

Наименование члена KASE	Даты:	
	принятия	исключения
АО „Asia Broker Services“		28.08.09
АО „Aibn Asset Management“	01.10.09	
АО „The Royal Bank of Scotland Securities (Kazakhstan)“		30.10.09
АО „Астана-Финанс“		30.10.09
Итого по категории „Н“	3	10
Категория „В“		
АО „Финансовая компания „REAL-INVEST.kz“	26.03.09	
Итого по категории „В“	1	0
Категория „С“		
АО „Финансовая компания „REAL-INVEST.kz“	26.03.09	
Итого по категории „С“	1	0

Таблица 5

Количество членов KASE по категориям

Категория членства	На 01.01.09	На 01.01.10	Инструменты, к торговле которыми допущены члены данной категории
„А“	52	41	все инструменты, обращающиеся (торгуемые) на СТП РФЦА
„В“	30	31	иностранные валюты
„С“	6	7	срочные контракты, обращающиеся (торгуемые) на KASE
„К“	86	79	ГЦБ, в том числе муниципальные облигации
„Р“	86	79	НЦБ (в том числе иностранные), включенные в официальный список KASE; облигации МФО; ИГЦБ, допущенные к обращению (торговле) на KASE
„Н“	51	44	НЦБ сектора „Нелистинговые ценные бумаги“ KASE, ГПА приватизируемых организаций
Всего	98	83	

Статистическая характеристика биржевого рынка Казахстана в 2009 году

Таблица 6

Динамика структуры биржевого рынка за последние 10 лет (млрд USD) и удельный вес объема биржевых торгов в ВВП Казахстана

Сектор биржевого рынка	2000 год	2001 год	2002 год	2003 год	2004 год	2005 год	2006 год	2007 год	2008 год	2009 год
долевых ценных бумаг	0,1	0,1	0,3	0,4	1,0	1,0	4,0	8,9	3,8	4,3
% от ВВП	0,4	0,7	1,4	1,4	2,4	1,9	5,2	8,5	2,9	4,0
векселей	-	-	<0,1	<0,1	-	-	-	<0,1	-	-
% от ВВП	-	-	<0,1	<0,1	-	-	-	<0,1	-	-
иностранных валют	1,7	2,0	3,0	6,4	9,4	12,0	41,7	91,4	138,9	67,7
при биржевом обороте	1,7	2,0	3,0	6,4	9,4	12,0	41,7	91,4	138,9	85,3
% от ВВП	9,5	8,9	12,1	21,4	22,9	21,6	54,3	87,5	105,5	63,3
иностранных ГЦБ	-	-	-	-	-	<0,1	<0,1	<0,1	-	-
% от ВВП	-	-	-	-	-	<0,1	<0,1	<0,1	-	-
казахстанских ГЦБ	1,2	1,5	2,0	2,4	5,6	4,8	6,6	8,1	7,8	9,4
% от ВВП	6,4	7,0	7,9	7,9	13,5	8,5	8,6	7,7	5,9	8,8

→

Таблица 6 (продолжение)

Сектор биржевого рынка	2000	2001	2002	2003	2004	2005	2006	2007	2008	2009
	год	год	год	год	год	год	год	год	год	год
корпоративных облигаций	<0,1	0,2	0,3	0,6	0,9	1,7	3,0	4,3	3,6	2,6
% от ВВП	0,3	0,8	1,1	2,0	2,1	3,1	3,9	4,1	2,8	2,5
облигаций МФО	-	<0,1	-	-	<0,1	<0,1	-	-	-	-
% от ВВП	-	<0,1	-	-	<0,1	<0,1	-	-	-	-
репо (ГЦБ и НЦБ)	1,0	3,0	9,2	10,8	21,2	30,5	58,0	104,3	109,1	71,6
при биржевом обороте	2,0	5,9	18,3	21,5	42,0	60,8	114,0	209,8	217,0	144,1
% от ВВП	5,6	13,4	37,2	36,1	51,5	54,5	75,6	99,8	82,8	66,9
срочных контрактов	0,1	0,5	0,8	2,5	<0,1	-	-	-	<0,1	-
% от ВВП	0,4	2,4	3,4	8,2	<0,1	-	-	-	<0,1	-
Итого	4,1	7,3	15,5	23,1	38,1	50,0	113,4	217,1	263,2	155,7
при биржевом обороте	5,2	10,2	24,6	33,8	59,0	80,4	169,3	322,5	371,1	245,7
% от ВВП	22,5	33,0	63,0	77,1	92,4	89,5	147,6	207,7	199,9	145,5
ВВП, млрд USD	18,3	22,2	24,6	29,9	41,2	55,9	76,8	104,5	131,7	107,0

См. раздел „Пояснения к книге фактического материала“

Рисунок 1

Динамика структуры и объема биржевого рынка по месяцам в 2009 году (объем торгов, трлн KZT)

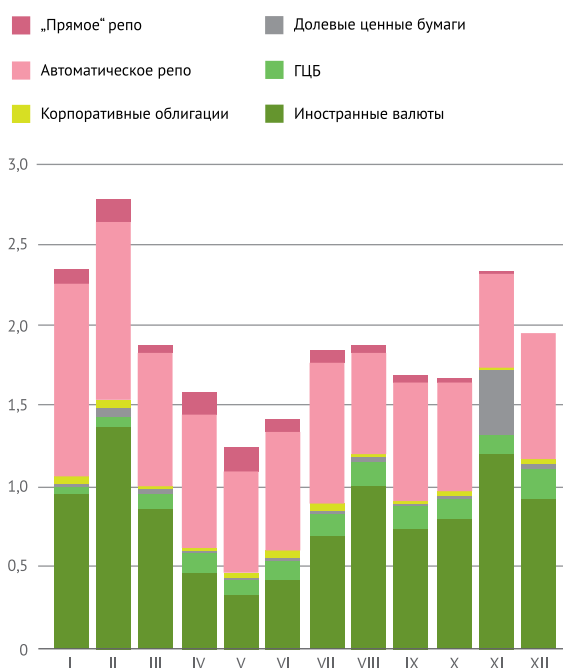


Рисунок 2

Динамика структуры оборота биржевого рынка в 1993–2009 годах (млрд USD) и его удельный вес в ВВП Казахстана

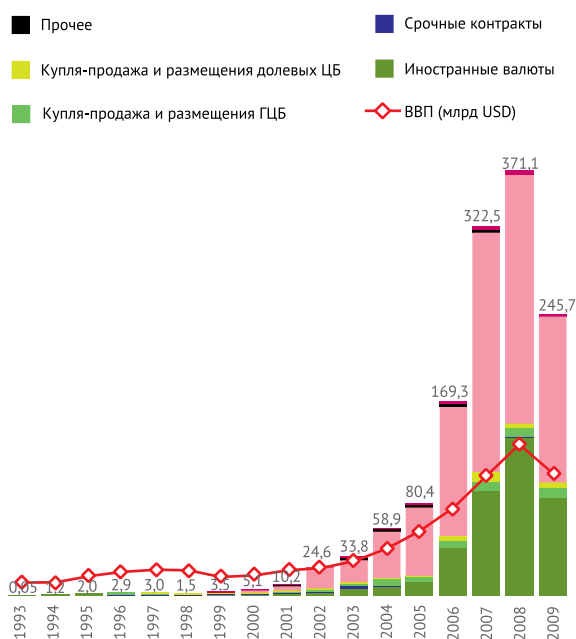


Таблица 7

Сравнительные данные по объему торгов на KASE и структуре рынка в 2008 и 2009 годах

Сегмент биржевого рынка	в млрд KZT						в млн USD					
	2008 год		2009 год		Тренд		2008 год		2009 год		Тренд	
	Объем	%	Объем	%	Объем	%	Объем	%	Объем	%	Объем	%
долевых ценных бумаг	460,3	1,5	637,6	2,8	+177,3	+38,5	3 825,9	1,5	4 300,7	2,8	+474,7	+12,4
иностраннх валют	16 708,7	52,8	9 879,0	43,5	-6 829,6	-40,9	138 874,0	52,7	67 725,7	43,5	-71 148,3	-51,2
в том числе:												
спот-рынок	16 708,1	52,8	7 243,6	31,9	-9 464,5	-56,6	138 869,0	52,7	50 173,2	32,2	-88 695,8	-63,9
своп-рынок	0,6	<0,1	2 635,4	11,6	X	X	5,0	<0,1	17 552,5	11,3	X	X
при биржевом обороте	1,2	<0,1	5 271,0	14,7	X	X	10,0	<0,1	35 105,0	14,3	X	X
казахстанских ГЦБ	938,4	3,0	1 408,1	6,2	+469,7	+50,1	7 804,8	3,0	9 443,2	6,1	+1 638,4	+21,0
в том числе:												
первичный рынок	465,2	1,5	698,1	3,1	+233,0	+50,1	3 868,9	1,5	4 658,7	3,0	+789,7	+20,4
вторичный рынок	473,2	1,5	710,0	3,1	+236,8	+50,0	3 935,8	1,5	4 784,5	3,1	+848,7	+21,6
корпоративных облигаций	439,1	1,4	386,1	1,7	-53,0	-12,1	3 652,0	1,4	2 637,6	1,7	-1 014,3	-27,8
репо (ГЦБ и НЦБ)	13 125,0	41,4	10 409,8	45,8	-2 715,2	-20,7	109 155,4	41,5	71 552,1	46,0	-37 603,3	-34,4
при биржевом обороте	26 105,4	58,5	20 967,3	58,4	-5 138,0	-19,7	217 107,8	58,5	144 053,7	58,6	-73 054,1	-33,6
в том числе:												
„прямое“ репо по ГЦБ	173,7	0,5	120,9	0,5	-52,8	-30,4	1 444,3	0,5	813,1	0,5	-631,3	-43,7
при биржевом обороте	333,4	0,7	237,5	0,7	-95,9	-28,8	2 772,1	0,7	1 604,7	0,7	-1 167,4	-42,1
авторепо по ГЦБ	10 382,7	32,8	8 919,4	39,3	-1 463,4	-14,1	86 356,9	32,8	61 226,5	39,3	-25 130,5	-29,1
при биржевом обороте	20 680,9	46,3	17 890,8	49,8	-2 790,1	-13,5	172 011,0	46,3	122 750,5	50,0	-49 260,5	-28,6
„прямое“ репо по НЦБ	849,6	2,7	753,0	3,3	-96,6	-11,4	7 064,0	2,7	5 162,3	3,3	-1 901,8	-26,9
при биржевом обороте	1 669,4	3,7	1 535,5	4,3	-133,9	-8,0	13 879,3	3,7	10 527,7	4,3	-3 351,7	-24,1
авторепо по НЦБ	1 719,0	5,4	616,6	2,7	-1 102,4	-64,1	14 290,1	5,4	4 350,3	2,8	-9 939,8	-69,6
при биржевом обороте	3 421,7	7,7	1 303,6	3,6	-2 118,1		28 445,4	7,7	9 170,7	3,7	-19 274,6	-67,8
срочных контрактов	0,1	<0,1	-	-	X	X	0,4	<0,1	-	-	X	X
Итого объем торгов	31 671,5	100,0	22 720,6	100,0	-8 950,9	-28,3	263 312,6	100,0	155 659,3	100,0	-107 653,3	-40,9
при биржевом обороте	44 651,9		35 913,7		-8 738,2	-19,6	371 265,0		245 713,3		-125 551,6	-33,8

Таблица 8

Структура объема биржевых торгов в 2009 году (млн USD, %)

Рынки:			Сегменты рынков:			в том числе:					
наименование	объем	доля	наименование	объем	доля	наименование	объем	доля			
иностраннх валют	67 725,7	43,5	EUR	925,0	0,6	спот-рынок	925,0	0,6			
			RUR	40,6	<0,1	спот-рынок	40,6	<0,1			
			USD	66 760,0	42,9	спот-рынок	49 207,5	31,6			
операций репо	71 552,1	46,0	автоматическое репо	65 576,7	42,1	операции валютного свопа	17 552,5	11,3			
						с ГЦБ	61 226,5	39,3			
						с НЦБ	4 350,3	2,8			
ценных бумаг	16 381,5	10,5	„прямое“ репо	5 975,4	3,8	с ГЦБ	813,1	0,5			
						с НЦБ	5 162,3	3,3			
						долевые ЦБ	4 300,7	2,8	вторичный рынок	4 300,7	2,8
ценных бумаг	16 381,5	10,5	ГЦБ	9 443,2	6,1	в том числе спецторги	2 814,6	1,8			
						размещения	4 658,7	3,0			
						вторичный рынок	4 784,5	3,1			
						долговые корпоративные ЦБ	2 637,6	1,7	размещения	54,3	<0,1
						вторичный рынок	2 583,4	1,7			
Всего	155 659,3	100,0		155 659,3	100,0		155 659,3	100,0			

Рынок долевых ценных бумаг

Таблица 9

Список KASE на 01 января 2010 года

Код инструмента	Наименование ценной бумаги	Количество оплаченных акций, шт.	Последняя цена, KZT за инструмент	Рыночная капитализация эмитента на KASE	
				млн KZT	млн USD
Официальный список					
Сектор „акции“, первая (наивысшая) категория					
ARAL	Простая акция АО „Международный аэропорт Алматы“	78 414	-	0	0
CCBN	Простая акция АО „Банк ЦентрКредит“	144 480 531	756,00	109 227,3	735,7
CSBNp	Привилегированная акция АО „Kaspi Bank“	441 815	1 513,00	668,5	4,5
EUBNp	Привилегированная акция АО „Евразийский банк“	-	-	0	0
GB_ENRC	Простая акция EURASIAN NATURAL RESOURCES CORPORATION PLC	1 287 750 000	2 100,00	2 704 275,0	18 215,5
GB_KZMS	Простая акция KAZAKHMYS PLC	535 240 338	3 090,00	1 653 892,6	11 140,3
HSBK	Простая акция АО „Народный сберегательный банк Казахстана“	1 239 169 502	328,00	473 267,4	3 187,8
HSBKp	Привилегированная акция АО „Народный сберегательный банк Казахстана“	309 859 430	170,00		
HSBKp1	Привилегированная конвертируемая акция АО „Народный сберегательный банк Казахстана“	80 225 222	176,30		
KKAGp	Привилегированная акция АО „Казахстан Кагазы“	0	-	0	0
KKGB	Простая акция АО „Казкоммерцбанк“	778 603 062	665,00	550 646,0	3 709,1
KKGBp	Привилегированная акция АО „Казкоммерцбанк“	125 000 000	263,00		
KZTK	Простая акция АО „Казхателеком“	10 922 876	17 259,92	191 753,5	1 291,6

→

Таблица 9 (продолжение)

Код инструмента	Наименование ценной бумаги	Количество оплаченных акций, шт.	Последняя цена, KZT за инструмент	Рыночная капитализация эмитента на KASE	
				млн KZT	млн USD
KZTKp	Привилегированная акция АО „Казактелеком“	403 194	8 000,00		
NRBN	Простая акция АО „Нурбанк“	3 177 093	18 000,00	60 124,1	405,0
NRBNp6	Привилегированная акция АО „Нурбанк“	225 876	13 000,00		
RDGZ	Простая акция АО „Разведка Добыча „КазМунайГаз“	70 220 935	21 818,10	1 532 087,4	10 319,9
SATC	Простая акция АО „SAT & Company“	1 099 404 920	74,19	81 564,9	549,4
SATCp	Привилегированная акция АО „SAT & Company“	0	-		
TEBN	Простая акция Дочерней организации АО „БТА Банк“ - АО „Темірбанк“	19 067 000	955,00	19 680,0	132,6
TEBNp	Привилегированная акция Дочерней организации АО „БТА Банк“ - АО „Темірбанк“	4 903 380	300,00		
TSBNp	Привилегированная акция АО „Цеснабанк“	2 500 000	865,00	2 162,5	14,6
Итого 22 наименования акций 15 эмитентов		5 711 673 588		7 379 349,1	49 706,0
Сектор „акции“, вторая (наивысшая) категория					
ALLZ	Простая акция АО „Альтернативные финансы“	80 804	-	0	0
ASAV	Простая акция АО „АЗИЯ АВТО“	100 000	175 450,00	17 545,0	118,2
ASFL	Простая акция АО „Лизинговая компания „Астана-Финанс“	681 300	-	0	0
ASND	Простая акция АО „Астана-Недвижимость“	1 000 000	55 000,00	55 001,0	370,5
ASNDp	Привилегированная акция АО „Астана-Недвижимость“	100	10 000,00		
AZNOp	Привилегированная акция АО „Актюбинский завод нефтяного оборудования“	0	-	0	0
CHFM	Простая акция АО „Химфарм“	5 113 117	1 464,10	7 486,1	50,4
EXBN	Простая акция АО „Эксимбанк Казахстан“	9 610 232	800,00	9 779,1	65,9
EXBNp	Привилегированная акция АО „Эксимбанк Казахстан“	2 000 000	1 045,45		
IFDR	Простая акция АО „Инвестиционный Финансовый Дом „RESMI“	342 520	-	0	0
KATR	Простая акция АО „Атамекен-Агро“	9 000 324	3 599,00	46 876,7	315,8
KATRp	Привилегированная акция АО „Атамекен-Агро“	1 448 457	10 000,00		
KAZI	Простая акция АО „Карагандинский завод асбестоцементных изделий“	40 000 000	200,00	12 590,0	84,8
KAZIp	Привилегированная акция АО „Карагандинский завод асбестоцементных изделий“	15 000 000	306,00		
KSMK	Простая акция АО „РТ Холдинг“	4 447 359	-	0	0
KSMKp	Привилегированная акция АО „РТ Холдинг“	1 111 840	-		
KZIK	Простая акция АО „Казахстанская Ипотечная Компания“	2 792 010	-	0	0
KZTC	Простая акция АО „KazTransCom“	2 386 898	3 025,00	7 320,4	49,3
KZTCp	Привилегированная акция АО „KazTransCom“	113 624	880,00		
MAG_	Простая акция АО „MAG“	3 205 000	-	0	0
MAG_p	Привилегированная акция АО „MAG“	150 000	-		
MREK	Простая акция АО „Мангистауская распределительная электросетевая компания“	1 985 853	1 760,00	3 495,1	23,5
NFBN	Простая акция АО „Delta Bank“	4 668 420	2 000,00	9 336,8	62,9
PAIN	Простая акция АО „Страховая компания „Пана Иншуранс“	176 203	-	0	0
PNHZ	Простая акция АО „Павлодарский нефтехимический завод“	7 000 000	-	0	0
REAL	Простая акция АО „Финансовая компания „REAL-INVEST.kz“	1 072 000 000	-	0	0

→

Таблица 9 (продолжение)

Код инструмента	Наименование ценной бумаги	Количество оплаченных акций, шт.	Последняя цена, KZT за инструмент	Рыночная капитализация эмитента на KASE	
				млн KZT	млн USD
REALp	Привилегированная акция АО „Финансовая компания „REAL-INVEST.kz“	1 250 000 000	-		
RGBR	Простая акция АО „RG Brands“	3 442 092	-	0	0
SHUK	Простая акция АО „Шубарколь комир“	3 517 772	-	0	0
SHUKp	Привилегированная акция АО „Шубарколь комир“	119 027	-		
TKUDp	Привилегированная акция АО „Горно-обогатительный комбинат „Торт-Кудык“	75 000 000	-	0	0
TMLZ	Простая акция АО „Темірлізинг“	1 560 000	3 956,52	6 172,2	41,6
TSBN	Простая акция АО „Цеснабанк“	15 500 000	940,00	14 570,0	98,1
UKPF	Простая акция АО „Усть-Каменогорская птицефабрика“	166 200	-	0	0
UKPFp	Привилегированная акция АО „Усть-Каменогорская птицефабрика“	25 200	-		
ZERD	Простая акция АО „Kazcat“	1 500 000 000	4,90	10 125,0	68,2
ZERDp	Привилегированная акция АО „Kazcat“	500 000 000	5,55		
Итого 37 наименований акций 26 эмитентов		4 533 744 352		200 297,4	1 349,2
Сектор „акции“, третья (следующая за наивысшей) категория					
AKFI	Простая акция АО „AMF Group“	48 043 800	10,00	480,4	3,2
ALSA	Простая акция АО „Алматинский Сахар“	651 000	-	0	0
AMIN	Простая акция АО „Страховая компания „AMANAT INSURANCE“	210 000	-	0	0
ASSA	Простая акция АО „АЗИЯ САХАР“	210 000	27 911,38	5 861,4	39,5
ASTL	Простая акция АО „ASTEL“	226 000	1 000,00	226,0	1,5
ASZS	Простая акция АО „Астана Газ Сервис“	102 000	30 000,00	3 060,0	20,6
ATFB	Простая акция АО „АТФБанк“	37 640 549	5 300,00	199 494,9	1 343,8
AZNO	Простая акция АО „Актюбинский завод нефтяного оборудования“	600 000	1 089,00	653,4	4,4
BSUL	Простая акция АО „Баян Сулу“	6 666 667	25,00	166,7	1,1
CHFMr	Привилегированная акция АО „Химфарм“	131 945	700,00	92,4	0,6
CSBN	Простая акция АО „Kaspi Bank“	19 324 822	4 069,57	78 643,7	529,7
DNBN	Простая акция АО „Данабанк“	2 000 000	400,00	800,0	5,4
EKTN	Простая акция АО „ЭКТОН+“	93 500	117 800,00	11 014,3	74,2
GG_TPL_	Простая акция Tethys Petroleum Limited	45 116 696	-	0	0
KANT	Простая акция АО „Кант“	6 890 131	3 916,75	26 986,9	181,8
KIBN	Простая акция АО „Казинвестбанк“	68 778 806	187,00	12 861,6	86,6
KMSO	Простая акция АО „Страховая Компания „Коммеск - Омір“	122 400	5 100,00	624,2	4,2
KZIS	Простая акция АО „Дочерняя страховая компания Народного банка Казахстана „Халык - Казахинстрах“	338 011	41 030,00	13 868,6	93,4
KZPF	Простая акция АО „Накопительный пенсионный фонд „БТА Казахстан“ дочерняя организация АО „БТА Банк“	6 004 000	-	0	0
KZVP	Простая акция АО „Каззахвзырпром“	63 060	-	0	0
LNAT	Простая акция АО „Дочерняя организация Акционерного общества „БТА Банк“ Страховая компания „Лондон-Алматы“	1 500 000	8 500,00	12 750,0	85,9
LNPT	Простая акция АО „Lancaster Petroleum“	1 304 563	18 928,06	24 692,8	166,3
MMGZ	Простая акция АО „Мангистаумунайгаз“	107 856 540	3 593,35	393 013,6	2 647,3
MMGZp	Привилегированная акция АО „Мангистаумунайгаз“	1 089 460	5 000,00		
PDEN	Простая акция АО „ПАВЛОДАРЭНЕРГО“	148 599 957	-	0	0

→

Таблица 9 (продолжение)

Код инструмента	Наименование ценной бумаги	Количество оплаченных акций, шт.	Последняя цена, KZT за инструмент	Рыночная капитализация эмитента на KASE	
				млн KZT	млн USD
PDES	Простая акция АО „Павлодарская Распределительная Электросетевая Компания“	11 131 000	880,00	9 795,3	66,0
PRIN	Простая акция АО „Premier Страхование“	608 432	1 100,00	669,3	4,5
RAHT	Простая акция АО „Рахат“	3 600 000	1 250,00	4 500,0	30,3
RTCP	Простая акция АО „РТС Деко“	91 900	14 613,00	1 342,9	9,0
SAS_	Простая акция АО „С. А. С.“	88 708	-	0	0
SHMO	Простая акция АО „Шымкент Мунай онімдері“	3 999 999	2 840,50	11 362,0	76,5
SNBN	Простая акция АО „СЕНИМ-БАНК“	1 917 269	1 100,00	2 109,0	14,2
SUMB	Простая акция АО „Сумбе“	182 000	300 000,00	54 600,0	367,8
TSNAp	Привилегированная акция АО „Корпорация „Цесна“	1 250 000	1 000,00	0	0
UPDK	Простая акция АО „Управление по обслуживанию дипломатического корпуса“	214	-	0	0
UTMK	Простая акция АО „Усть-Каменогорский титано-магниеый комбинат“	1 942 380	29 000,00	56 922,5	383,4
UTMKp	Привилегированная акция АО „Усть-Каменогорский титано-магниеый комбинат“	107 910	5 500,00		
ZNGR	Простая акция АО „КРТД „ЗАНГАР“	19 909 800	-	0	0
ZNGRp	Привилегированная акция АО „КРТД „ЗАНГАР“	3 482 480	1 250 000,00		
Итого 39 наименований акций 36 эмитентов		551 875 999		926 592,0	6 241,4
Сектор „ценные бумаги инвестиционных фондов“					
REAMfv	Пай интервального паевого инвестиционного фонда „ФАВОРИТ“	X	-	X	X
VSTN	Простая акция АО „АИФН „ВЕЛИКАЯ СТЕНА“	12 266	243 000,00	2 980,6	20,1
Итого 2 наименования ценных бумаг 2 эмитентов		12 266		2 980,6	20,1
Итого по официальному списку KASE 100 инструментов 75 эмитентов		10 797 306 205		8 509 219,2	57 316,6
Сектор „Нелистинговые ценные бумаги“					
AMGZp	Привилегированная акция АО „СНПС - Актөбемұнайгаз“	943 955	18 000,00	0	0
BTAS	Простая акция АО „БТА Банк“	33 616 968	1 907,03	64 108,5	431,8
DAMU	Простая акция АО „Ипотечная компания „ДАМУ“	300 000	1 130,00	339,0	2,3
KASE	Простая акция АО „Казахстанская фондовая биржа“	450 000	4 681,38	2 106,6	14,2
KZPC	Простая акция АО „Kazakstan“ Processing centre“	750 000	1 240,00	930,0	6,3
KZPCp	Привилегированная акция АО „Kazakstan“ Processing centre“	250 000			
Итого по сектору „Нелистинговые ценные бумаги“ 6 наименований акций 5 эмитентов		36 310 923			
Всего 106 инструментов 80 эмитентов					

См. раздел „Пояснения к книге фактического материала“

Таблица 10

Изменения в списке KASE в 2009 году

Код инструмента	Краткое наименование эмитента	Даты:			
		листинга	делистинга	понижения категории	повышения категории
Официальный список СТП РФЦА					
aALPL	АО „Страховая компания „Алтын Полис“		29.06.09		
aASAV	АО „АЗИЯ АВТО“			12.02.09	
aASBN	АО „Альянс Банк“		02.11.09	24.04.09	
aASBNp1	АО „Альянс Банк“		02.11.09	24.04.09	
aASFI	АО „Астана-Финанс“		09.11.09	03.08.09	
aEKTN	АО „ЭКОТОН+“			12.02.09	
aKY_RRF_	Russia Renaissance Fund SPC		10.07.09		
aKZIK	АО „Казахстанская Ипотечная Компания“			29.09.09	
aKZVP	АО „Казахвзрывпром“	23.04.09			
aPRIN	АО „Premier Страхование“			29.09.09	
aUTMK	АО „Усть-Каменогорский титано-магниевого комбинат“			03.08.09	
aZERDp	АО „Kazcat“	02.03.09			
Итого новых эмитентов и первых листингов – 1		2	5	8	0
Официальный список ОТП KASE					
ACCT	АО „Акцент-Терминал“		29.06.09		
ALVZ	АО „Zhansaya-Producing“		29.09.09		
ALVZp	АО „Zhansaya-Producing“		29.09.09		
ASBN	АО „Альянс Банк“		02.11.09	03.08.09	
ASBNp1	АО „Альянс Банк“		02.11.09	03.08.09	
ASFI	АО „Астана-Финанс“		09.11.09	03.08.09	
ASFIp	АО „Астана-Финанс“		09.11.09	03.08.09	
ASFL	АО „Лизинговая компания „Астана-Финанс“	16.02.09			
ASNDp	АО „Астана-Недвижимость“	06.02.09			
ASSA	АО „АЗИЯ САХАР“			27.03.09	
ATFBp	АО „АТФБанк“		18.03.09		
ATFBp8	АО „АТФБанк“		18.03.09		
ATOL	АО „Kazakhstan Petrochemical Industries“		29.06.09		
AZNO	АО „Актюбинский завод нефтяного оборудования“			29.09.09	
BTAS	АО „БТА Банк“		02.11.09		
CSBN	АО „Kaspi Bank“			27.03.09	
DNBN	АО „Данабанк“			03.08.09	
EUBNp	АО „Евразийский банк“	21.01.09			
GLOT	АО „GLOTUR“ (ГЛОТУР)		02.11.09	02.06.09	
GMED	АО „G-Media“		03.08.09		
KAZI	АО „Карагандинский завод асбестоцементных изделий“	03.03.09			
KAZIp	АО „Карагандинский завод асбестоцементных изделий“	03.03.09			
KIBN	АО „Казинвестбанк“			06.10.09	
KKAGp	АО „Казахстан Кагазы“	30.07.09			
KSMK	АО „РТ Холдинг“	10.08.09			
KSMKp	АО „РТ Холдинг“	10.08.09			
KZDK	АО „Казахская дистрибуционная компания“		02.11.09		
KZIS	АО „Дочерняя страховая компания Народного банка Казахстана „Халык-Казахинстрах“			27.03.09	
LNAT	АО „Дочерняя организация Акционерного общества „БТА Банк“ Страхование компания „Лондон-Алматы“			27.03.09	
MMGZp	АО „Мангистаумунайгаз“			03.08.09	

→

Таблица 10 (продолжение)

Код инструмента	Краткое наименование эмитента	Даты:			
		листинга	делистинга	понижения категории	повышения категории
NFBN	АО „Delta Bank“				24.04.2009
ORDB	АО „Корпорация „Ордабасы“			29.09.09	
ORDBр	АО „Корпорация „Ордабасы“			29.09.09	
ORNK	АО „Орнек XXI“			30.01.09	
ORPT	АО „Оптово-розничное предприятие торговли“		29.09.09		
PAIN	АО „Страховая компания „Пана Иншуранс“				03.08.2009
RMXR	АО „РЭМИКС-Р“		29.09.09		
SATСр	АО „SAT & Company“	08.10.09			
SKYS	АО „SKY SILK“		30.01.09		
TKUDр	АО „Горно-обогатительный комбинат „Торт-Кудык“	14.10.09			
TSBN	АО „Цеснабанк“			27.03.09	
UKAZ	АО „Усть-Каменогорский арматурный завод“		03.08.09		
UKAZр	АО „Усть-Каменогорский арматурный завод“		03.08.09		
UTMK	АО „Усть-Каменогорский титано-магниевый комбинат“			03.08.09	
ZERDр	АО „Kazcat“	02.03.09			
Итого новых эмитентов – 6, из них первых листингов – 1		11	19	18	2
Официальный список объединенной торговой площадки KASE и РФЦА					
KMSO	АО „Страховая Компания „Коммеск - Омір“			28.12.09	
ORDB	АО „Корпорация „Ордабасы“		28.12.09		
ORDBр	АО „Корпорация „Ордабасы“		28.12.09		
ORNK	АО „Орнек XXI“		28.12.09		
ROSA	АО „РОСА“		26.11.09		
Итого новых эмитентов и первых листингов – 0		0	4	1	0
Сектор „Нелистинговые ценные бумаги“					
BTAS	АО „БТА Банк“	10.11.09			
GRNT	АО „Накопительный пенсионный фонд ГРАНТУМ“		19.08.09		
KASE	АО „Казахстанская фондовая биржа“	22.05.09			
KZPC	АО „Kazakstan“ Processing centre“	12.06.09			
KZPCр	АО „Kazakstan“ Processing centre“	12.06.09			
PRIN	АО „Premier Страхование“		19.08.09		
Итого новых эмитентов – 1		4	2	X	X
Всего новых эмитентов – 8, из них первых листингов – 2		17	30	27	2

См. раздел „Пояснения к книге фактического материала“

Таблица 11

Динамика структуры списка KASE в 2009 году (на 01 января 2010 года, изменение за год)

Сектор, категория допуска	Ценных бумаг		Эмитентов	
	кол-во	тренд	кол-во	тренд
Сектор „акции“:				
первая категория	22	-6	15	-3
вторая категория	37	-1	26	-3
третья категория	39	-5	36	-3
Сектор „ценные бумаги инвестиционных фондов“	2	+0	2	0
Итого по официальному списку	100	-12	75	-10
Сектор „Нелистинговые ценные бумаги“	6	+2	5	+1
Всего	106	-10	80	-9

См. раздел „Пояснения к книге фактического материала“

Таблица 12

Отраслевая структура списка KASE (акции по рыночной стоимости)

Отрасль	На 01.01.10			На 01.01.09		
	млрд KZT	млн USD	доля, %	млрд KZT	млн USD	доля, %
Сырьевой сектор	4 426,5	29 815,8	52,0	1 017,0	8 419,5	26,8
Энергетика	2 035,1	13 707,9	23,9	765,3	6 335,6	20,2
Финансы	1 632,9	10 999,2	19,2	1 658,1	13 727,0	43,7
Услуги телекоммуникации	199,3	1 342,4	2,3	171,8	1 422,0	4,5
Основной потребительский сектор	84,4	568,4	1,0	41,7	345,5	1,1
Дискреционный потребительский сектор	83,6	563,2	1,0	86,0	711,7	2,3
Промышленность	23,6	159,0	0,3	26,9	222,8	0,7
Коммунальный сектор	13,3	89,5	0,2	16,3	135,0	0,4
Здравоохранение	7,6	51,0	0,1	4,2	35,1	0,1
Информационные технологии	0	0	0	9,7	80,0	0,3
Итого	8 506,2	57 296,5	100,0	3 796,9	31 434,1	100,0

См. раздел „Пояснения к книге фактического материала“

Таблица 13

Объем торгов долевыми ценными бумагами на KASE в 2009 году (по месяцам, кварталам и секторам)

Месяц	Вид торгов						Итого	
	регламентные торги		спецторги по размещению		прочие спецторги			
	тыс. USD	млн KZT	тыс. USD	млн KZT	тыс. USD	млн KZT	тыс. USD	млн KZT
Январь	159 585,0	19 376,1	-	-	-	-	159 585,0	19 376,1
Февраль	360 506,9	53 574,8	-	-	32 174,4	4 840,0	392 681,3	58 414,8
Март	167 708,1	25 274,9	-	-	-	-	167 708,1	25 274,9
I квартал	687 800,0	98 225,8	-	-	32 174,4	4 840,0	719 974,4	103 065,8
Апрель	173 779,9	26 169,9	-	-	-	-	173 779,9	26 169,9
Май	39 592,3	5 953,8	-	-	-	-	39 592,3	5 953,8
Июнь	51 117,9	7 682,6	-	-	-	-	51 117,9	7 682,6
II квартал	264 490,1	39 806,3	-	-	-	-	264 490,1	39 806,3
Июль	40 468,5	6 097,6	-	-	-	-	40 468,5	6 097,6
Август	177 516,1	26 764,3	-	-	-	-	177 516,1	26 764,3
Сентябрь	90 874,2	13 712,5	-	-	-	-	90 874,2	13 712,5
III квартал	308 858,8	46 574,3	-	-	-	-	308 858,8	46 574,3
Октябрь	172 115,0	25 955,3	-	-	-	-	172 115,0	25 955,3

→

Таблица 13 (продолжение)

Месяц	Вид торгов						Итого	
	регламентные торги		спецторги по размещению		прочие спецторги			
	тыс. USD	млн KZT	тыс. USD	млн KZT	тыс. USD	млн KZT	тыс. USD	млн KZT
Ноябрь	33 082,2	4 959,5	-	-	2 602 163,9	387 566,3	2 635 246,1	392 525,8
Декабрь	19 678,0	2 927,1	-	-	180 293,2	26 737,5	199 971,3	29 664,6
IV квартал	224 875,2	33 841,9	-	-	2 782 457,2	414 303,8	3 007 332,4	448 145,7
Всего 2009 год	1 486 024,0	218 448,4	-	-	2 814 631,6	419 143,8	4 300 655,7	637 592,2
Структура	34,6%		X		65,4%		100,0%	
Справочно 2008 год:								
Всего	3 202 717,7	385 567,0	22 480,5	2 712,3	600 738,6	72 025,7	3 825 936,9	460 305,0
Структура	83,7%		0,6%		15,7%		100,0%	
Тренд 2009 к 2008:								
в деньгах	-1 716 693,7	-167 118,6	X	X	+2 213 893,0	+347 118,1	+474 718,8	+177 287,2
в процентах	-53,6	-43,3	X	X	+368,5	+481,9	+12,4	+38,5

См. раздел „Пояснения к книге фактического материала“

Таблица 14

Распределение объема сделок купли-продажи долевых ценных бумаг по категориям списка KASE в 2009 году

Месяц	Объем сделок с акциями по категориям и секторам списков										Всего, млн KZT	Число сделок		
	Первая категория		Вторая категория		Третья категория		Акции		Ценные бумаги инвестиционных фондов				Нелистинговые ценные бумаги	
	млн KZT	доля,%	млн KZT	доля,%	млн KZT	доля,%	млн KZT	доля,%	млн KZT	доля,%			млн KZT	доля,%
	Январь	13 426,2	69,3	4 407,5	22,7	1 349,8	7,0	139,9	0,7	52,6			0,3	19 376,1
Февраль	12 276,3	22,9	41 045,3	76,6	86,2	0,2	44,5	0,1	122,5	0,2	53 574,8	1 497		
Март	11 409,8	45,1	13 280,9	52,5	543,1	2,1	41,2	0,2	-	X	25 274,9	849		
Апрель	20 373,7	77,9	3 732,4	14,3	1 931,8	7,4	111,2	0,4	20,8	0,1	26 169,9	1 489		
Май	4 618,1	77,6	1 263,0	21,2	2,6	0,0	19,2	0,3	50,9	0,9	5 953,8	1 858		
Июнь	2 949,9	38,4	4 351,8	56,6	108,7	1,4	238,5	3,1	33,7	0,4	7 682,6	1 225		
Июль	4 730,2	77,6	878,9	14,4	456,6	7,5	6,7	0,1	25,1	0,4	6 097,6	935		
Август	1 790,4	6,7	231,0	0,9	24 732,7	92,4	10,1	<0,1	-	X	26 764,3	1 127		
Сентябрь	8 566,9	62,5	4 111,8	30,0	1 017,0	7,4	-	X	16,7	0,1	13 712,5	1 483		
Октябрь	25 381,1	97,8	537,8	2,1	3,7	0,0	-	X	32,7	0,1	25 955,3	1 626		
Ноябрь	4 395,7	88,6	509,1	10,3	43,3	0,9	-	X	11,3	0,2	4 959,5	2 032		
Декабрь	2 233,9	76,3	467,9	16,0	185,2	6,3	0,5	<0,1	39,6	1,4	2 927,1	1 321		
Итого	112 152,2	51,3	74 817,6	34,2	30 460,7	13,9	611,9	0,3	406,0	0,2	218 448,4	16 513		

См. раздел „Пояснения к книге фактического материала“

Таблица 15

Сравнительные статистические данные по рынку долевых ценных бумаг KASE в 2009 и 2008 годах

Показатель рынка акций	Единица измерения	2009 год	2008 год	2009 год к 2008 году
Число торговых дней		249	249	0 %
Число результативных дней		249	249	0 %
Показатель результативности торгов	%	100,0	100,0	0 пп
I. Рыночные сделки (за исключением сделок, заключенных в рамках специализированных торгов)				
общий объем сделок	млн KZT	205 366,5	368 548,5	-44,3 %
	млн USD	1 398,1	3 061,3	-54,3 %
количество сделок	штук	16 357	17 260	-5,2 %
доля от объема торгов в секторе купли-продажи	%	94,0	95,6	-1,6 пп
доля от кол-ва сделок в секторе купли-продажи	%	99,1	97,9	+1,2 пп
средний объем одной сделки	млн KZT	12,6	21,4	-41,2 %
	тыс. USD	85,5	177,4	-51,8 %
среднее количество сделок в день	штук	66	69	-5,2 %
среднедневной объем сделок этого типа	млн KZT	824,8	1 480,1	-44,3 %
	млн USD	5,6	12,3	-54,3 %
в том числе сделки с акциями представительского списка Индекса KASE				
общий объем сделок	млн KZT	67 143,5	196 660,1	-65,9 %
	млн USD	466,2	1 633,7	-71,5 %
количество сделок	штук	13 360	13 810	-3,3 %
доля от объема всех рыночных сделок	%	32,7	53,4	-20,7 пп
доля от количества всех рыночных сделок	%	81,7	80,0	+1,7 пп
средний объем одной сделки	млн KZT	5,0	14,2	-64,7 %
	тыс. USD	34,9	118,3	-70,5 %
среднее количество сделок в день	штук	54	55	-3,3 %
среднедневной объем сделок этого типа	млн KZT	269,7	789,8	-65,9 %
	млн USD	1,9	6,6	-71,5 %
II. Прямые сделки				
общий объем сделок	млн KZT	13 081,9	17 018,4	-23,1 %
	млн USD	87,9	141,4	-37,9 %
количество сделок	штук	156	378	-58,7 %
доля от объема торгов в секторе купли-продажи	%	6,0	4,4	+1,6 пп
доля от кол-ва сделок в секторе купли-продажи	%	0,9	2,1	-1,2 пп
средний объем одной сделки	млн KZT	83,9	45,0	+86,3 %
	тыс. USD	563,5	374,2	+50,6 %
среднее количество сделок в день	штук	1	2	-58,7 %
среднедневной объем сделок этого типа	млн KZT	52,5	68,3	-23,1 %
	млн USD	0,4	0,6	-37,9 %
III. Специализированные торги				
количество сделок		4	56	-92,9 %
средний объем одной сделки	млн KZT	104 785,9	1 334,6	+7 751,4 %
	тыс. USD	703 657,9	11 128,9	+6 222,8 %
общий объем сделок этого типа	млн KZT	419 143,8	74 738,0	+460,8 %
	млн USD	2 814,6	623,2	+351,6 %
в том числе специализированные торги по размещению (IPO)				
количество сделок	штук	0	14	X
средний объем одной сделки	млн KZT	X	193,7	X
	тыс. USD	X	1 605,8	X
общий объем сделок	млн KZT	0	2 712,3	X
	млн USD	0	22,5	X

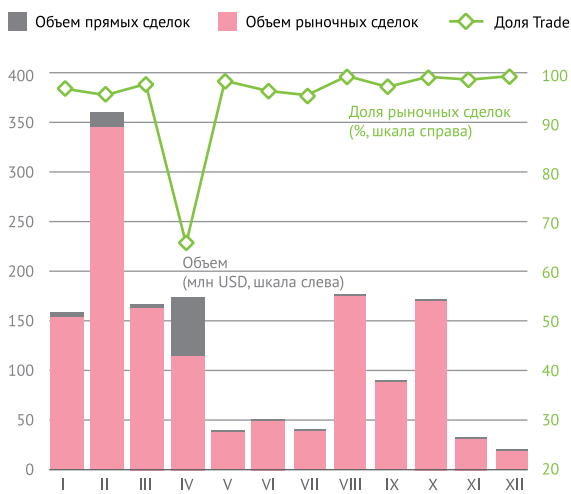
См. раздел „Пояснения к книге фактического материала“

Таблица 16
Отраслевая структура объема торгов акциями на KASE в 2009 и 2008 годах

Отрасль	Объем торгов и его структура						Отраслевая структура официального списка, %
	в 2009 году			в 2008 году			
	млрд KZT	млн USD	доля, %	млрд KZT	млн USD	доля, %	
Энергетика	109,8	736,3	50,2	89,6	743,6	23,2	23,9
Финансы	54,0	381,5	24,7	216,8	1 801,3	56,2	19,2
Основной потребительский сектор	30,1	203,0	13,8	25,7	213,4	6,7	1,0
Сырьевой сектор	15,6	104,8	7,2	20,4	170,3	5,3	52,0
Услуги телекоммуникации	4,4	29,7	2,0	24,4	202,4	6,3	2,3
Дискреционный потребительский сектор	2,3	15,0	1,0	3,5	29,2	0,9	1,0
Промышленность	1,7	11,4	0,8	2,3	19,1	0,6	0,3
Здравоохранение	0,4	2,6	0,2	<0,1	0,3	<0,1	0,1
Информационные технологии	0,2	1,4	0,1	0,9	7,1	0,2	0
Коммунальный сектор	0,1	0,4	<0,1	2,0	16,3	0,5	0,2
Итого	218,5	1 486,1	100,0	385,6	3 203,1	100,0	100,0

См. раздел „Пояснения к книге фактического материала“

Рисунок 3
Объем и доля отдельных видов биржевых сделок с долевыми ценными бумагами в секторе купли-продажи в 2009 году



См. раздел „Пояснения к книге фактического материала“

Рисунок 4
Динамика Индекса KASE в 2009 году



Рисунок 5
Динамика капитализации биржевого рынка акций в 2009 году (млрд USD)

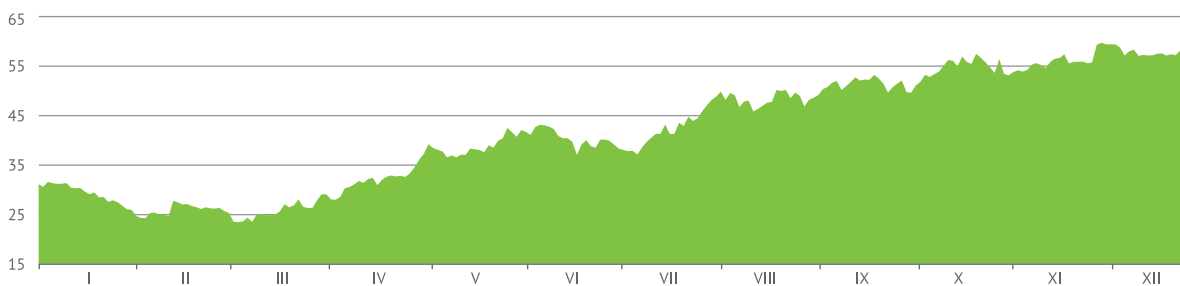


Таблица 17

Сравнительная динамика Индекса KASE и других индексов в 2009 году

	Индексы по ценам казахстанских активов:			Мировые индексы:		
	Индекс KASE	RENCASIA	KTX (USD)	S&P 500	FTSE 100	S&P Global
Значение на 01.01.09	892,3	334,8	295,0	903,3	4 561,8	1 009,5
Значение на 31.12.09	1 768,3	641,9	854,7	1 115,1	5 412,9	1 308,6
Изменение в пунктах	+875,9	+307,1	+559,7	+211,9	+851,1	+299,1
Изменение в %	+98,16	+91,74	+189,70	+23,45	+18,66	+29,63
Волатильность (σ^2) в %	33,41	31,45	36,45	12,16	11,40	13,69
Таблица корреляций						
Индекс KASE	1	0,9905	0,9790	0,9629	0,9538	0,9714
RENCASIA	0,9905	1	0,9867	0,9734	0,9506	0,9741
KTX (USD)	0,9790	0,9867	1	0,9556	0,9328	0,9475
S&P 500	0,9629	0,9734	0,9556	1	0,9742	0,9692
FTSE 100	0,9538	0,9506	0,9328	0,9742	1	0,9611
S&P Global	0,9714	0,9741	0,9475	0,9692	0,9611	1

Таблица 18

Десять самых ликвидных акций на вторичном рынке KASE в 2009 году

Позиция в 2009 году	Позиция в 2008 году	Код акции	Показатель ликвидности (КЛ)	База расчета показателя ликвидности (КЛ):			
				объем сделок, млн KZT	число сделок	число членов KASE	число результативных дней
1	1	RDGZ	3,147	21 419,8	2 380	49	218
2	5	HSBK	2,759	3 654,8	2 366	48	236
3	2	CCBN	2,690	6 305,5	2 293	45	223
4	6	KZTK	2,392	3 339,9	1 630	47	226
5	3	BTAS	2,180	5 327,0	1 288	44	208
6	7	GB_KZMS	2,123	2 675,2	1 449	39	221
7	4	KKGB	2,081	2 387,7	1 319	42	207
8	10	GB_ENRC	1,788	679,4	938	37	210
9	9	KZTKp	1,379	758,1	549	33	154
10	8	KKGBp	0,965	514,6	206	32	72

См. раздел „Пояснения к книге фактического материала“

Таблица 19

Брутто-оборот торгов акциями на KASE в 2009 и 2008 годах в разрезе основных категорий инвесторов

Категория инвесторов	2009 год		2008 год		Тренд, %
	млрд KZT	доля, %	млрд KZT	доля, %	
Клиенты брокеров-дилеров	736,8	86,1	662,7	78,3	+11,2
в том числе физические лица	125,6	14,7	182,8	21,6	-31,3
ООИУПА за счет ПА	55,0	6,4	88,3	10,4	-37,7
Брокеры-дилеры	45,1	5,3	67,3	8,0	-33,0
БВУ	19,0	2,2	27,6	3,3	-30,9
Итого	855,9	100	845,9	100	+1,2
в том числе нерезиденты	510,5	59,6	200,0	23,6	+155,3

См. раздел „Пояснения к книге фактического материала“

Таблица 20

Рэнкинг десяти наиболее активных операторов биржевого вторичного рынка акций в 2009 году

Позиция в 2009 году	Позиция в 2008 году	Краткое наименование компании	Показатель активности Ка
1	1	АО „Дочерняя организация АО „БТА Банк“ „БТА Секьюритис“	3,56
2	3	АО „Сентрас Секьюритиз“	3,16
3	9	АО „АСЫЛ-ИНВЕСТ“	3,13
4	8	АО „Asia Broker Services“	2,97
5	2	АО „Тенгри Финанс“	2,63
6	17	АО „Казпочта“	2,01
7	34	АО „Тройка Диалог Казахстан“	1,91
8	10	АО „Казкоммерц Секьюритиз“ (дочерняя организация АО „Казкоммерцбанк“)	1,904
9	13	АО „Финансовая компания REAL-INVEST.kz“	1,871
10	7	АО „Инвестиционный Финансовый Дом RESMI“	1,84

См. раздел „Пояснения к книге фактического материала“

Таблица 21

Представительский список Индекса KASE по состоянию на 01 января 2010 года

№ п/п	Код акции	Краткое наименование эмитента	Free-float, %	Стоимость free-float, млн USD	Доля в стоимости акций, %
1	KKGB	АО „Казкоммерцбанк“	59,6	2 080,3	17,1
2	HSBK	АО „Народный сберегательный банк Казахстана“	24,7	677,0	17,0
3	RDGZ	АО „Разведка Добыча „КазМунайГаз“	38,6	4 094,0	14,5
4	GB_KZMS	KAZAKHMYS PLC	44,6	4 965,5	14,4
5	GB_ENRC	EURASIAN NATURAL RESOURCES CORPORATION PLC	18,6	3 384,4	13,4
6	CCBN	АО „Банк ЦентрКредит“	33,0	243,0	12,1
7	KZTK	АО „Казхателеком“	22,5	286,6	11,5

См. раздел „Пояснения к книге фактического материала“

Таблица 22

Изменения в представительском списке Индекса KASE в 2009 году

Код акции	Краткое наименование эмитента	Дата включения	Дата исключения
TEBN	„Дочерняя организация Акционерного общества „БТА Банк“ -АО „Темірбанк“		01.02.09
GB_ENRC	EURASIAN NATURAL RESOURCES CORPORATION PLC	01.05.09	
BTAS	АО „БТА Банк“		01.11.09

Таблица 23

Некоторые характеристики акций, входивших в представительский список Индекса KASE, по состоянию на 01 января 2010 года

Код акции	Краткое наименование эмитента	Изменение цены за год, %	Среднедневной объем торгов в 2009 году, тыс. USD	Оборачиваемость, дней	
				для free-float	для инвестиций в \$1 млн
CCBN	АО „Банк ЦентрКредит“	+51,7	172,9	995	5,8
GB_ENRC	EURASIAN NATURAL RESOURCES CORPORATION PLC	+281,8	18,2	165 151	55,1
GB_KZMS	KAZAKHMYS PLC	+603,9	71,8	35 659	13,9
HSBK	АО „Народный сберегательный банк Казахстана“	+267,2	282,8	1 744	3,5
KKGB	АО „Казкоммерцбанк“	+44,6	96,8	9 809	10,3
KZTK	АО „Казхателеком“	+26,6	90,5	2 922	11,0
RDGZ	АО „Разведка Добыча „КазМунайГаз“	+132,1	747,1	3 756	1,3

См. раздел „Пояснения к книге фактического материала“

Таблица 24

Ценовые мультипликаторы Индекса KASE и его компонентов по состоянию на 01 января 2010 года

№ п/п	Код акции	Краткое наименование эмитента	Price to Earnings (PE)	Price to Book (PB)	Price to Sales (PS)
1	KKGB	АО „Казкоммерцбанк“	25,0	1,3	14,6
2	HSBK	АО „Народный сберегательный банк Казахстана“	27,1	1,5	27,3
3	RDGZ	АО „Разведка Добыча „КазМунайГаз“	7,5	1,6	7,1
4	GB_KZMS	KAZAKHMYS PLC	12,1	1,5	10,7
5	GB_ENRC	EURASIAN NATURAL RESOURCES CORPORATION PLC	26,0	2,0	18,6
6	CCBN	АО „Банк ЦентрКредит“	31,6	1,1	36,1
7	KZTK	АО „Казхателеком“	8,3	0,9	3,7
Индекс акций KASE			20,0	1,4	17,0

См. раздел „Пояснения к книге фактического материала“

Рисунок 6

Динамика Индекса KASE и ведущих мировых индексов в 2009 году

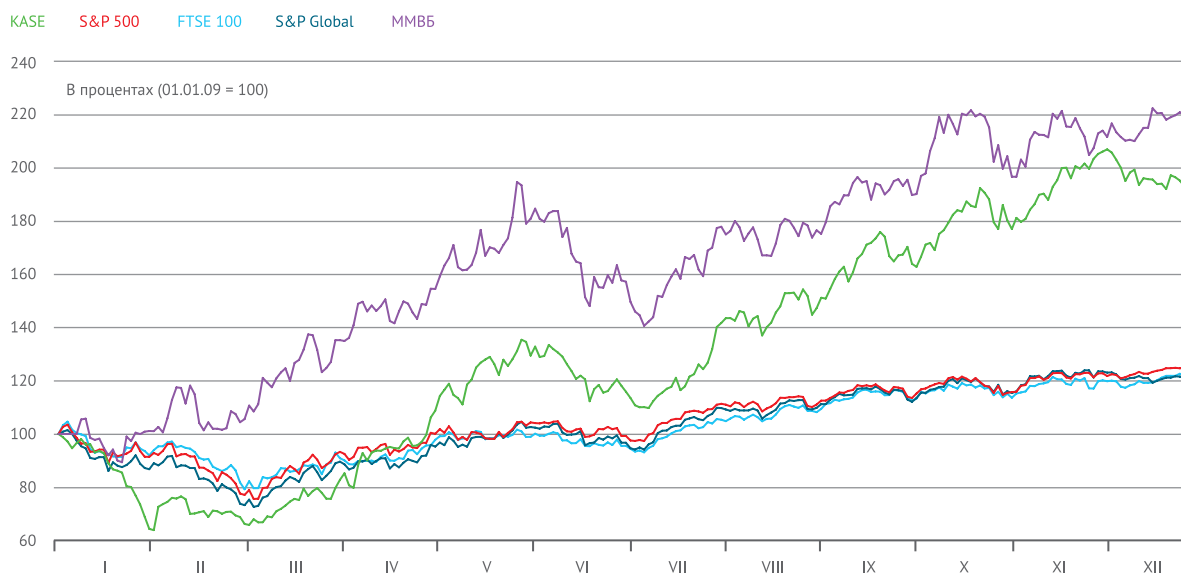


Рисунок 7

Изменение отраслевой структуры представительского списка Индекса KASE в 2009 году

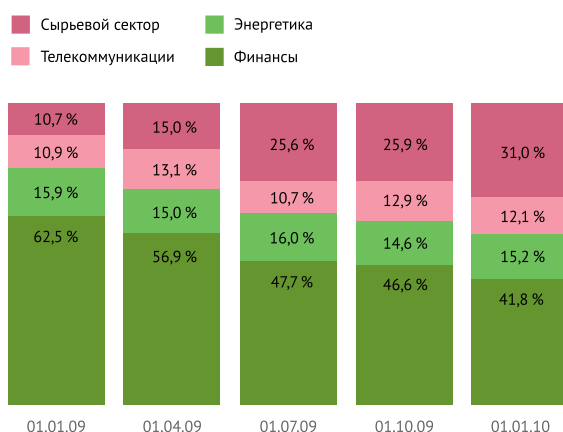


Рисунок 8

Динамика пятидневной скользящей средней показателя Price to Book семи наиболее ликвидных простых акций в 2009 году



Рынок корпоративных долговых ценных бумаг

Таблица 25

Официальный список KASE на 01 января 2010 года

Код инструмента	Краткое наименование эмитента	НИН или ISIN	Суммарная стоимость размещенных облигаций			Доля размещенных облигаций в общем объеме выпуска, %
			по номиналу, млн KZT	по рыночной цене, млн KZT	тыс. USD	
Долговые обязательства с рейтинговой оценкой						
AGKКb1	АО „Аграрная кредитная корпорация“	KZ2C0Y05C515	2 575,9	2 405,2	16 201,0	85,9
ATFBb7	АО „АТФБанк“	KZ2C0Y02D601	-	-	-	X
ATFBe3		XS0217138139	29 692,0	-	-	100,0
ATFBe4		XS0233829463	29 692,0	29 245,3	196 991,4	100,0
ATFBe5		XS0253723281	51 961,0	-	-	100,0
ATFBe6		XS0286908867	44 060,3	-	-	100,0
BRKZe2	АО „Банк Развития Казахстана“	XS0179958805	14 846,0	15 714,5	105 850,0	100,0
BRKZe3		XS0220743776	14 846,0	14 252,2	96 000,0	100,0
BRKZe4		XS0248160102	22 269,0	-	-	100,0
HSBKe2	АО „Народный сберегательный банк Казахстана“	XS0253878051	40 121,3	-	-	100,0
HSBKe3		XS0298931287	94 721,8	-	-	100,0
HSBKe4		XS0358156510	74 230,0	-	-	100,0
KAFIb1	АО „КазАгроФинанс“	KZPC1Y05C285	3 000,0	2 782,9	18 745,4	100,0
KAFIb2		KZP02Y05C287	-	-	-	X
KKGBe4	Kazkommerts International B.V.	XS0167149094	68 284,2	63 538,3	427 982,6	92,0
KKGBe5		XS0190240324	50 093,4	41 076,6	276 684,4	84,4
KKGBe8		XS0234488236	62 466,3	36 230,5	244 042,0	84,2
KKGBe9		XS0248696873	-	-	-	X
KKGBe15		XS0276707923	56 982,7	-	-	76,8
KKGBe16		XS0286431878	-	-	-	X
KKGBe17		XS0286431100	-	-	-	X
KMGZb2	АО „Национальная компания „КазМунайГаз“	KZ2C0Y10D596	-	-	-	X
KZTKb2	АО „Казхателеком“	KZ2C0Y10D612	45 500,0	-	-	100,0
MREKb2	АО „Мангистауская распределительная электросетевая компания“	KZPC1Y05B665	472,2	475,1	3 200,5	94,4
MREKb3		KZPC2Y05B665	700,0	672,0	4 526,4	100,0
MREKb4		KZPC3Y05B663	500,0	499,2	3 362,4	100,0
MREKb5		KZPC4Y05B661	782,1	841,1	5 665,8	97,8
MREKb6		KZP05Y05B662	602,7	660,2	4 447,0	75,3
US_JPM_e1	JPMorgan Chase Bank, National Association	XS0244509963	-	-	-	X
US_MER_e1	Merrill Lynch & Co., Inc	XS0240118017	-	-	-	X
Итого 30 наименований долговых обязательств 11 эмитентов			708 398,8	208 393,1	1 403 698,7	
Долговые обязательства без рейтинговой оценки первой подкатегории						
AKFIb2	АО „АМФ Group“	KZ2C0Y07D139	694,8	825,4	5 559,5	99,3
ALBNb2	АО Дочерний Банк „Альфа-Банк“	KZP01Y03C987	1 271,0	1 279,6	8 618,9	42,4
APKIb1	ТОО „Корпорация „АПК-Инвест“	KZP01Y03C995	2 250,8	2 127,8	14 332,3	45,0
APKIb2		KZP02Y03C993	1 200,0	1 138,3	7 667,6	24,0
APKIb3		KZP03Y03C991	9 796,1	9 240,2	62 240,3	98,0
ASNDb2	АО „Астана-Недвижимость“	KZP01Y05D295	2 469,4	2 331,2	15 702,9	24,7

→

Таблица 25 (продолжение)

Код инструмента	Краткое наименование эмитента	НИН или ISIN	Суммарная стоимость размещенных облигаций			Доля размещен- ных облигаций в общем объеме выпуска, %	
			по номиналу, млн KZT	по рыночной цене			
				млн KZT	тыс. USD		
ATFBb4	АО „АТФБанк“	KZ2CKY10B406	4 500,0	3 774,6	25 425,0	100,0	
ATFBb5		KZPC1Y07B598	13 000,0	12 702,2	85 559,6	100,0	
ATFBb6		KZPC2Y07B596	13 000,0	12 164,2	81 936,1	100,0	
ВТАIb1	АО „Дочерняя ипотечная организация акционерного общества „БТА Банк“ “БТА Ипотека“	KZ2C0Y07A861	500,0	435,0	2 930,1	100,0	
ВТАIb2		KZ2CKY10B257	1 500,0	480,3	3 235,3	100,0	
ВТАIb3		KZPC1Y07B335	1 641,2	1 641,2	11 054,7	82,1	
ВТАIb4		KZPC2Y05B335	1 946,1	1 167,7	7 865,2	97,3	
ВТАIb5		KZPC3Y10B333	4 000,0	1 173,6	7 905,2	100,0	
ВТАIb6		KZP04Y05B335	2 000,0	1 335,0	8 992,4	100,0	
ВТАIb7		KZPC1Y07B648	1 417,0	804,8	5 420,7	35,4	
ВТАIb8		KZPC2Y08B644	7 000,0	1 933,4	13 023,0	100,0	
ВТАIb9		KZPC3Y10B648	4 000,0	4 000,0	26 943,3	100,0	
ВТАIb11		KZPC1Y10C111	1 004,1	350,5	2 360,6	10,0	
ВТАIb12		KZP02Y10C113	4,1	1,9	12,9	0,4	
ВТАIb13		KZP03Y10C111	10,0	3,9	26,6	1,0	
ВТАIb14		KZP05Y07C112	3 895,5	2 830,5	19 065,7	39,0	
ВТАIb16		KZP07Y10C112	17,2	4,7	31,5	<0,1	
САСMb1		АО „Central Asia Cement“	KZ2C0Y05C101	2 700,0	1 813,4	12 214,5	100,0
ССВNb3		АО „Банк ЦентрКредит“	KZ2CKY07A750	2 000,0	1 990,5	13 407,7	100,0
ССВNb4	KZ2CKY07B287		2 000,0	1 969,4	13 265,5	100,0	
ССВNb6	KZ2CKY10B455		1 300,0	1 132,2	7 626,5	100,0	
ССВNb7	KZ2CKY10B604		2 000,0	1 761,2	11 863,4	100,0	
ССВNb8	KZPC1Y10B659		2 000,0	1 469,9	9 900,7	100,0	
ССВNb9	KZPC2Y10B657		4 500,0	3 138,0	21 137,1	100,0	
ССВNb10	KZPC3Y10B655		3 000,0	2 284,4	15 387,4	100,0	
ССВNb11	KZPC4Y10B653		2 000,0	1 783,1	12 010,6	100,0	
ССВNb12	KZPC5Y05B650		5 000,0	4 952,6	33 359,8	100,0	
ССВNb13	KZPC6Y10B658		4 000,0	3 280,0	22 093,5	100,0	
ССВNb14	KZPC7Y10B656		5 000,0	3 960,6	26 678,1	100,0	
ССВNb15	KZPC8Y10B654		3 000,0	3 069,4	20 674,7	100,0	
ССВNb16	KZPC9Y03B659		2 000,0	1 973,0	13 289,7	100,0	
ССВNb17	KZPC0Y05B651		5 000,0	4 939,8	33 273,4	100,0	
ССВNb18	KZP11Y15B651		5 000,0	4 997,5	33 662,0	100,0	
ССВNb19	KZP12Y10B650		6 000,0	5 998,7	40 406,1	100,0	
ССВNb20	KZP13Y15B657		3 500,0	3 267,0	22 006,1	100,0	
ССВNb21	KZP01Y05D212		-	-	-	X	
ССВNb22	KZP02Y10D210		-	-	-	X	
ССВNb23	KZP03Y15D217		-	-	-	X	
СНFMb2	АО „Химфарм“		KZ2C0Y05C481	-	-	-	X
СВNb2	АО „Kaspi Bank“		KZ2CKY07A743	3 092,0	3 019,3	20 337,3	99,7
СВNb3			KZ2CKY07B014	7 515,9	7 115,9	47 931,2	98,3
СВNb4		KZ2CKY07B204	6 909,1	6 021,6	40 560,6	98,7	
СВNb5		KZPC1Y07B465	3 437,5	2 937,6	19 787,3	98,2	
СВNb6		KZPC2Y10B467	8 257,8	6 561,2	44 195,1	82,6	
СВNb7		KZP03Y10B469	3 958,0	2 857,5	19 247,4	79,2	
СВNb8		KZP04Y10B467	-	-	-	X	
СВNb9		KZP05Y03B469	-	-	-	X	

→

Таблица 25 (продолжение)

Код инструмента	Краткое наименование эмитента	НИН или ISIN	Суммарная стоимость размещенных облигаций			Доля размещенных облигаций в общем объеме выпуска, %	
			по номиналу, млн KZT	по рыночной цене			
				млн KZT	тыс. USD		
СТЕСb1	АО „Центрально-Азиатская топливно-энергетическая компания“	KZ2COY10D307	15 469,4	14 303,0	96 342,7	77,3	
EKGSb1	ТОО „Экибастузская ГРЭС-1“	KZ2POY05D650	-	-	-	X	
ERKAb1	ТОО „ZHERSU POWER“	KZ2POY05D171	-	-	-	X	
EUBNb2	АО „Евразийский банк“	KZ2CKY07B360	2 672,2	2 704,3	18 215,4	89,1	
EUBNb3		KZ2CKY07B915	7 254,0	6 365,6	42 877,2	72,5	
EUBNb4		KZPC1Y07C612	9 972,6	8 221,0	55 375,1	99,7	
EUBNb5		KZP02Y15C617	7 137,5	6 395,5	43 079,3	71,4	
EUBNb6		KZP03Y07C612	4,7	4,7	31,6	0,1	
EUBNb7		KZP04Y10C614	-	-	-	X	
EUBNb8		KZP01Y15D252	791,2	968,5	6 523,7	52,7	
EUBNb9		KZP02Y07D257	3 055,1	-	-	13,9	
EXBNb1	АО „Эксимбанк Казахстан“	KZPC1Y07C299	9 769,5	7 377,0	49 690,3	97,7	
EXBNb2		KZP02Y05C295	6 712,1	5 673,8	38 217,8	67,1	
EXBNb3		KZP03Y07C299	-	-	-	X	
HSBKb4	АО „Народный сберегательный банк Казахстана“	KZPC2Y06B192	5 000,0	4 990,9	33 618,1	100,0	
HSBKb7		KZPC4Y10B190	4 000,0	3 396,5	22 877,9	100,0	
HSBKb8		KZPC5Y10B197	4 000,0	3 502,5	23 592,4	100,0	
HSBKb9		KZPC6Y10B195	2 963,0	2 429,1	16 362,0	98,8	
HSBKb10		KZPC7Y10B193	4 470,0	3 748,1	25 246,5	89,4	
HSBKb11		KZPC3Y10C018	4 000,0	3 316,8	22 341,4	100,0	
HSBKb12		KZPC1Y10C590	10 000,0	8 532,6	57 473,8	100,0	
HSBKb13		KZP02Y10C592	5 000,0	4 770,0	32 129,9	100,0	
HSBKb14		KZP03Y10C590	5 000,0	5 250,0	35 363,1	100,0	
HSBKb15		KZP04Y03C593	5 726,2	-	-	82,8	
HSBKb16		KZP05Y03C590	2 041,6	-	-	23,0	
HSBKb17		KZP06Y10C593	-	-	-	X	
IMSKb1		АО „Имсталькон“	KZP01Y07D549	3 974,0	4 801,3	32 340,4	99,4
IMSKb2			KZP02Y07D547	962,0	-	-	21,9
KASSb1		АО „НГСК КазСтройСервис“	KZ2CKY05B885	3 000,0	2 813,0	18 947,8	100,0
KASTb1		АО „Холдинг	KZPC1Y05C053	4 000,0	4 278,8	28 821,4	100,0
KASTb2		КАЗЭКСПОРТАСТЫК“	KZPC2Y05C051	6 000,0	4 880,5	32 874,0	100,0
KAZIb2	АО „Карагандинский завод	KZPC2Y05B806	1 500,0	946,5	6 375,7	100,0	
KAZIb3	асбестоцементных изделий“	KZP03Y05B808	463,1	-	-	23,2	
KIBNb1	АО „Казинвестбанк“	KZ2CKY07B733	1 238,1	1 154,2	7 774,7	99,0	
KIBNb3		KZ2COY03C692	5 140,2	4 921,3	33 149,2	84,3	
KIBNb4		KZ2COY03C932	-	-	-	X	
KKAGb1	АО „Казахстан Кагазы“	KZ2CKY05B448	4 000,0	2 069,0	13 936,6	100,0	
KKAGb2		KZPC1Y05C020	3 487,9	2 622,5	17 664,4	99,7	
KKAGb3		KZPC2Y07C024	3 500,0	2 275,1	15 325,0	100,0	
KKAGb4		KZ2COY05D117	4 888,3	5 071,5	34 161,0	40,7	
KKGBb4	АО „Казкоммерцбанк“	KZ2CKY10B513	6 996,2	5 477,0	36 892,2	99,9	
KKGBb5		KZ2CKY10B695	5 500,0	6 039,3	40 679,7	100,0	
KKGBb6		KZP01Y10C727	10 000,0	9 468,2	63 775,8	100,0	
KKGBb7		KZP02Y10C725	10 000,0	9 137,3	61 547,1	100,0	
KKGBb8		KZP03Y10C723	1 564,9	1 305,0	8 790,0	15,6	
KKGBe19	Kazkommerts International B.V.	XS0338078487	18 557,5	-	-	100,0	
KKGBe20		XS0366928397	34 145,8	-	-	100,0	

→

Таблица 25 (продолжение)

Код инструмента	Краткое наименование эмитента	НИН или ISIN	Суммарная стоимость размещенных облигаций			Доля размещенных облигаций в общем объеме выпуска, %	
			по номиналу, млн KZT	по рыночной цене			
				млн KZT	тыс. USD		
KKI_b1	АО „НОМЕБРОКЕР“	KZ2COY03C585	2 965,8	2 795,7	18 831,2	74,1	
KMGZb1	АО „Национальная компания „КазМунайГаз“	KZ2COY35D528	190 000,0	-	-	100,0	
KONDb1	АО „Конденсат“	KZ2COY05C192	1 356,7	745,9	5 024,2	45,2	
KZIKb2	АО „Казахстанская Ипотечная Компания“	KZ2CKY10A853	1 200,0	983,1	6 622,1	40,0	
KZIKb3		KZ2CKY10A986	2 952,5	2 384,3	16 060,3	59,0	
KZIKb4		KZ2CKY10B075	2 952,5	2 445,2	16 470,6	59,0	
KZIKb6		KZ2CKY07B220	4 111,1	3 839,8	25 864,0	82,2	
KZIKb7		KZ2CKY07B303	5 000,0	4 609,0	31 045,4	100,0	
KZIKb8		KZ2CKY10B315	5 000,0	3 500,0	23 575,4	100,0	
KZIKb10		KZPC2Y05B145	5 000,0	4 979,0	33 537,7	100,0	
KZIKb11		KZPC1Y10B543	5 000,0	3 516,1	23 683,8	100,0	
KZIKb12		KZPC2Y12B547	5 000,0	3 567,5	24 030,0	100,0	
KZIKb16		KZPC4Y10B547	4 825,0	4 454,4	30 004,3	96,5	
KZIKb17		KZP02Y09C495	10 000,0	6 411,0	43 183,5	100,0	
KZIKb18		KZP03Y05C491	5 000,0	4 762,2	32 077,1	100,0	
KZIKb19		KZP04Y04C492	5 000,0	5 179,5	34 888,2	100,0	
KZTCb1		АО „KazTransCom“	KZ2CKY07A834	3 032,7	2 846,3	19 363,7	99,8
KZTCb2			KZ2COY03D492	1 297,2	1 189,2	8 010,0	43,2
LOGCb1		АО „ЛОГИКОМ“	KZ2COY03C569	1 895,2	1 758,0	11 841,5	99,7
LOGCb2			KZ2COY05D281	137,6	121,3	817,0	8,1
NRBNb2		АО „Нурбанк“	KZ2CKY08A774	3 909,7	3 581,6	24 124,7	98,0
NRBNb5	KZPC2Y10B426		4 995,3	3 650,6	24 589,5	99,9	
NRBNb6	KZPC3Y07B420		4 556,7	4 372,7	29 454,0	91,1	
NRBNb7	KZP04Y05B426		10 000,0	10 652,9	71 756,2	100,0	
NRBNb8	KZ2COY01D629		16 000,0	15 999,8	107 772,0	100,0	
PDENb1	АО „ПАВЛОДАРЭНЕРГО“		KZ2COY10C606	3 907,0	2 814,0	18 954,7	48,8
PRKRb2	АО „Национальная контрактная корпорация“	KZ2CKY05B091	15 000,0	13 862,4	93 374,7	100,0	
RESCb1	ТОО „Группа компаний „RESMI“	KZ2POY07C187	4 598,0	4 262,0	28 708,2	38,3	
RGBRb4	АО „RG Brands“	KZPC1Y05B980	1 500,0	1 331,9	8 971,2	100,0	
RGBRb5		KZPC2Y05B988	1 500,0	1 463,2	9 856,1	100,0	
RGBRb6		KZPC3Y07B982	2 000,0	1 589,7	10 708,1	100,0	
SATCb1	АО „SAT & Company“	KZ2COY07C826	5 375,2	6 448,8	43 437,8	35,8	
SKKZb1	АО „Фонд национального благосостояния „Самрук-Казына“	KZP01Y06D392	40 500,0	-	-	100,0	
SKKZb2		KZP02Y07D398	40 500,0	-	-	100,0	
SKKZb3		KZP03Y08D394	40 500,0	-	-	100,0	
SKKZb4		KZP04Y09D390	40 500,0	-	-	100,0	
SKKZb5		KZP05Y10D395	40 500,0	-	-	100,0	
SKKZb6		KZP06Y11D391	40 500,0	-	-	100,0	
SKKZb7		KZP07Y12D397	40 500,0	-	-	100,0	
SKKZb8		KZP08Y13D393	40 500,0	-	-	100,0	
SKKZb9		KZP09Y14D399	40 500,0	-	-	100,0	
SKKZb10		KZP10Y15D394	40 500,0	-	-	100,0	
SKKZb11		KZP11Y06D391	34 500,0	-	-	100,0	
SKKZb12		KZP12Y07D397	34 500,0	-	-	100,0	
SKKZb13		KZP13Y08D393	34 500,0	-	-	100,0	

→

Таблица 25 (продолжение)

Код инструмента	Краткое наименование эмитента	НИН или ISIN	Суммарная стоимость размещенных облигаций			Доля размещенных облигаций в общем объеме выпуска, %	
			по номиналу, млн KZT	по рыночной цене			
				млн KZT	тыс. USD		
SKKZb14		KZP14Y09D399	34 500,0	-	-	100,0	
SKKZb15		KZP15Y10D394	34 500,0	-	-	100,0	
SKKZb16		KZP16Y11D390	34 500,0	-	-	100,0	
SKKZb17		KZP17Y12D396	34 500,0	-	-	100,0	
SKKZb18		KZP18Y13D392	34 500,0	-	-	100,0	
SKKZb19		KZP19Y14D398	34 500,0	-	-	100,0	
SKKZb20		KZP20Y15D393	34 500,0	-	-	100,0	
SKKZb21		KZ2C0Y35D510	190 000,0	-	-	100,0	
TEBNb3	Дочерняя организация Акционерного общества БТА Банк-АО „Темірбанк“	KZ2CKY10A648	683,6	447,4	3 013,6	31,1	
TEBNb4		KZPC1Y10B550	600,0	562,2	3 787,2	12,0	
TEBNb6		KZPC3Y07B552	3 873,4	1 747,1	11 768,1	96,8	
TEBNb7		KZPC4Y09B556	2 992,0	2 962,1	19 952,0	99,7	
TEBNb8		KZPC5Y06B559	3 492,0	3 647,0	24 565,4	99,8	
TEBNb10		KZPC7Y10B557	2 478,3	1 957,4	13 184,5	55,1	
TEBNb11		KZPC8Y15B554	3 960,0	3 959,5	26 670,7	99,0	
TEBNb12		KZPC1Y03C330	2 438,7	1 951,0	13 141,3	30,5	
TEBNb13		KZPC2Y05C333	433,2	382,9	2 579,0	4,4	
TEBNb14		KZPC3Y09C333	928,0	950,9	6 405,3	15,5	
TEBNb15		KZPC4Y09C331	853,2	650,5	4 381,9	11,7	
TEBNb16		KZPC5Y10C336	7 195,0	2 699,9	18 186,1	98,4	
TEBNb17		KZPC6Y10C334	1 500,0	1 099,9	7 408,8	25,0	
TEBNb18		KZP07Y10C336	-	-	-	X	
TSBNb2		АО „Цеснабанк“	KZ2CKY07B626	2 960,7	2 370,0	15 963,6	98,7
TSBNb4			KZPC2Y05B871	849,5	733,4	4 939,7	28,3
TSBNb5			KZPC3Y08B873	2 839,2	1 760,0	11 855,2	94,6
TSBNb6			KZPC4Y09B879	2 575,4	2 341,4	15 771,0	64,4
TSBNb7	KZPC1Y20C367		3 484,2	4 275,0	28 795,7	87,11	
TXBNb2	Дочерний Банк АО „Сбербанк России“		KZ2CKY07A792	3 000,0	3 016,2	20 316,3	100,0
TXBNb3			KZ2CKY07B352	2 419,4	2 261,6	15 233,5	80,6
ULBAb2	АО „Ульбинский металлургический завод“	KZ2C0Y04C450	2 000,0	-	-	100,0	
VITAb5	АО „VITA“	KZ2CKY07B964	7 298,3	1 289,6	8 686,5	100,0	
VMZVb1	АО „Востокмашзавод“	KZ2C0Y05D638	64,0	64,0	431,0	3,2	
Итого 177 наименований долговых обязательств 43 эмитентов			1 748 230,5	474 496,0	3 196 311,7		
Долговые обязательства без рейтинговой оценки второй подкатегории							
ABDIb1	АО „АБДИ Компани“	KZ2C0Y05C804	7 470,0	4 419,9	29 771,8	83,0	
AESOb1	ТОО „Алматыэнергосбыт“	KZ2P0Y07D045	250,8	271,2	1 826,8	27,9	
ALLZb1	АО „Альтернативные Финансы“	KZPC1Y05C145	621,9	614,7	4 140,3	24,9	
ASAVb1	АО „АЗИЯ АВТО“	KZPC1Y03C348	1 000,0	989,3	6 663,8	100,0	
ASAVb2		KZPC2Y03C346	1 321,6	1 210,6	8 154,4	66,1	
ASZSb1	АО „Астана Газ Сервис“	KZ2CKY05B893	289,0	-	-	100,0	
BTTRb1	АО „Батыс транзит“	KZ2CKY13B996	17 671,3	17 203,5	115 880,0	93,8	
CBH_b1	АО Caspian Beverage Holding	KZ2C0Y05C861	125,0	107,3	722,4	25,0	
DNTLb1	АО „Dent-Lux“ (Дент-Люкс)	KZ2CKY04B946	319,3	235,2	1 584,5	63,9	
EKTNb1	АО „ЭКОТОН+“	KZ2C0405C218	983,9	919,4	6 193,2	98,4	
JGOKb2	АО „Жайремский горно-обогатительный комбинат“	KZ2CKY07B907	2 310,6	2 153,4	14 505,2	51,4	

→

Таблица 25 (продолжение)

Код инструмента	Краткое наименование эмитента	НИН или ISIN	Суммарная стоимость размещенных облигаций			Доля размещенных облигаций в общем объеме выпуска, %
			по номиналу, млн KZT	по рыночной цене		
				млн KZT	тыс. USD	
KATRb2	АО „Атамекен-Агро“	KZP01Y10D329	2 964,6	3 099,0	20 874,2	27,0
KDTSb1	АО „Кедентранссервис“	KZ2CKY05B976	1 686,5	1 025,2	6 905,8	33,7
KRZHb1	ТОО „Караганды Жарык“	KZPP1Y05B763	678,3	484,0	3 260,3	96,9
KSMKb1	АО „РТ Холдинг“	KZ2P0Y05C439	774,1	366,5	2 468,8	59,5
KSMKb2		KZPP1Y05C357	1 295,4	837,6	5 642,0	99,6
MAG_b1	АО „MAG“	KZ2C0Y05C135	494,9	415,7	2 800,2	15,2
NFBNb1	АО „Delta Bank“	KZ2CKY07B717	1 957,6	1 033,6	6 962,1	65,3
OILAb1	ТОО „Oilan Ltd.“	KZ2P0Y03C913	83,3	77,7	523,3	16,7
ORDKb2	ТОО „Кредитное товарищество „ОРДА кредит“	KZ2P0Y05C900	458,0	414,8	2 793,8	30,5
PDEsb1	АО „Павлодарская Распределительная Электросетевая Компания“	KZ2CKY05B794	1 816,7	1 727,8	11 638,3	81,7
REALb1	АО „Финансовая компания „REAL-INVEST.kz“	KZ2C0Y05C747	1 901,4	1 901,8	12 810,3	38,0
SVMHb1	ТОО „Связьмонтаж Холдинг“	KZ2P0Y05D031	-	-	-	X
TEMAb1	ТОО „ТЕМА Ко.“	KZ2P0Y03C673	293,8	264,2	1 779,9	29,4
TKUDb1	АО „Горно-обогатительный комбинат „Торт-Кудык“	KZ2C0Y05B830	558,8	565,4	3 808,7	27,9
TMLZb1	АО „Темірлізинг“	KZ2C0Y05C465	500,0	234,1	1 576,6	100,0
TSASb1	ТОО „Концерн „Цесна-Астык“	KZ2PKY05C260	2 997,8	2 706,7	18 232,1	99,9
UKPFb2	АО „Усть-Каменогорская птицефабрика“	KZP01Y05D154	214,3	188,7	1 271,3	10,7
VITAb4	АО „VITA“	KZ2CKY05B539	4 999,5	1 485,6	10 007,0	100,0
ZERDb1	АО „Kazcat“	KZ2C0Y05C622	2 989,9	2 989,9	20 139,3	59,8
Итого 30 наименований долговых обязательств 28 эмитентов			59 028,2	47 943,1	322 936,4	
Долговые обязательства буферной категории						
AKKMb1	ТОО „Акмола Курлыс Материалдары“	KZ2P0Y03C665	2 607,9	2 536,1	17 082,7	52,2
ALTMb1	АО „Алматытемір“	KZ2C0Y05C788	500,0	-	-	25,0
ASBNb3	АО „Альянс Банк“	KZ2CKY07B394	2 928,3	617,0	4 155,9	97,6
ASBNb7		KZPC4Y07B576	4 966,2	1 069,2	7 202,1	99,3
ASBNb8		KZPC5Y05B577	4 115,0	3 343,8	22 523,6	82,3
ASBNb9		KZPC6Y03B570	8 378,5	8 433,8	56 808,6	83,8
ASBNb10		KZPC7Y07B579	6 992,8	6 106,7	41 133,9	99,9
ASBNb12		KZP02Y07C960	152,4	-	-	2,2
ASBNb13		KZP03Y02C969	7,4	-	-	0,1
ASBNb14		KZP04Y10C960	2 645,4	2 246,7	15 133,1	17,6
ASBNb15		KZP01Y06D418	10 500,0	-	-	100,0
ASBNb16		KZP02Y07D414	10 500,0	-	-	100,0
ASBNb17		KZP03Y08D410	10 500,0	-	-	100,0
ASBNb18		KZP04Y09D416	10 500,0	-	-	100,0
ASBNb19		KZP05Y10D411	10 500,0	-	-	100,0
ASBNb20		KZP06Y11D417	10 500,0	-	-	100,0
ASBNb21		KZP07Y12D413	10 500,0	-	-	100,0
ASBNb22		KZP08Y13D419	10 500,0	-	-	100,0
ASBNb23		KZP09Y14D415	10 500,0	-	-	100,0
ASBNb24		KZP10Y15D410	10 500,0	-	-	100,0
ASBNe2	ALB Finance B.V.	XS0234283264	29 692,0	8 600,6	57 932,0	100,0
ASBNe3		XS0251702618	22 269,0	-	-	100,0

→

Таблица 25 (продолжение)

Код инструмента	Краткое наименование эмитента	НИН или ISIN	Суммарная стоимость размещенных облигаций			Доля размещенных облигаций в общем объеме выпуска, %	
			по номиналу, млн KZT	по рыночной цене			
				млн KZT	тыс. USD		
ASELb1	АО „Азия-Электрик“	KZ2C0Y03C411	549,7	516,9	3 481,5	55,0	
ASF1b4	АО „Астана-Финанс“	KZ2CKY07B162	1 897,0	354,5	2 387,7	94,9	
ASF1b5		KZPC1Y05D501	4 492,9	3 073,6	20 703,4	89,9	
ASF1b6		KZPC2Y07B505	883,8	102,0	687,2	44,2	
ASF1b7		KZPC1Y10B634	324,1	62,5	420,9	4,1	
ASF1b8		KZPC1Y05B725	350,6	185,8	1 251,6	70,1	
ASF1b9		KZPC2Y15B722	5 801,6	580,2	3 907,9	64,5	
ASF1b10		KZPC3Y10B721	244,4	199,7	1 345,3	48,9	
ASF1b11		KZPC1Y10C202	8 599,8	8 971,2	60 428,6	86,0	
ASF1b12		KZPC3Y12C253	6 155,8	4 158,6	28 011,4	76,9	
ASF1b13		KZPC1Y03C538	38 106,6	37 415,5	252 024,2	100,0	
ASF1b15		KZPC2Y15C258	7 061,5	8 096,8	54 538,3	88,3	
ASF1b16		KZP01Y15D013	18 817,6	1 881,8	12 675,2	62,7	
ASF1b17		KZP03M42C539	25 824,6	25 818,4	173 908,3	95,9	
ASF1b18		KZP04Y02C538	6 284,7	6 282,0	42 314,6	92,7	
ASF1b19		KZP05Y02C535	-	-	-	X	
ASF1b21		KZP07Y02C531	1 537,0	1 536,8	10 351,4	100,0	
ASF1b22		KZP08Y10C532	9 990,3	9 986,7	67 268,3	99,9	
ASF1b23		KZP02Y03D017	3 929,3	4 096,4	27 592,6	78,6	
ASF1b24		KZP03Y05D010	4 993,7	5 349,5	36 033,6	99,9	
BTASb2		АО „БТА Банк“	KZ2CKY08A535	3 637,8	831,5	5 600,5	100,0
BTASb3			KZ2CKY10A887	7 500,0	2 668,0	17 971,3	100,0
BTASb4			KZ2CKY10B158	13 058,4	1 110,0	7 476,5	93,3
BTASb5			KZ2CKY10B828	2 559,2	197,1	1 327,4	12,8
BTASb7			KZ2C0Y30C125	96 414,5	1 446,2	9 741,5	77,1
BTASb9	KZ2C0Y10D067		40 757,5	40 765,2	274 586,8	40,8	
BTASb10	KZ2C0Y07D147		-	-	-	X	
BTASb11	KZP01Y06D400		30 000,0	-	-	100,0	
BTASb12	KZP02Y07D406		30 000,0	-	-	100,0	
BTASb13	KZP03Y08D402		30 000,0	-	-	100,0	
BTASb14	KZP04Y09D408		30 000,0	-	-	100,0	
BTASb15	KZP05Y10D403		30 000,0	-	-	100,0	
BTASb16	KZP06Y11D409		30 000,0	-	-	100,0	
BTASb17	KZP07Y12D405		30 000,0	-	-	100,0	
BTASb18	KZP08Y13D401		30 000,0	-	-	100,0	
BTASb19	KZP09Y14D407		30 000,0	-	-	100,0	
BTASb20	KZP10Y15D402		30 000,0	-	-	100,0	
BTASb21	KZP01Y06D426		34 500,0	-	-	100,0	
BTASb22	KZP02Y07D422		34 500,0	-	-	100,0	
BTASb23	KZP03Y08D428		34 500,0	-	-	100,0	
BTASb24	KZP04Y09D424		34 500,0	-	-	100,0	
BTASb25	KZP05Y10D429		34 500,0	-	-	100,0	
BTASb26	KZP06Y11D425		34 500,0	-	-	100,0	
BTASb27	KZP07Y12D421		34 500,0	-	-	100,0	
BTASb28	KZP08Y13D427		34 500,0	-	-	100,0	
BTASb29	KZP09Y14D423		34 500,0	-	-	100,0	
BTASb30	KZP10Y15D428		34 500,0	-	-	100,0	

→

Таблица 25 (продолжение)

Код инструмента	Краткое наименование эмитента	НИН или ISIN	Суммарная стоимость размещенных облигаций			Доля размещенных облигаций в общем объеме выпуска, %
			по номиналу,	по рыночной цене		
			млн KZT	млн KZT	тыс. USD	
BTASe3	TuranAlem Finance B.V.	XS0168848801	81 890,5	16 386,3	110 375,2	91,9
BTASe4		USN89065AF89	59 384,0	-	-	100,0
BTASe5		US89989EAF43	51 961,0	-	-	100,0
BTASe6		XS0251881289	37 115,0	-	-	100,0
DNBNb1	АО „Данабанк“	KZ2CKY05B752	200,0	-	-	20,0
DNBNb2		KZ2CKY05B844	-	-	-	X
DTJLb1	АО „Досжан темир жолы (ДТЖ)“	KZ2CKY23B672	29 993,9	10 925,8	73 594,5	100,0
KSM2b1	ТОО „Комбинат строительных материалов и конструкций-2“	KZ2POY03C772	1 362,2	1 298,9	8 748,9	90,8
KZNB2	АО „Казнефтехим“	KZ2CKY05B273	4 566,2	4 281,5	28 839,6	100,0
Итого 78 наименований долговых обязательств 12 эмитентов			1 411 500,2	231 533,2	1 559 566,1	
Всего 315 наименований долговых обязательств 90 эмитентов			3 927 157,7	962 365,4	6 482 512,8	

См. раздел „Пояснения к книге фактического материала“

Таблица 26

Изменения в списках KASE в 2009 году

Код инструмента	Краткое наименование эмитента	Даты:				
		листинга	делистинга	понижения категории	повышения категории	перевода в буферную категорию
Официальный список СТП РФЦА						
aASAVb2	АО „АЗИЯ АВТО“		12.02.09			
aASF1b4	АО „Астана-Финанс“					02.10.09
aASF1b5						02.10.09
aASF1b6						02.10.09
aASF1b7						02.10.09
aASF1b8						02.10.09
aASF1b9						02.10.09
aASF1b10						02.10.09
aASF1b11						02.10.09
aASF1b13						02.10.09
aASF1b14			14.09.09			
aASF1b15						02.10.09
aASF1b17						02.10.09
aASF1b18						02.10.09
aASF1b19						02.10.09
aASF1b20			26.06.09			
aASF1b21						02.10.09
aASF1b25			20.05.09			
aASF1b27			20.05.09			
aBGSTb1	АО „БУРЛИНГАЗСТРОЙ“		02.10.09			
aBM_RECHe1	Renaissance Securities Trading Limited		12.03.09			
aBTTRb1	АО „Батыс транзит“		24.04.09			
aELDSb1	АО „Эль-ДОС“		06.05.09			
aHSBKb3	АО „Народный сберегательный банк Казахстана“		19.06.09			

→

Таблица 26 (продолжение)

Код инструмента	Краткое наименование эмитента	Даты:				
		листинга	делистинга	понижения категории	повышения категории	перевода в буферную категорию
aIMSKb1	АО „Имсталькон“	05.08.09				
aIMSKb2		08.10.09				
aKASTb1	АО „Холдинг КАЗЭКСПОРТАСТЫК“		12.02.09			
aKASTb2			12.02.09			
aKKGBe6	Kazkommerts International B.V.		03.11.09			
aPDENb1	АО „ПАВЛОДАРЭНЕРГО“				03.08.09	
Итого новых эмитентов и первых листингов – 1		2	13	0	1	14
Официальный список ОТП KASE						
AGKКb1	АО „Аграрная кредитная корпорация“				29.06.09	
AKFib1	АО „AMF Group“		06.04.09			
AKFib2		30.03.09			29.06.09	
AKKMb1	ТОО „Акмола Курлыс Материалдары“					30.10.09
ALTMb1	АО „Алматытемір“					02.10.09
ALVZb1	АО „Zhansaya-Producing“		29.09.09			
APKib3	ТОО „Корпорация „АПК-Инвест“	15.10.09				
ARSAb1	АО „Аэропорт „Сары-Арка“		03.08.09			
ASBNb1	АО „Альянс Банк“					02.10.09
ASBNb3						02.10.09
ASBNb6			10.04.09			
ASBNb7						02.10.09
ASBNb8						02.10.09
ASBNb9						02.10.09
ASBNb10						02.10.09
ASBNb12						02.10.09
ASBNb13						02.10.09
ASBNb14						02.10.09
ASBNb15		18.03.09				02.10.09
ASBNb16		18.03.09				02.10.09
ASBNb17		18.03.09				02.10.09
ASBNb18		18.03.09				02.10.09
ASBNb19		18.03.09				02.10.09
ASBNb20		18.03.09				02.10.09
ASBNb21		18.03.09				02.10.09
ASBNb22		18.03.09				02.10.09
ASBNb23		18.03.09				02.10.09
ASBNb24		18.03.09				02.10.09
ASBNe2	ALB Finance B.V.					02.10.09
ASBNe3						02.10.09
ASELb1	АО „Азия-Электрик“					02.10.09
ASFib4	АО „Астана-Финанс“					02.10.09
ASFib5						02.10.09
ASFib6						02.10.09
ASFib7						02.10.09
ASFib8						02.10.09
ASFib9						02.10.09
ASFib10						02.10.09
ASFib11						02.10.09

→

Таблица 26 (продолжение)

Код инструмента	Краткое наименование эмитента					Даты:
		листинга	делистинга	понижения категории	повышения категории	перевода в буферную категию
ASFib12						02.10.09
ASFib13						02.10.09
ASFib14			14.09.09			
ASFib15						02.10.09
ASFib16						02.10.09
ASFib22						02.10.09
ASFib23						02.10.09
ASFib24						02.10.09
ATFBb7	АО „АТФБанк“	04.11.09				
ATFBe2			09.11.09			
ATFBe3		01.04.09				
BGSTb1	АО „БУРЛИНГАЗСТРОЙ“		02.10.09			
BIGRb1	АО „БИЛД ИНВЕСТМЕНТС ГРУПП“		29.06.09			
BTAb10	АО „Дочерняя ипотечная организация акционерного общества „БТА Банк“ „БТА Ипотека“		26.05.09			
BTASb1	АО „БТА Банк“		19.02.09			
BTASb2						02.10.09
BTASb3						02.10.09
BTASb4						02.10.09
BTASb5						02.10.09
BTASb7						02.10.09
BTASb9						02.10.09
BTASb10						02.10.09
BTASb11		06.03.09				02.10.09
BTASb12		06.03.09				02.10.09
BTASb13		06.03.09				02.10.09
BTASb14		06.03.09				02.10.09
BTASb15		06.03.09				02.10.09
BTASb16		06.03.09				02.10.09
BTASb17		06.03.09				02.10.09
BTASb18		06.03.09				02.10.09
BTASb19		06.03.09				02.10.09
BTASb20		06.03.09				02.10.09
BTASb21		19.03.09				02.10.09
BTASb22		19.03.09				02.10.09
BTASb23		19.03.09				02.10.09
BTASb24		19.03.09				02.10.09
BTASb25		19.03.09				02.10.09
BTASb26		19.03.09				02.10.09
BTASb27		19.03.09				02.10.09
BTASb28		19.03.09				02.10.09
BTASb29		19.03.09				02.10.09
BTASb30		19.03.09				02.10.09
BTASe3	TuranAlem Finance B.V.					02.10.09
BTASe4						02.10.09
BTASe5						02.10.09
BTASe6						02.10.09

→

Таблица 26 (продолжение)

Код инструмента	Краткое наименование эмитента	Даты:				
		листинга	делистинга	понижения категории	повышения категории	перевода в буферную категорию
CCBNb2	АО „Банк ЦентрКредит“		01.04.09			
CSBNb8	АО „Kaspi Bank“	30.06.09				
CSBNb9		30.06.09				
DNBNb1	АО „Данабанк“					02.10.09
DNBNb2						02.10.09
DTJLb1	АО „Досжан темир жолы (ДТЖ)“					02.10.09
ELDSb1	АО „Эль-ДОС“		06.05.09			
ERKAb1	ТОО „СП ЕРКА“				29.06.09	
EUBNb7	АО „Евразийский банк“	21.01.09				
EUBNb8		21.01.09				
EUBNb9		21.01.09				
EXBNb3	АО „Эксимбанк Казахстан“	12.10.09				
GLOTb2	АО „GLOTUR“ (ГЛОТУР)		02.06.09			
HSBKb3	АО „Народный сберегательный банк Казахстана“		19.06.09			
HSBKb15		24.07.09				
HSBKb16		24.07.09				
HSBKb17		24.07.09				
HSBKe1			07.10.09			
HSBKe4		12.05.09				
ISKEb1	АО „ISKE CAT COMPANY“		02.10.09			
KAFIb1	АО „КазАгроФинанс“				27.02.09	
KAFIb2		10.03.09				
KAZIb1	АО „Карагандинский завод асбестоцементных изделий“		16.02.09			
KAZIb2					29.06.09	
KAZIb3		28.05.09			29.06.09	
KKGBb8	АО „Казкоммерцбанк“	23.04.09				
KKGBe6	Kazkommerts International B.V.		03.11.09			
KKGBe9		29.04.09				
KKGBe15		29.04.09				
KKGBe16		29.04.09				
KKGBe17		29.04.09				
KKGBe18		03.06.09	07.07.09			
KKGBe19		03.06.09				
KKGBe20		03.06.09				
KMGZb1	АО „Национальная компания „КазМунайГаз“	03.07.09				
KMGZb2		27.10.09				
KMSBb1	АО „КОМБИСНАБ“					02.10.09
KSM2b1	ТОО „Комбинат строительных материалов и конструкций-2“					02.10.09
KZASb2	АО „КОСТАНАЙСКИЕ МИНЕРАЛЫ“		17.06.09			
KZDKb1	АО „Казахская дистрибуционная компания“		02.10.09			
KZIKb5	АО „Казахстанская Ипотечная Компания“		01.04.09			
KZIKb19		23.09.09				
KZNNb2	АО „Казнефтехим“					02.10.09
KZTCb2	АО „KazTransCom“	01.07.09				
KZTKb2	АО „Казхателеком“	30.10.09				
MREKb2	АО „Мангистауская распределительная электросетевая компания“				27.03.09	
MREKb3					27.03.09	

→

Таблица 26 (продолжение)

Код инструмента	Краткое наименование эмитента	Даты:				
		листинга	делистинга	понижения категории	повышения категории	перевода в буферную категорию
MREKb4					27.03.09	
MREKb5					27.03.09	
MREKb6		30.03.09				
ORDBb2	АО „Корпорация „Ордабасы“			06.10.09		
ORDKb1	ТОО „Кредитное товарищество „ОРДА кредит“		26.10.09			
ORNKb1	АО „Орнек XXI“		30.01.09			
PRKRb1	АО „Национальная компания „Продовольственная контрактная корпорация“		18.05.09			
RMXRb1	АО „РЭМИКС-Р“		02.10.09			
ROSAb2	АО „РОСА“		02.10.09			
SKKZb1	АО „Фонд национального благосостояния „Самрук-Казына“	13.03.09				
SKKZb2		13.03.09				
SKKZb3		13.03.09				
SKKZb4		13.03.09				
SKKZb5		13.03.09				
SKKZb6		13.03.09				
SKKZb7		13.03.09				
SKKZb8		13.03.09				
SKKZb9		13.03.09				
SKKZb10		13.03.09				
SKKZb11		18.03.09				
SKKZb12		18.03.09				
SKKZb13		18.03.09				
SKKZb14		18.03.09				
SKKZb15		18.03.09				
SKKZb16		18.03.09				
SKKZb17		18.03.09				
SKKZb18		18.03.09				
SKKZb19		18.03.09				
SKKZb20		18.03.09				
SKKZb21		03.07.09				
TEVNB9	Дочерняя организация Акционерного общества „БТА Банк“-АО „Темірбанк“		01.06.09			
TEVNB18		04.02.09				
TSBNb3	АО „Цеснабанк“		09.02.09			
TSNAb1	АО „Корпорация „Цесна“		15.06.09			
TSSMb1	АО „Трансстроймост“		29.09.09			
VITAb5	АО „VITA“				06.10.09	
Итого новых эмитентов – 2, первых листингов – 2		82	31	1	11	76
Официальный список объединенной торговой площадки KASE и РФЦА						
ASBNb1	АО „Альянс Банк“		23.12.09			
ATFBe6	ATF Capital B.V.	14.12.09				
CCBNb21	АО „Банк ЦентрКредит“	30.12.09				
CCBNb22		30.12.09				
CCBNb23		30.12.09				
EKGSb1	ТОО „Экибастузская ГРЭС-1“	30.12.09				
KKGBb2	АО „Казкоммерцбанк“		01.12.09			
KMSBb1	АО „КОМБИСНАБ“		28.12.09			

→

Таблица 26 (продолжение)

Код инструмента	Краткое наименование эмитента					Даты:
		листинга	делистинга	понижения категории	повышения категории	перевода в буферную категорию
NRBNb8	АО „Нурбанк“	30.11.09				
ORDBb2	АО „Корпорация „Ордабасы“		28.12.09			
VMZVb1	АО „Востокмашзавод“	26.11.09				
Итого новых эмитентов – 2, первых листингов – 2		7	4	0	0	0
Всего новых эмитентов – 5, первых листингов – 5		91	48	1	12	90

См. раздел „Пояснения к книге фактического материала“

Таблица 27

Динамика структуры официального списка KASE в 2009 году (на 01 января 2010 года, изменение за год)

Категория допуска	Ценных бумаг		Эмитентов	
	кол-во	тренд	кол-во	тренд
Долговые обязательства с рейтинговой оценкой	30	+8	11	+1
Долговые обязательства без рейтинговой оценки первой подкатегории	177	-1	43	+4
Долговые обязательства без рейтинговой оценки второй подкатегории	30	-34	28	-27
Долговые обязательства буферной категории	78	X	12	X
Всего	315	+51	90	-14

См. раздел „Пояснения к книге фактического материала“

Таблица 28

Отраслевая структура официального списка KASE

Отрасль	На 01.01.10			На 01.01.09		
	млрд KZT	млн USD	доля, %	млрд KZT	млн USD	доля, %
Финансы	2 954,9	19 904,0	94,1	1 344,4	11 129,7	87,6
Промышленность	55,5	373,6	1,8	51,1	423,3	3,3
Основной потребительский сектор	48,6	327,4	1,5	48,2	399,2	3,1
Коммунальный сектор	27,4	184,4	0,9	21,0	174,2	1,4
Сырьевой сектор	21,5	145,0	0,7	18,1	149,6	1,2
Энергетика	14,3	96,3	0,5	29,8	247,0	1,9
Дискреционный потребительский сектор	12,9	86,9	0,4	7,6	63,3	0,5
Услуги телекоммуникации	4,3	29,2	0,1	2,9	24,4	0,2
Информационные технологии	1,9	12,8	0,1	10,7	88,6	0,7
Здравоохранение	0,3	2,2	<0,1	0,9	7,5	0,1
Итого	3 141,7	21 161,7	100,0	1 534,9	12 706,9	100,0

См. раздел „Пояснения к книге фактического материала“

Таблица 29

Объем торгов корпоративными долговыми ценными бумагами на KASE в 2009 году
(по месяцам, кварталам и секторам)

Месяц	Сектор биржевого рынка НЦБ				Итого	
	спецторги по размещению		купля-продажа			
	тыс. USD	млн KZT	тыс. USD	млн KZT	тыс. USD	млн KZT
Январь	40 071,2	4 848,6	276 958,0	33 604,2	317 029,2	38 452,8
Февраль	-	-	356 158,5	52 155,9	356 158,5	52 155,9
Март	-	-	187 862,2	28 353,3	187 862,2	28 353,3
I квартал	40 071,2	4 848,6	820 978,6	114 113,4	861 049,9	118 962,1
Апрель	-	-	116 262,9	17 514,3	116 262,9	17 514,3
Май	-	-	215 655,6	32 428,8	215 655,6	32 428,8
Июнь	-	-	383 510,9	57 661,7	383 510,9	57 661,7
II квартал	-	-	715 429,4	107 604,8	715 429,4	107 604,8
Июль	180,4	27,2	297 078,2	44 752,1	297 258,6	44 779,2
Август	5 304,2	799,6	86 304,0	13 014,2	91 608,2	13 813,8
Сентябрь	-	-	114 640,9	17 297,6	114 640,9	17 297,6
III квартал	5 484,6	826,8	498 023,2	75 063,8	503 507,8	75 890,6
Октябрь	-	-	212 900,3	32 097,9	212 900,3	32 097,9
Ноябрь	-	-	171 070,2	25 685,1	171 070,2	25 685,1
Декабрь	8 712,0	1 293,2	164 979,6	24 521,8	173 691,6	25 815,0
IV квартал	8 712,0	1 293,2	548 950,0	82 304,8	557 662,1	83 598,0
Всего 2009 год	54 267,9	6 968,6	2 583 381,2	379 086,9	2 637 649,1	386 055,5
Структура	2,1%		97,9%		100,0%	
Справочно 2008 год:						
Всего	23 847,1	2 867,4	3 628 149,9	436 198,6	3 651 997,0	439 065,9
Структура	0,7%		99,3%		100,0%	
Тренд 2009 к 2008:						
в деньгах	+30 420,8	+4 101,2	-1 044 768,7	-57 111,7	-1 014 347,9	-53 010,4
в процентах	+127,6	+143,0	-28,8	-13,1	-27,8	-12,1

См. раздел „Пояснения к книге фактического материала“

Таблица 30

Отраслевая структура объема торгов корпоративными долговыми ценными бумагами на KASE в 2009 и 2008 годах

Отрасль	Объем торгов и его структура						Структура официального списка на 01.01.10, %
	в 2009 году			в 2008 году			
	млрд KZT	млн USD	доля, %	млрд KZT	млн USD	доля, %	
Финансы	290,5	1 985,4	76,6	333,0	2 769,7	76,3	94,1
Основной потребительский сектор	42,5	287,0	11,2	9,8	81,3	2,2	1,5
Промышленность	14,0	96,0	3,7	62,4	518,7	14,3	1,8
Коммунальный сектор	11,7	78,0	3,1	14,0	116,2	3,2	0,9
Энергетика	7,1	47,7	1,9	7,5	63,0	1,7	0,5
Сырьевой сектор	4,8	32,2	1,3	5,1	42,2	1,2	0,7
Информационные технологии	3,9	26,5	1,0	1,7	14,3	0,4	0,1
Услуги телекоммуникации	2,3	15,5	0,6	<0,1	0,1	<0,1	0,1
Дискреционный потребительский сектор	2,1	14,9	0,6	2,1	17,4	0,5	0,4
Здравоохранение	<0,1	0,2	<0,1	0,6	5,3	0,1	<0,1
Итого	379,1	2 583,4	100,0	436,2	3 628,1	100,0	100,0

См. раздел „Пояснения к книге фактического материала“

Таблица 31

Сравнительные статистические данные по рынку корпоративных долговых ценных бумаг KASE в 2009 и 2008 годах

Показатель рынка	Единица измерения	2009 год	2008 год	2009 год к 2008 году
Число торговых дней		249	249	0 %
Число результативных дней		249	249	0 %
Показатель результативности торгов	%	100,0	100,0	0 пп
I. Рыночные сделки				
общий объем сделок	млн KZT	371 612,9	431 698,2	-13,9 %
	млн USD	2 532,5	3 590,7	-29,5 %
количество сделок	штук	8 226	5 043	+63,1 %
доля от объема торгов в секторе купли-продажи	%	98,0	99,0	-0,9 пп
доля от кол-ва сделок в секторе купли-продажи	%	99,2	98,7	+0,6 пп
средний объем одной сделки	млн KZT	45,2	85,6	-47,2 %
	млн USD	0,3	0,7	-56,8 %
среднее количество сделок в день	штук	33	20	+63,1 %
среднедневной объем сделок этого типа	млн KZT	1 492,4	1 733,7	-13,9 %
	млн USD	10,2	14,4	-29,5 %
II. Прямые сделки				
общий объем сделок	млн KZT	7 474,0	4 500,4	+66,1 %
	млн USD	50,9	37,5	+35,9 %
количество сделок	штук	63	68	-7,4 %
доля от объема торгов в секторе купли-продажи	%	2,0	1,0	+0,9 пп
доля от кол-ва сделок в секторе купли-продажи	%	0,8	1,3	-0,6 пп
средний объем одной сделки	млн KZT	118,6	66,2	+79,3 %
	млн USD	0,8	0,6	+46,7 %
среднее количество сделок в день	штук	<1	<1	-7,4 %
среднедневной объем сделок этого типа	млн KZT	30,0	18,1	+66,1 %
	млн USD	0,2	0,2	+35,9 %
III. Специализированные торги по размещению				
количество сделок	штук	7	5	+40,0 %
средний объем одной сделки	млн KZT	995,5	573,5	+73,6 %
	млн USD	7,8	4,8	+62,5 %
общий объем сделок этого типа	млн KZT	6 968,6	2 867,4	+143,0 %
	млн USD	54,3	23,8	+127,6 %

См. раздел „Пояснения к книге фактического материала“

Таблица 32

Распределение объема биржевых сделок купли-продажи корпоративных долговых ценных бумаг по категориям официального списка в 2009 году

Месяц	Объем торгов по категориям официального списка								Всего, млн KZT	Число сделок
	С рейтинговой оценкой		Без рейтинговой оценки		Без рейтинговой оценки		Буферная категория			
	млн KZT	доля, %	млн KZT	доля, %	млн KZT	доля, %	млн KZT	доля, %		
Январь	5 417,9	10,7	28 202,7	10,1	4 832,3	8,9	X	X	38 452,8	904
Февраль	3 090,1	6,1	37 829,8	13,5	11 235,9	20,7	X	X	52 155,9	915
Март	828,6	1,6	24 622,8	8,8	2 902,0	5,3	X	X	28 353,3	910
Апрель	2 708,1	5,4	7 229,9	2,6	7 576,3	13,9	X	X	17 514,3	638
Май	15 019,1	29,7	14 404,7	5,2	3 005,0	5,5	X	X	32 428,8	657
Июнь	9 679,7	19,2	44 119,6	15,8	3 862,4	7,1	X	X	57 661,7	858
Июль	2 388,5	4,7	37 650,0	13,5	4 740,7	8,7	X	X	44 779,2	644

→

Таблица 32 (продолжение)

Месяц	Объем торгов по категориям официального списка								Всего, млн KZT	Число сделок
	С рейтинговой оценкой		Без рейтинговой оценки		Без рейтинговой оценки		Буферная категория			
	млн KZT	доля, %	млн KZT	доля, %	млн KZT	доля, %	млн KZT	доля, %		
Август	1 091,3	2,2	12 228,7	4,4	493,8	0,9	X	X	13 813,8	510
Сентябрь	2 737,0	5,4	13 034,1	4,7	1 526,5	2,8	X	X	17 297,6	684
Октябрь	2 004,0	4,0	26 923,4	9,6	3 170,5	5,8	0	0	32 097,9	614
Ноябрь	3 839,9	7,6	13 887,9	5,0	6 763,4	12,4	1 193,9	73,6	25 685,1	541
Декабрь	1 699,6	3,4	19 431,4	7,0	4 255,7	7,8	428,3	26,4	25 815,0	421
Итого	50 503,8	100,0	279 565,0	100,0	54 364,4	100,0	1 622,2	100,0	386 055,5	8 296

См. раздел „Пояснения к книге фактического материала“

Рисунок 9

Капитализация биржевого рынка корпоративных облигаций в 2009 году (млрд USD)

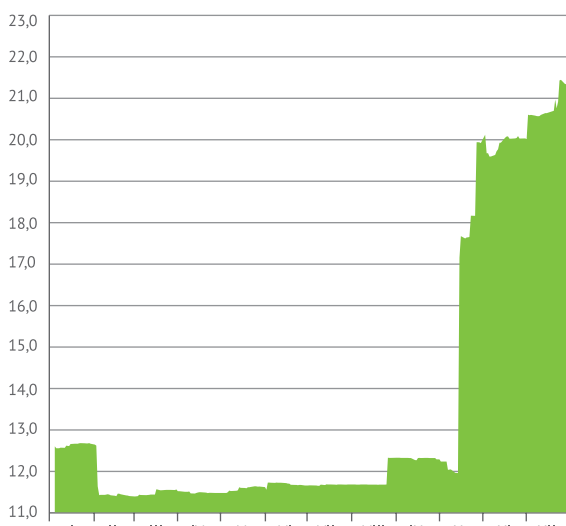


Рисунок 10

Изменение индекса KASE_BC и средневзвешенных „чистых“ цен корпоративных облигаций в 2009 году

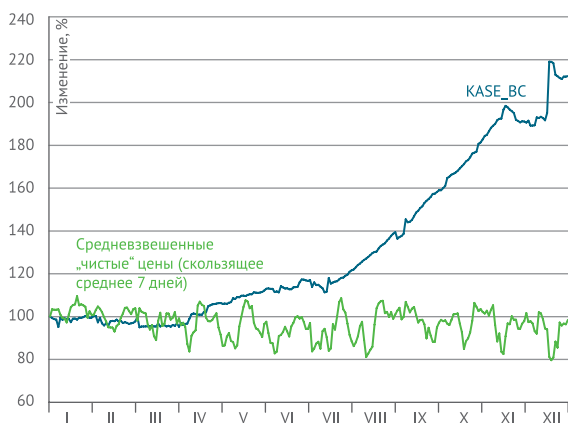


Таблица 33

Брутто-оборот торгов корпоративными долговыми ценными бумагами на KASE в 2009 и 2008 годах в разрезе основных категорий инвесторов

Категория инвесторов	2009 год		2008 год		Тренд, %
	млрд KZT	доля, %	млрд KZT	доля, %	
Клиенты брокеров-дилеров	363,4	47,5	537,5	61,4	-32,4
в том числе физические лица	121,6	15,9	117,3	13,4	+3,7
ООИУПА за счет ПА	253,0	33,1	153,7	17,6	+64,6
Брокеры-дилеры	58,6	7,7	97,5	11,1	-39,9
БВУ	90,2	11,8	86,6	9,9	+4,2
Итого	765,1	100	875,3	100	-12,6
в том числе нерезиденты	8,9	1,2	110,1	12,6	-91,9

См. раздел „Пояснения к книге фактического материала“

Рисунок 11

Динамика индекса доходности корпоративных облигаций KASE_BY в 2009 году



Таблица 34

Рэнкинг десяти наиболее активных операторов биржевого вторичного рынка корпоративных облигаций в 2009 году

Позиция в 2009 году	Позиция в 2008 году	Краткое наименование компании	Показатель активности Ка
1	7	АО „АСЫЛ-ИНВЕСТ“	3,64
2	1	АО „БТА Секьюритис“	2,64
3	2	АО „Инвестиционный Финансовый Дом „RESMI“	2,56
4	5	АО „Asia Broker Services“	2,43
5	11	АО „Сентрас Секьюритиз“	1,95
6	10	АО „Казкоммерц Секьюритиз“ (дочерняя организация АО „Казкоммерцбанк“)	1,86
7	4	АО „ВСС Invest“ - дочерняя организация АО „Банк ЦентрКредит“	1,78
8	3	АО „Тенгри Финанс“	1,58
9	6	АО „Астана-Финанс“	1,35
10	28	АО „Брокерская компания „Астана-Финанс“	1,34

См. раздел „Пояснения к книге фактического материала“

Рынок государственных ценных бумаг

Таблица 35

Объем торгов ГЦБ на KASE в 2009 году (по месяцам, кварталам и секторам)

Месяц	Сектор биржевого рынка ГЦБ				Итого	Доля KASE, %	
	первичный рынок		вторичный рынок				
	тыс. USD	млн KZT	тыс. USD	млн KZT			тыс. USD
Январь	72 366,9	8 797,6	270 830,7	32 866,3	343 197,6	41 663,9	24,1
Февраль	204 626,6	30 613,7	192 571,1	28 067,1	397 197,7	58 680,9	25,8
Март	403 614,4	60 840,0	143 036,4	21 559,5	546 650,8	82 399,5	46,3
I квартал	680 607,9	100 251,4	606 438,2	82 492,9	1 287 046,1	182 744,3	31,6
Апрель	338 808,7	51 078,7	434 874,4	65 495,4	773 683,1	116 574,1	29,7
Май	354 609,4	53 321,6	297 398,6	44 723,4	652 008,0	98 045,0	32,5
Июнь	399 421,9	60 060,0	376 580,3	56 639,4	776 002,2	116 699,4	36,8
II квартал	1 092 840,0	164 460,2	1 108 853,3	166 858,2	2 201 693,3	331 318,4	32,7
Июль	428 809,2	64 600,0	610 630,1	91 991,6	1 039 439,4	156 591,6	36,9
Август	490 438,4	73 956,7	591 246,7	89 152,0	1 081 685,1	163 108,6	31,6
Сентябрь	491 417,8	74 148,1	433 535,7	65 426,7	924 953,5	139 574,9	77,3
III квартал	1 410 665,5	212 704,8	1 635 412,5	246 570,3	3 046 078,0	459 275,1	41,0
Октябрь	498 908,5	75 220,7	243 529,2	36 726,1	742 437,7	111 946,9	51,6
Ноябрь	446 065,3	66 731,5	402 860,7	60 181,5	848 926,0	126 913,0	21,3
Декабрь	529 599,0	78 745,4	787 417,6	117 168,0	1 317 016,6	195 913,4	39,0
IV квартал	1 474 572,8	220 697,6	1 433 807,5	214 075,7	2 908 380,2	434 773,3	33,1
Всего 2009 год	4 658 686,2	698 114,0	4 784 511,4	709 997,1	9 443 197,6	1 408 111,0	35,0
Структура	49,3 %		50,7 %		100,0 %		
Справочно 2008 год:							
Всего	3 868 939,4	465 162,1	3 935 877,7	473 237,1	7 804 817,2	938 399,2	24,1
Структура	49,6 %		50,4 %		100,0 %		
Тренд 2009 к 2008:							
в деньгах	+789 746,8	+232 951,9	+848 633,7	+236 759,9	+1 638 380,4	+469 711,8	
в процентах	+20,4	+50,1	+21,6	+50,0	+21,0	+50,1	

См. раздел „Пояснения к книге фактического материала“

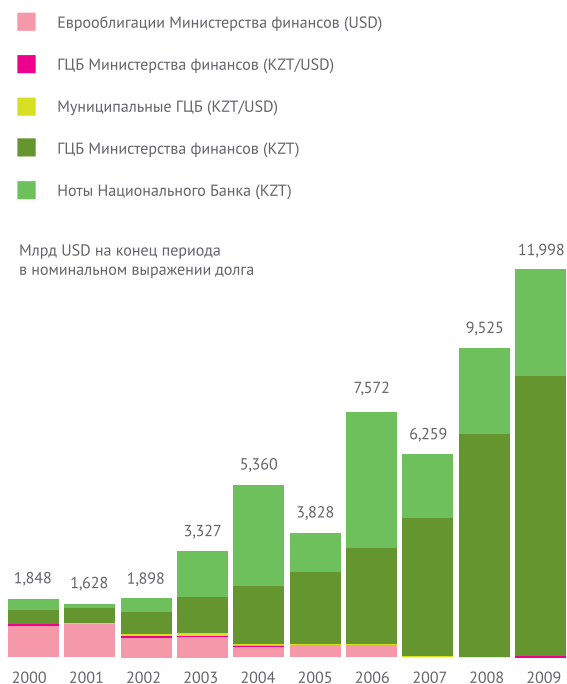
Таблица 36

Сравнительные статистические данные по биржевому рынку ГЦБ в 2009 и 2008 годах

Показатель рынка	Единица измерения	2009 год	2008 год	2009 год к 2008 году
Число торговых дней		249	249	0 %
Число результативных дней		243	222	+9,5 %
Показатель результативности торгов	%	97,6	89,2	+8,4 пп
I. Купля-продажа на вторичном рынке				
общий объем сделок этого типа	млн KZT	709 997,1	473 237,1	+50,0 %
	млн USD	4 784,5	3 935,9	+21,6 %
доля от объема биржевых торгов ГЦБ	%	50,7	50,4	+0,2 пп
количество сделок	штук	2 614	1 474	+77,3 %
средний объем одной сделки	млн KZT	271,6	321,1	-15,4 %
	млн USD	1,8	2,7	-31,5 %
среднее количество сделок в день	штук	11	7	+62,0 %
среднедневной объем сделок этого типа	млн KZT	2 921,8	2 131,7	+37,1 %
	млн USD	19,7	17,7	+11,1 %
II. Специализированные торги по размещению				
общий объем сделок этого типа	млн KZT	698 114,0	465 162,1	+50,1 %
	млн USD	4 658,7	3 868,9	+20,4 %
доля от объема биржевых торгов ГЦБ	%	49,3	49,6	-0,2 пп
количество сделок	штук	916	549	+66,8 %
средний объем одной сделки	млн KZT	762,1	847,3	-10,1 %
	млн USD	5,1	7,0	-27,8 %

Рисунок 12

Динамика госдолга Казахстана, выпущенного в виде ГЦБ, за 2000–2009 годы



См. раздел „Пояснения к книге фактического материала“

Таблица 37

Результаты размещения ГЦБ Министерства финансов Казахстана на KASE в 2009 году

Способ размещения	Дата размещения	Предмет торга	Объем активных заявок, шт.	Объем активных заявок, млн тенге	Спрос к предложению, %	Средневзв. цена спроса	Доходность спроса, % годовых	Объем привлечения, шт.	Объем привлечения, млн тенге	Средневзв. цена, % от номинала	Доходность на торгах, % годовых	Объем выпуска (накопленный), млн тенге
МКМ006_0187 (KZK1KY061873, 100 тенге, 24.09.09 – 17.06.10, actual/actual)												
Аукцион	24.09.09	цена облигаций	550 910 000	53 542,5	367,3	97,1893	5,83	150 200 000	14 703,6	97,89	4,34	14 703,6
Повторный аукцион	28.09.09	цена облигаций	132 120 000	12 933,9	264,2	97,8913	4,44	110 000 000	10 773,3	97,94	4,34	25 476,9
МКМ006_0188 (KZK1KM061881, 100 тенге, 04.11.09 – 04.05.10, actual/actual)												
Аукцион	04.11.09	цена облигаций	541 804 200	52 925,6	451,5	97,6841	4,78	120 000 000	11 742,8	97,86	4,42	12 000,0
МКМ006_0189 (KZK1KY061899, 100 тенге, 08.12.09 – 08.06.10, actual/actual)												
Аукцион	08.12.09	цена облигаций	688 979 948	67 602,5	574,1	98,1196	3,84	133 333 333	13 172,4	98,79	2,45	13 172,4
МКМ009_0014 (KZK1KM090146, 100 тенге, 17.09.09 – 17.06.10, actual/actual)												
Аукцион	17.09.09	цена облигаций	213 080 000	20 485,5	142,1	96,1399	5,37	74 580 000	7 215,7	96,75	4,49	7 215,7
МКМ009_0015 (KZK1KM090153, 100 тенге, 01.10.09 – 01.07.10, actual/actual)												
Аукцион	01.10.09	цена облигаций	467 360 000	44 864,1	389,5	95,9947	5,58	120 000 000	11 578,2	96,49	4,87	11 578,2
МКМ012_0097 (KZK1KY010976, 100 тенге, 23.01.09 – 23.01.10, actual/actual)												
Аукцион	23.01.09	цена облигаций	41 338 680	3 787,1	41,3	91,6107	9,16	2 483 333	231,0	93,02	7,50	231,0
МКМ012_0098 (KZK1KY010984, 100 тенге, 11.02.09 – 11.02.10, actual/actual)												
Аукцион	11.02.09	цена облигаций	79 520 000	7 393,6	159,0	92,9782	7,55	76 720 000	7 136,7	93,02	7,50	7 136,8
МКМ012_0099 (KZK1KY010992, 100 тенге, 16.09.09 – 16.09.10, actual/actual)												
Аукцион	16.09.09	цена облигаций	181 497 000	17 279,6	121,0	95,2058	5,04	150 000 000	14 340,8	95,61	4,60	14 340,8
МКМ012_0100 (KZK1KY011008, 100 тенге, 28.10.09 – 28.10.10, actual/actual)												
Аукцион	28.10.09	цена облигаций	510 649 900	48 445,2	425,5	94,8697	5,41	250 145 000	23 816,8	95,21	5,03	25 014,5
МКМ012_0101 (KZK1KY011016, 100 тенге, 24.11.09 – 24.11.10, actual/actual)												
Аукцион	24.11.09	цена облигаций	862 105 800	82 009,2	718,4	95,1266	5,12	120 000 000	11 517,0	95,97	4,19	11 517,0
МКМ012_0102 (KZK1KY011024, 100 тенге, 23.12.09 – 23.12.10, actual/actual)												
Аукцион	23.12.09	цена облигаций	452 590 000	43 493,6	348,1	96,0995	4,06	208 000 000	20 143,0	96,84	3,26	20 143,0
МОМ024_0076 (KZK2KY020768, 1 000 тенге, 04.03.09 – 04.03.11, полугодовой купон 8,00 % годовых, 30/360)												
Аукцион	04.03.09	ставка купона	22 690 000	22 690,0	453,8	8,0963	8,10	15 000 000	15 000,0	100,00	8,00	15 000,0
МОМ024_0077 (KZK2KY020776, 1 000 тенге, 01.07.09 – 01.07.11, полугодовой купон 6,80 % годовых, 30/360)												
Аукцион	01.07.09	ставка купона	64 839 000	64 839,0	648,4	7,0494	7,05	12 000 000	12 000,0	100,00	6,80	12 000,0
МОМ024_0078 (KZK2KY020784, 1 000 тенге, 12.11.09 – 12.11.11, полугодовой купон 5,20 % годовых, 30/360)												
Аукцион	12.11.09	ставка купона	64 955 000	64 955,0	541,3	5,7814	5,78	15 725 000	15 725,0	100,00	5,20	15 725,0



Таблица 37 (продолжение)

Способ размещения	Дата размещения	Предмет торга	Объем активных заявок, шт.	Объем активных заявок, млн тенге	Спрос к предложению, %	Средневзв. цена спроса	Доходность спроса, % годовых	Объем привлечения, шт.	Объем привлечения, млн тенге	Средневзв. цена, % от номинала	Доходность на торгах, % годовых	Объем выпуска (накопленный), млн тенге
МОМ036_0069 (КЗК2КЮ030692, 1 000 тенге, 08.01.09 – 08.01.12, полугодовой купон 8,40 % годовых, 30/360)												
Аукцион	08.01.09	ставка купона	1 481 600	1 481,6	14,8	8,4089	8,41	1 466 600	1 466,6	100,00	8,40	1 466,6
МОМ036_0071 (КЗК2КЮ030718, 1 000 тенге, 18.03.09 – 18.03.12, полугодовой купон 8,40 % годовых, 30/360)												
Аукцион	18.03.09	ставка купона	18 650 000	18 650,0	373	8,4052	8,41	15 000 000	15 000,0	100,00	8,40	15 000,0
МОМ036_0072 (КЗК2КЮ030726, 1 000 тенге, 08.04.09 – 08.04.12, полугодовой купон 8,09 % годовых, 30/360)												
Аукцион	08.04.09	ставка купона	18 507 000	18 507,0	370,1	8,0000	8,00	13 447 000	13 447,0	100,00	8,09	13 447,0
МОМ036_0073 (КЗК2КЮ030734, 1 000 тенге, 13.05.09 – 13.05.12, полугодовой купон 7,50 % годовых, 30/360)												
Аукцион	13.05.09	ставка купона	13 744 918	13 744,9	274,9	7,6727	7,67	10 484 918	10 484,9	100,00	7,50	10 484,9
МОМ036_0074 (КЗК2КЮ030742, 1 000 тенге, 10.06.09 – 10.06.12, полугодовой купон 7,30 % годовых, 30/360)												
Аукцион	10.06.09	ставка купона	31 212 000	31 212,0	312,1	7,5332	7,53	13 466 666	13 466,7	100,00	7,30	13 466,7
МОМ036_0075 (КЗК2КЮ030759, 1 000 тенге, 15.07.09 – 15.07.12, полугодовой купон 6,00 % годовых, 30/360)												
Аукцион	15.07.09	ставка купона	51 928 600	51 928,6	519,3	6,1774	6,18	12 000 000	12 000,0	100,00	6,00	12 000,0
МОМ036_0076 (КЗК2КЮ030767, 1 000 тенге, 05.08.09 – 05.08.12, полугодовой купон 5,49 % годовых, 30/360)												
Аукцион	05.08.09	ставка купона	44 165 780	44 165,8	368,0	5,6404	5,64	13 866 666	13 866,7	100,00	5,49	13 866,7
МОМ036_0077 (КЗК2КЮ030775, 1 000 тенге, 02.09.09 – 02.09.12, полугодовой купон 5,50 % годовых, 30/360)												
Аукцион	02.09.09	ставка купона	19 568 000	19 568,0	130,5	7,0619	7,06	14 768 000	14 768,0	100,00	5,50	14 768,0
МОМ036_0078 (КЗК2КЮ030783, 1 000 тенге, 02.12.09 – 02.12.12, полугодовой купон 5,10 % годовых, 30/360)												
Аукцион	02.12.09	ставка купона	65 800 000	65 800,0	548,3	5,5548	5,55	15 000 000	15 000,0	100,00	5,10	15 000,0
МОМ048_0038 (КЗК2КЮ040386, 1 000 тенге, 29.04.09 – 29.04.13, полугодовой купон 7,80 % годовых, 30/360)												
Аукцион	29.04.09	ставка купона	21 568 000	21 568,0	431,4	8,0408	8,04	5 000 000	5 000,0	100,00	7,80	5 000,0
МОМ048_0039 (КЗК2КЮ030734, 1 000 тенге, 27.05.09 – 27.05.13, полугодовой купон 7,50 % годовых, 30/360)												
Аукцион	27.05.09	ставка купона	21 718 000	21 718,0	434,4	7,9890	7,99	7 826 666	7 826,7	100,00	7,50	7 826,7
МОМ048_0040 (КЗК2КЮ040402, 1 000 тенге, 14.10.09 – 14.10.13, полугодовой купон 6,00 % годовых, 30/360)												
Аукцион	14.10.09	ставка купона	30 893 000	30 893,0	257,4	6,2348	6,23	16 909 000	16 909,0	100,00	6,00	16 909,0
МОМ048_0041 (КЗК2КЮ040410, 1 000 тенге, 15.12.09 – 15.12.13, полугодовой купон 5,20 % годовых, 30/360)												
Аукцион	15.12.09	ставка купона	29 960 000	29 960,0	249,7	5,9290	5,93	10 260 000	10 260,0	100,00	5,20	10 260,0
МОМ060_0029 (КЗК2КЮ050294, 1 000 тенге, 28.01.09 – 28.01.14, полугодовой купон 8,70 % годовых, 30/360)												
Аукцион	28.01.09	ставка купона	8 620 000	8 620,0	86,2	8,7291	8,73	6 100 000	6 100,0	100,00	8,70	6 100,0
МОМ060_0030 (КЗК2КЮ050302, 1 000 тенге, 18.02.09 – 18.02.14, полугодовой купон 8,70 % годовых, 30/360)												
Аукцион	18.02.09	ставка купона	5 250 000	5 250,0	105,0	8,7749	8,77	4 200 000	4 200,0	100,00	8,70	4 200,0



Таблица 37 (продолжение)

Способ размещения	Дата размещения	Предмет торга	Объем активных заявок, шт.	Объем активных заявок, млн тенге	Спрос к предложению, %	Средневзв. цена спроса	Доходность спроса, % годовых	Объем привлечения, шт.	Объем привлечения, млн тенге	Средневзв. цена, % от номинала	Доходность на торгах, % годовых	Объем выпуска (накопленный), млн тенге
MOM060_0031 (KZK2KY050310, 1 000 тенге, 19.08.09 – 19.08.14, полугодовой купон 4,90 % годовых, 30/360)												
Аукцион	19.08.09	ставка купона	18 122 529	18 122,5	151,0	5,3309	5,33	12 223 333	12 223,3	100,00	4,90	12 223,3
MUM072_0004 (KZKDKY060041, 1 000 тенге, 01.04.09 – 01.04.15, годовой купон 8,20 % годовых, 30/360)												
Аукцион	01.04.09	ставка купона	14 704 000	14 704,0	294,1	8,4322	8,43	3 720 000	3 720,0	100,00	8,20	3 720,0
MUM084_0003 (KZKDKY070032, 1 000 тенге, 25.02.09 – 25.02.16, годовой купон 8,75 % годовых, 30/360)												
Аукцион	25.02.09	ставка купона	13 100 000	13 100,0	262,0	9,2191	9,22	3 600 000	3 600,0	100,00	8,75	3 600,0
MUM084_0004 (KZKDKY070040, 1 000 тенге, 11.03.09 – 11.03.16, годовой купон 8,75 % годовых, 30/360)												
Аукцион	11.03.09	ставка купона	18 170 000	18 170,0	363,4	8,7447	8,74	15 000 000	15 000,0	100,00	8,75	15 000,0
MUM084_0005 (KZKDKY070057, 1 000 тенге, 03.06.09 – 03.06.16, годовой купон 7,90 % годовых, 30/360)												
Аукцион	03.06.09	ставка купона	16 806 000	16 806,0	168,1	7,9212	7,92	9 260 000	9 260,0	100,00	7,90	9 260,0
MUM084_0006 (KZKDKY070065, 1 000 тенге, 09.09.09 – 09.09.16, годовой купон 6,00 % годовых, 30/360)												
Аукцион	09.09.09	ставка купона	5 480 100	5 480,1	36,5	6,5884	6,59	2 620 100	2 620,1	100,00	6,00	2 620,1
MUM084_0007 (KZKDKY070073, 1 000 тенге, 07.10.09 – 07.10.16, годовой купон 6,00 % годовых, 30/360)												
Аукцион	07.10.09	ставка купона	25 756 000	25 756,0	214,6	7,5442	7,54	1 666 666	1 666,7	100,00	6,00	1 666,7
MUM096_0002 (KZKDKY080023, 1 000 тенге, 25.03.09 – 25.03.17, годовой купон 8,20 % годовых, 30/360)												
Аукцион	25.03.09	ставка купона	9 460 000	9 460,0	189,2	8,7346	8,73	840 000	840,0	100,00	8,20	840,0
MUM096_0003 (KZKDKY080031, 1 000 тенге, 22.04.09 – 22.04.17, годовой купон 8,10 % годовых, 30/360)												
Аукцион	22.04.09	ставка купона	21 765 000	21 765,0	435,3	8,2069	8,21	11 166 666	11 166,7	100,00	8,10	11 166,7
MUM096_0004 (KZKDKY080049, 1 000 тенге, 08.07.09 – 08.07.17, годовой купон 7,10 % годовых, 30/360)												
Аукцион	08.07.09	ставка купона	28 850 000	28 850,0	288,5	7,2857	7,29	11 000 000	11 000,0	100,00	7,10	11 000,0
MUM096_0005 (KZKDKY080056, 1 000 тенге, 12.08.09 – 12.08.12, годовой купон 5,20 % годовых, 30/360)												
Аукцион	12.08.09	ставка купона	75 914 000	75 914,0	632,6	5,5694	5,57	18 000 000	18 000,0	100,00	5,20	18 000,0
MUM096_0006 (KZKDKY080064, 1 000 тенге, 10.11.09 – 10.11.17, годовой купон 6,50 % годовых, 30/360)												
Аукцион	10.11.09	ставка купона	11 085 700	11 085,7	92,4	7,6003	7,60	413 333	413,3	100,00	6,50	413,3
MUM108_0001 (KZKDKY090014, 1 000 тенге, 22.07.09 – 22.07.18, годовой купон 6,20 % годовых, 30/360)												
Аукцион	22.07.09	ставка купона	21 453 000	21 453,0	214,5	6,5293	6,53	14 600 000	14 600,0	100,00	6,20	14 600,0
MUM108_0002 (KZKDKY090022, 1 000 тенге, 23.09.09 – 23.09.18, годовой купон 6,50 % годовых, 30/360)												
Аукцион	23.09.09	ставка купона	8 516 000	8 516,0	56,8	7,0496	7,05	4 060 000	4 060,0	100,00	6,50	4 060,0
MUM108_0003 (KZKDKY090030, 1 000 тенге, 18.11.09 – 18.11.18, годовой купон 6,50 % годовых, 30/360)												
Аукцион	18.11.09	ставка купона	50 200 000	50 200,0	418,3	7,7774	7,78	15 333 333	15 333,3	100,00	6,50	15 333,3



Таблица 37 (продолжение)

Способ размещения	Дата размещения	Предмет торга	Объем активных заявок, шт.	Объем активных заявок, млн тенге	Спрос к предложению, %	Средневзв. цена спроса	Доходность спроса, % годовых	Объем привлечения, шт.	Объем привлечения, млн тенге	Средневзв. цена, % от номинала	Доходность на торгах, % годовых	Объем выпуска (накопленный), млн тенге
MUM120_0002 (KZKDKY100029, 1 000 тенге, 15.04.09 – 15.04.19, годовой купон 8,20 % годовых, 30/360)												
Аукцион	15.04.09	ставка купона	11 545 000	11 545,0	230,9	8,2344	8,23	7 745 000	7 745,0	100,00	8,20	7 745,0
MUM120_0003 (KZKDKY100037, 1 000 тенге, 06.05.09 – 06.05.19, годовой купон 8,10 % годовых, 30/360)												
Аукцион	06.05.09	ставка купона	19 510 000	19 510,0	390,2	8,1245	8,12	16 060 000	16 060,0	100,00	8,10	16 060,0
MUM120_0004 (KZKDKY100045, 1 000 тенге, 17.06.09 – 17.06.19, годовой купон 7,80 % годовых, 30/360)												
Аукцион	17.06.09	ставка купона	27 534 000	27 534,0	275,3	7,8952	7,90	15 000 000	15 000,0	100,00	7,80	15 000,0
MUM120_0005 (KZKDKY100052, 1 000 тенге, 26.08.09 – 26.08.19, годовой купон 6,00 % годовых, 30/360)												
Аукцион	26.08.09	ставка купона	19 195 000	19 195,0	160,0	9,5191	9,52	10 866 666	10 866,7	100,00	6,00	10 866,7
MUM132_0001 (KZKDKY110010, 1 000 тенге, 21.10.09 – 21.10.20, годовой купон 7,00 % годовых, 30/360)												
Аукцион	21.10.09	ставка купона	8 820 000	8 820,0	73,5	7,6089	7,61	4 250 000	4 250,0	100,00	7,00	4 250,0
MUM156_0001 (KZKDKY130018, 1 000 тенге, 11.12.09 – 11.12.22, годовой купон 6,80 % годовых, 30/360)												
Аукцион	11.12.09	ставка купона	11 410 000	11 410,0	87,8	6,7276	6,73	7 070 000	7 070,0	100,00	6,80	7 070,0
MUM180_0001 (KZKDKY150016, 1 000 тенге, 20.05.09 – 20.05.24, годовой купон 8,05 % годовых, 30/360)												
Аукцион	20.05.09	ставка купона	15 100 000	15 100,0	302,0	8,1660	8,17	6 950 000	6 950,0	100,00	8,05	6 950,0
MUM180_0002 (KZKDKY150024, 1 000 тенге, 24.06.09 – 24.06.24, годовой купон 7,65 % годовых, 30/360)												
Аукцион	24.06.09	ставка купона	21 550 000	21 550,0	215,5	7,8203	7,82	10 333 333	10 333,3	100,00	7,65	10 333,3
MUJ120_0006 (KZKAKY100063, 1 000 тенге, 29.01.09 – 29.01.19, годовой фиксированный купон 0,01 % годовых + инфляция, 30/360)												
Аукцион	29.01.09	ставка купона	6 100 000	6 100,0	50,8	3,9300	13,41	1 000 000	1 000,0	100,00	*9,49	1 000,0
MUJ156_0001 (KZKAKY130011, 1 000 тенге, 29.04.09 – 29.04.22, годовой фиксированный купон 0,01 % годовых + инфляция, 30/360)												
Аукцион	29.04.09	ставка купона	25 211 000	25 211,0	252,1	0,0504	8,88	10 000 000	10 000,0	100,00	*8,84	10 000,0
MUJ168_0002 (KZKAKY140028, 1 000 тенге, 29.09.09 – 29.09.23, годовой фиксированный купон 0,01 % годовых + инфляция, 30/360)												
Аукцион	29.09.09	ставка купона	52 420 000	52 420,0	349,5	0,0100	6,28	5 666 666	5 666,7	100,00	*6,28	5 666,7
MUJ180_0006 (KZKAKY150068, 1 000 тенге, 26.02.09 – 26.02.24, годовой фиксированный купон 0,01 % годовых + инфляция, 30/360)												
Аукцион	26.02.09	ставка купона	19 677 000	19 677,0	196,8	0,2621	8,88	15 677 000	15 677,0	100,00	*8,63	15 677,0
MUJ192_0001 (KZKAKY160018, 1 000 тенге, 30.03.09 – 30.03.25, годовой фиксированный купон 0,01 % годовых + инфляция, 30/360)												
Аукцион	30.03.09	ставка купона	19 130 000	19 130,0	191,3	0,1007	8,72	15 000 000	15 000,0	100,00	*8,63	15 000,0
MUJ192_0002 (KZKAKY160026, 1 000 тенге, 29.10.09 – 29.10.25, годовой фиксированный купон 0,01 % годовых + инфляция, 30/360)												
Аукцион	29.10.09	ставка купона	40 200 000	40 200,0	335,0	0,0100	6,07	17 000 000	17 000,0	100,00	*6,07	17 000,0
MUJ204_0001 (KZKAKY170017, 1 000 тенге, 28.05.09 – 28.05.26, годовой фиксированный купон 0,01 % годовых + инфляция, 30/360)												
Аукцион	28.05.09	ставка купона	31 245 000	31 245,0	312,5	0,0203	8,75	12 000 000	12 000,0	100,00	*8,74	12 000,0

↓

Таблица 37 (продолжение)

Способ размещения	Дата размещения	Предмет торга	Объем активных заявок, шт.	Объем активных заявок, млн тенге	Спрос к предложению, %	Средневзв. цена спроса	Доходность спроса, % годовых	Объем привлечения, шт.	Объем привлечения, млн тенге	Средневзв. цена, % от номинала	Доходность на торгах, % годовых	Объем выпуска (накопленный), млн тенге
МУJ204_0002 (KZKAKY170025, 1 000 тенге, 30.07.09 – 30.07.26, годовой фиксированный купон 0,01 % годовых + инфляция, 30/360)												
Аукцион	30.07.09	ставка купона	53 700 000	53 700,0	537,0	0,0100	7,56	15 000 000	15 000,0	100,00	*7,56	15 000,0
МУJ216_0001 (KZKAKY180016, 1 000 тенге, 29.06.09 – 29.06.27, годовой фиксированный купон 0,01 % годовых + инфляция, 30/360)												
Аукцион	29.06.09	ставка купона	28 050 000	28 050,0	280,5	0,0100	8,41	12 000 000	12 000,0	100,00	*8,41	12 000,0
МУJ216_0002 (KZKAKY180024, 1 000 тенге, 26.11.09 – 26.11.27, годовой фиксированный купон 0,01 % годовых + инфляция, 30/360)												
Аукцион	26.11.09	ставка купона	38 010 000	38 010,0	316,8	0,0100	5,86	12 000 000	12 000,0	100,00	*5,86	12 000,0
МУJ228_0001 (KZKAKY190015, 1 000 тенге, 27.08.09 – 27.08.28, годовой фиксированный купон 0,01 % годовых + инфляция, 30/360)												
Аукцион	27.08.09	ставка купона	71 230 000	71 230,0	593,6	0,0100	6,92	19 000 000	19 000,0	100,00	*6,92	19 000,0
МУJ228_0002 (KZKAKY190023, 1 000 тенге, 30.12.09 – 30.12.28, годовой фиксированный купон 0,01 % годовых + инфляция, 30/360)												
Аукцион	30.12.09	ставка купона	44 000 000	44 000,0	338,5	0,0100	5,96	13 100 000	13 100,0	100,00	*5,96	13 100,0

См. раздел „Пояснения к книге фактического материала“

Таблица 38

Оборот биржевого первичного рынка ГЦБ в 2009 и 2008 годах в разрезе основных категорий инвесторов

Категория инвесторов	2009 год		2008 год		Тренд, %
	млрд KZT	доля, %	млрд KZT	доля, %	
БВУ	153,4	22,0	265,4	57,1	-42,2
ООИУПА за счет ПА	308,3	44,2	98,0	21,1	+214,6
Клиенты БВУ	181,1	25,9	56,7	12,2	+219,5
Клиенты брокеров-дилеров	40,9	5,9	32,8	7,1	+24,5
в том числе физические лица	4,5	0,6	1,1	0,2	+310,9
Брокеры-дилеры	14,5	2,1	12,3	2,6	+17,9
Итого	698,1	100,0	465,2	100,0	+50,1
в том числе нерезиденты	-	-	0,2	<0,1	X

Рисунок 13

Средневзвешенная доходность и объем сделок на первичном рынке ГЦБ в 2009 году

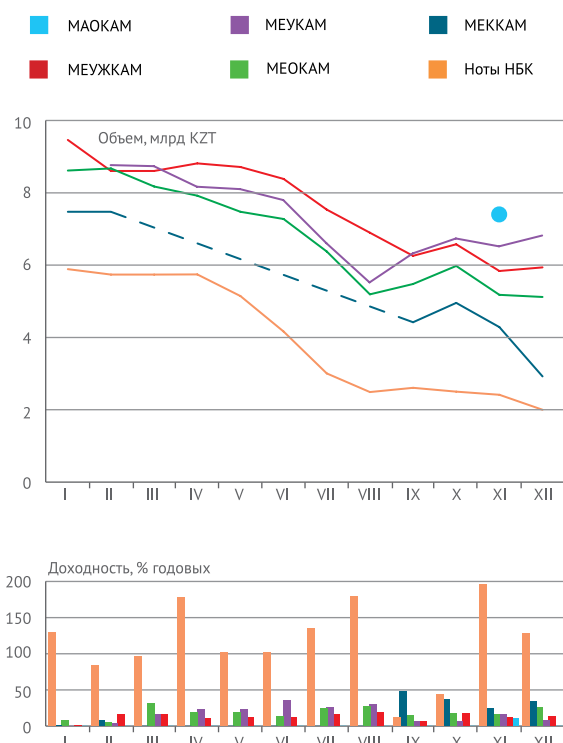


Рисунок 14

Средневзвешенная доходность и объем сделок на вторичном биржевом рынке ГЦБ в 2009 году

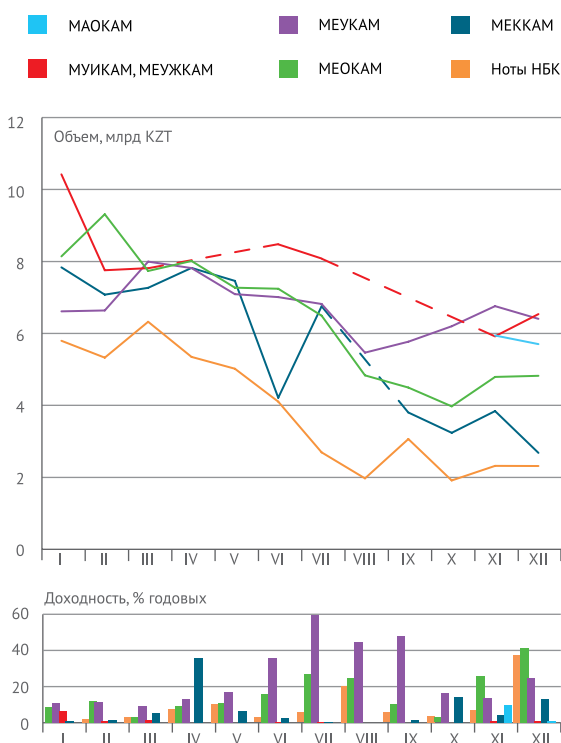


Таблица 39

Структура объема сделок вторичного биржевого рынка казахстанских ГЦБ в 2009 году

Месяц	Объем торгов, млн KZT							Итого
	MEKKAM	MEOKAM	MEUЖKAM	MEUKAM	МУИКАМ	ноты НБК	MAOKAM	
Январь	603,0	8 579,3	3 233,8	10 783,2	2 964,0	6 703,0	X	32 866,3
Февраль	1 523,0	12 114,2	-	11 522,7	1 111,0	1 796,4	X	28 067,1
Март	5 126,4	3 153,1	-	8 886,9	1 230,3	3 162,8	X	21 559,5
Апрель	35 660,5	9 090,6	-	13 028,7	-	7 715,7	X	65 495,4
Май	6 602,0	10 935,1	-	16 837,9	-	10 348,4	X	44 723,4
Июнь	2 340,3	15 551,5	-	35 616,9	396,4	2 734,2	X	56 639,4
Июль	480,5	26 475,2	-	59 312,1	281,7	5 442,0	X	91 991,6
Август	-	24 738,3	-	44 477,5	-	19 936,2	X	89 152,0
Сентябрь	1 342,6	10 447,1	-	48 021,7	-	5 615,4	X	65 426,7
Октябрь	13 961,5	2 836,0	-	16 551,1	-	3 377,5	X	36 726,1
Ноябрь	4 159,5	25 483,9	677,9	13 336,6	-	6 853,2	9 670,4	60 181,5
Декабрь	12 714,9	40 962,1	441,8	24 324,0	569,9	37 349,2	806,1	117 168,0
Всего	84 514,1	190 366,3	4 353,5	302 699,2	6 553,3	111 034,0	10 476,5	709 997,1
Структура	11,9%	26,8%	0,6%	42,6%	0,9%	15,6%	1,5%	100,0%
Справочно 2008 год:								
Всего	108 872,8	120 719,4	6 026	42 683,2	40 731	154 204,0	X	473 237,1
Структура	23,0%	25,5%	1,3%	9,0%	8,6%	32,6%		100,0%
Тренд 2009 к 2008:								
в деньгах	-24 358,6	+69 647,0	-1 672,9	+260 016,0	-34 178,0	-43 169,9	X	+236 759,9
в процентах	-22,4	+57,7	-27,8	+609,2	-83,9	-28,0	X	+50,0

См. раздел „Пояснения к книге фактического материала“

Таблица 40

Брутто-оборот биржевого вторичного рынка ГЦБ в 2009 и 2008 годах в разрезе основных категорий инвесторов (без учета Национального банка Республики Казахстан)

Категория инвесторов	2009 год		2008 год		Тренд, %
	млрд KZT	доля, %	млрд KZT	доля, %	
БВУ	430,5	31,4	482,3	58,8	-10,7
Брокеры-дилеры	812,7	59,2	213,6	26,0	+280,4
в том числе физические лица	476,0	34,7	105,8	12,9	+349,9
Субъекты пенсионного рынка	129,3	9,4	124,4	15,2	+3,9
Итого	1 372,4	100,0	820,3	100,0	+67,3
в том числе нерезиденты	34,9	2,5	9,9	1,2	+253,3

Таблица 41

Рэнкинг десяти наиболее активных операторов биржевого вторичного рынка ГЦБ в 2009 году

Позиция в 2009 году	Позиция в 2008 году	Краткое наименование компании	Показатель активности Ка
1	1	АО „Тенгри Финанс“	3,00
2	2	АО „Народный сберегательный банк Казахстана“	1,06
3	7	АО „ИФГ КОНТИНЕНТ“	0,74
4	3	АО „Банк ЦентрКредит“	0,63
5	31	АО „Евразийский Капитал“	0,60
6	5	АО „Дочерняя организация АО „БТА Банк“ „БТА Секьюритис“	0,522
7	19	АО „АСЫЛ-ИНВЕСТ“	0,519
8	-	АО „Zurich Invest Management“	0,50
9	20	АО „Казпочта“	0,31
10	6	АО „Евразийский банк“	0,30

См. раздел „Пояснения к книге фактического материала“

Рынок облигаций МФО

Таблица 42

Основные параметры облигаций МФО, допущенных к обращению на KASE в 2009 году

Тип бумаги	индексированная облигация
Эмитент	Евразийский банк развития
ISIN	XS0426508627
Торговый код	EABRK280414
Валюта выпуска	KZT
Объем эмиссии	20 000 млрд
Начало обращения	28.04.09
Срок обращения	5 лет
Дата погашения	28.04.2014
Ставка интереса	15,000% годовых на первый год обращения, далее плавающий, зависящий от уровня инфляции в Казахстане
Выплата купона	28.04 и 28.10 ежегодно
Временная база	actual/360
Маркет-мейкер	АО „HOMEBROKER“

Рынок операций репо

Таблица 43

Объем торгов на биржевом рынке репо в 2009 году (по месяцам, кварталам и секторам)

Месяц	Объем сделок открытия, млрд KZT (если не указано иное)							
	„прямое“ репо			автоматическое репо			Всего	
	с НЦБ	с ГЦБ	итого	с НЦБ	с ГЦБ	итого	млн USD	млрд KZT
Январь	88,6	5,1	93,6	143,1	1 056,3	1 199,4	10 659,2	1 293,0
Февраль	132,0	4,8	136,9	119,1	988,2	1 107,3	8 535,7	1 244,2
Март	40,5	2,0	42,5	78,0	738,6	816,6	5 699,1	859,1
I квартал	261,1	11,9	273,0	340,2	2 783,1	3 123,3	24 893,9	3 396,3
Апрель	120,8	14,4	135,2	87,3	727,2	814,5	6 303,2	949,7
Май	148,8	9,4	158,2	65,4	559,0	624,4	5 205,7	782,5
Июнь	56,4	15,2	71,5	23,3	706,1	729,4	5 327,6	800,9
II квартал	325,9	39,0	364,9	176,0	1 992,3	2 168,3	16 836,6	2 533,2
Июль	58,0	22,4	80,5	19,7	848,8	868,6	6 299,6	949,0
Август	45,8	10,8	56,6	18,4	605,8	624,2	4 515,4	680,8
Сентябрь	30,4	12,6	43,0	21,0	713,2	734,2	5 150,7	777,1
III квартал	134,2	45,8	180,1	59,1	2 167,9	2 226,9	15 965,6	2 407,0
Октябрь	27,7	5,5	33,3	18,6	643,4	662,0	4 611,3	695,3
Ноябрь	2,0	14,0	16,0	9,0	571,5	580,5	3 986,6	596,5
Декабрь	2,0	4,7	6,7	13,8	761,2	774,9	5 258,1	781,6
IV квартал	31,7	24,2	55,9	41,3	1 976,1	2 017,4	13 855,9	2 073,3
Всего 2009 год	753,0	120,9	873,9	616,6	8 919,4	9 535,9	71 552,1	10 409,8
при биржевом обороте	1 535,5	237,5	1 773,0	1 303,6	17 890,8	19 194,3	144 053,7	20 967,3
Структура	7,2 %	1,2 %	8,4 %	5,9 %	85,7 %	91,6 %		100,0 %
Справочно 2008 год:								
Всего 2008 год	849,6	173,7	1 023,3	1 719,0	10 382,7	12 101,7	109 155,4	13 125,0
при биржевом обороте	1 669,4	333,4	2 002,8	3 421,7	20 680,9	24 102,6	217 107,8	26 105,4
Структура	6,5 %	1,3 %	7,8 %	13,1 %	79,1 %	92,2 %		100,0 %
Тренд 2009 к 2008:								
в деньгах	-96,6	-52,8	-149,4	-1 102,4	-1 463,4	-2 565,8	-37 603,3	-2 715,2
в процентах	-11,4	-30,4	-14,6	-64,1	-14,1	-21,2	-34,4	-20,7

Таблица 44

Сравнительные статистические данные по биржевому рынку автоматического репо в 2009 и 2008 годах

Показатель рынка	Единица измерения	2009 год			2008 год			2009 год к 2008 году
		ГЦБ	НЦБ	итого	ГЦБ	НЦБ	итого	
Число торговых дней		249	249	249	249	249	249	0 %
Число результативных дней		249	249	249	249	249	249	0 %
Показатель результативности торгов	%	100	100	100	100	100	100	0 пп
Общий объем торгов	млрд KZT	8 919,4	616,6	9 535,9	10 382,7	1 719,0	12 101,7	-21,2 %
	млн USD	61 226,5	4 350,3	65 576,7	86 356,9	14 290,1	100 647,0	-34,8 %
при биржевом обороте	млрд KZT	17 890,8	1 303,6	19 194,3	20 680,9	3 421,7	24 102,6	-20,4 %
	млн USD	122 750,5	9 170,7	131 921,3	172 011,0	28 445,4	200 456,4	-34,2 %
Количество сделок открытия	штук	25 598	3 674	29 272	23 434	6 925	30 359	-3,6 %
Количество сделок всего	штук	51 277	7 452	58 729	46 788	13 872	60 660	-3,2 %
Доля сектора в объеме торгов на рынке репо	%	85,7	5,9	91,6	79,1	13,1	92,2	-0,6 пп

→

Таблица 44 (продолжение)

Показатель рынка	Единица измерения	2009 год			2008 год			2009 год к 2008 году
		ГЦБ	НЦБ	итого	ГЦБ	НЦБ	итого	
Доля сектора по кол-ву сделок открытия на рынке репо	%	77,9	11,2	89,0	52,3	15,5	67,8	+21,2 пп
Средний объем одной сделки	млн KZT	348,9	174,9	326,8	442,0	246,7	397,3	-17,7 %
	млн USD	2,4	1,2	2,2	3,7	2,1	3,3	-32,0 %
Среднедневной объем результативного дня	млн KZT	35 820,8	2 476,2	38 296,9	41 697,7	6 903,4	48 601,2	-21,2 %
	млн USD	245,9	17,5	263,4	346,8	57,4	404,2	-34,8 %
при среднедневном биржевом обороте	млн KZT	71 850,6	5 235,2	77 085,7	83 055,8	13 741,7	96 797,5	-20,4 %
	млн USD	493,0	36,8	529,8	690,8	114,2	805,0	-34,2 %

Таблица 45

Сравнительные статистические данные по биржевому рынку „прямого“ репо в 2009 и 2008 годах

Показатель рынка	Единица измерения	2009 год			2008 год			2009 год к 2008 году
		ГЦБ	НЦБ	итого	ГЦБ	НЦБ	итого	
Число торговых дней		249	249	249	249	249	249	0 %
Число результативных дней		168	248	248	225	249	249	-0,4 %
Показатель результативности торгов	%	67,5	99,6	99,6	90,4	100,0	100,0	-0,4 пп
Общий объем торгов	млрд KZT	120,9	753,0	873,9	173,7	849,6	1 023,3	-14,6 %
	млн USD	813,1	5 162,3	5 975,4	1 444,3	7 064,0	8 508,4	-29,8 %
при биржевом обороте	млрд KZT	237,5	1 535,5	1 773,0	333,4	1 669,4	2 002,8	-11,5 %
	млн USD	1 604,7	10 527,7	12 132,4	2 772,1	13 879,3	16 651,4	-27,1 %
Количество сделок открытия	штук	575	3 030	3 605	1 685	12 735	14 420	-75,0 %
Количество сделок всего	штук	1 161	6 458	7 619	3 300	25 151	28 451	-73,2 %
Доля сектора в объеме торгов на рынке репо	%	1,2	7,2	8,4	1,3	6,5	7,8	+0,6 пп
Доля сектора по кол-ву сделок открытия на рынке репо	%	1,7	9,2	11,0	3,8	28,4	32,2	-21,2 пп
Средний объем одной сделки	млн KZT	204,6	237,8	232,7	101,0	66,4	70,4	+230,6 %
	млн USD	1,4	1,6	1,6	0,8	0,6	0,6	+172,1 %
Средний объем результативного дня	млн KZT	719,8	3 036,2	3 523,8	772,1	3 412,0	4 109,7	-14,3 %
	млн USD	4,8	20,8	24,1	6,4	28,4	34,2	-29,5 %
при среднедневном биржевом обороте	млн KZT	1 413,9	6 191,3	7 149,2	1 482,0	6 704,3	8 043,4	-11,1 %
	млн USD	9,6	42,5	48,9	12,3	55,7	66,9	-26,8 %

Таблица 46

Структура рынка автоматического репо с ГЦБ на KASE в 2009 году в разрезе инструментов

Торговый код инструмента	Средневзвешенная ставка, % год.	Объем открытия, млрд KZT	Число сделок	Доля рынка, %
REPO_KZT_000	2,21	7,7	44	0,1
REPO_KZT_001	2,15	5 753,8	18 736	64,5
REPO_KZT_002	1,50	305,1	558	3,4
REPO_KZT_003	1,50	283,2	760	3,2
REPO_KZT_007	5,60	2 244,0	4 363	25,2
REPO_KZT_014	3,99	163,8	497	1,8
REPO_KZT_028	5,52	161,8	640	1,8
Итого	X	8 919,4	25 598	100,0

Таблица 47

Структура рынка автоматического репо с НЦБ на KASE в 2009 году в разрезе инструментов

Торговый код предмета репо	Средневзвешенная ставка в % годовых по репо сроком на:						Объем открытия, млрд KZT	Доля рынка, %
	1 день	3 дня	7 дней	14 дней	28 дней	30 дней		
ASBN	7,4		8,0			8,0	6,4	1,0
ASBNb1	5,0						0,0	<0,1
ASBNb10					10,9		5,6	0,9
ASBNb9					11,0		5,2	0,8
ASFI	13,1	15,4	14,0	12,1		15,7	161,6	26,2
ASFIb15	13,1	12,1	11,4	15,6	14,6		6,8	1,1
ASFIb16	13,6	11,5	11,9	15,8		15,4	6,3	1,0
ASFIb22						10,2	1,5	0,2
ASFIb24	9,5	8,8	12,0	11,5			9,0	1,5
ASFIb5	12,0	11,0	10,0		11,0		2,9	0,5
ASFIp					13,0		0,1	<0,1
ATFBb4	4,5	5,0	8,3	13,2	12,0		2,9	0,5
ATFBb6	5,2	13,0	13,0	13,5	13,1		13,6	2,2
BRKZe2	6,0		11,9	11,0	15,0		10,6	1,7
BRKZe3				13,0			0,4	0,1
BRKZe4				12,9	12,4		1,6	0,3
BTAIb5	12,0	14,3			8,0		0,7	0,1
BTAIb6	12,0	14,3			13,0		0,7	0,1
BTAIb7			8,0				0,2	<0,1
BTAS	8,2	3,0	10,9			14,8	8,5	1,4
BTASb4					13,5		0,0	<0,1
BTASb5	12,8		20,0	11,0			2,0	0,3
BTASb7	7,0		7,6	12,0		13,8	5,6	0,9
BTASb9	10,7	12,9	15,5	13,9		12,1	18,5	3,0
BTTRb1	1,0			17,0			0,1	<0,1
CCBN	7,1		12,0	12,0		12,0	50,5	8,2
CCBNb10	13,0						1,1	0,2
CCBNb12	3,5	5,0	6,0				0,6	0,1
CCBNb13			8,8	12,6	12,3		0,9	0,2
CCBNb14			13,7		10,0		1,0	0,2
CCBNb15		12,8	11,1	13,3			7,7	1,2
CCBNb19					11,0		3,9	0,6
CCBNb3	13,0						0,4	0,1
CCBNb4	4,3	5,3	6,0	9,0			0,9	0,1
CCBNb9	5,0	5,6	7,0	13,0			0,4	0,1
CSBNb4	7,0		9,5	11,0	12,0		1,6	0,3
CSBNb5			9,5	13,5	12,0		1,1	0,2
CSBNb6			7,0	12,1	14,5		0,9	0,1
EUBNb3	6,6	6,6	9,0	8,5	13,2		4,8	0,8
EXBNb1	12,0		11,7	8,0			0,5	0,1
EXBNb2	12,2				15,0		0,2	<0,1
HSBK	5,4	6,0	8,9		12,3		0,1	<0,1
HSBKb10	5,5		14,0	13,3			0,6	0,1
HSBKb11					10,0		0,4	0,1
HSBKb3	5,5		15,0	13,3			1,2	0,2
HSBKb7	25,0		10,3				0,3	0,1
HSBKb9				10,0			0,7	0,1
HSBKp1	10,8	8,5	18,0	12,1			2,8	0,5

→

Таблица 47 (продолжение)

Торговый код предмета репо	Средневзвешенная ставка в % годовых по репо сроком на:						Объем открытия, млрд KZT	Доля рынка, %
	1 день	3 дня	7 дней	14 дней	28 дней	30 дней		
КАСТb1					11,5		0,9	0,1
KIBNb3			8,3	10,7			0,4	0,1
KKGB	5,7		6,3	10,8	12,8		1,1	0,2
KKGBb2	6,0	14,5	11,0	11,7	14,6		2,5	0,4
KZIKb10		10,0	11,2				5,1	0,8
KZIKb11			15,5		14,0		0,8	0,1
KZIKb12			15,0		14,0		0,8	0,1
KZIKb18	5,6						1,0	0,2
KZIKb3	0,1				14,0		0,2	<0,1
KZIKb5			13,2	11,0			0,5	0,1
KZIKb8	0,1			13,0			0,1	<0,1
KZTCb1			14,9	14,5	20,0		1,0	0,2
KZTK	9,3	6,0	9,0	9,3	12,6		0,4	0,1
KZTKp	5,2	10,2	11,1		13,3		0,1	<0,1
PRKRb2	25,0		13,7		11,2		5,7	0,9
RDGZ	9,0	11,2	10,8	11,4	12,6		22,0	3,6
RESCb1		15,0			14,0		0,3	0,1
RGBRb4	12,1		13,9	14,9	14,6		4,4	0,7
RGBRb5	11,7	10,3	12,5		13,3		4,5	0,7
RGBRb6	12,0			12,0			0,1	<0,1
TEBN						14,0	0,4	0,1
TEBNb16	11,9		13,0				0,2	<0,1
TEBNp	15,0	13,0	14,5				0,1	<0,1
TSBN	5,5		10,5	10,7		10,9	147,2	23,9
ASFIb23	8,6	13,2	15,8	16,0	16,7		10,1	1,6
ASNDb2	20,3		16,7	10,8		18,0	13,0	2,1
ATFBe2	8,4	4,5	14,9			13,4	6,4	1,0
ATFBe4	10,4	5,1		14,0			5,6	0,9
BTASe3					14,0		0,0	<0,1
CSBNb7	10,8		12,0				1,2	0,2
CTECb1	20,2	21,9	18,2	19,4	19,7		11,9	1,9
EUBNb5	19,4	11,9	15,5	15,8		16,6	4,6	0,8
GB_ENRC	5,0			10,0	12,6		0,1	<0,1
HSBkb13	5,0	5,5					0,1	<0,1
HSBKe1			3,0				0,0	<0,1
KKGBe4			14,2	14,0	11,0		0,2	<0,1
KKGBe6		15,0	15,0	15,0	14,7		1,0	0,2
KZIKb4	8,4						0,1	<0,1
LOGCb1	9,0						0,0	<0,1
SATC	10,0	14,8	15,0	1,3			3,9	0,6
TSBNb5			15,0			15,0	1,2	0,2
TXBNb2	4,1		6,6	8,0			4,1	0,7
Итого							616,6	100,0

Таблица 48

Структура оборота на рынке „прямого“ репо с ГЦБ на KASE в 2009 году

Срок операции репо в днях	Средневзвешенная ставка, % годовых	Объем открытия, млн KZT	Число сделок	Доля рынка, %	Срок операции репо в днях	Средневзвешенная ставка, % годовых	Объем открытия, млн KZT	Число сделок	Доля рынка, %
0	0	3 662,2	22	3,0	38	6,14	31,0	1	<0,1
1	2,98	18 833,7	109	15,6	39	0,00	1 343,0	2	1,1
2	6,43	8 932,3	38	7,4	40	0,00	2 011,8	3	1,7
3	2,10	8 957,3	54	7,4	41	0,00	1 042,3	2	0,9
4	3,30	4 190,3	31	3,5	42	6,14	1 489,6	10	1,2
5	2,57	2 946,4	12	2,4	43	12,84	85,0	2	0,1
6	3,12	4 950,2	22	4,1	44	7,51	1 000,8	4	0,8
7	4,24	4 726,6	27	3,9	48	0,29	172,9	2	0,1
8	2,48	879,5	6	0,7	49	6,50	190,0	1	0,2
9	6,08	687,0	3	0,6	50	1,85	631,4	3	0,5
10	0,50	540,2	3	0,4	51	0,00	200,0	1	0,2
11	4,09	1 394,9	5	1,2	54	7,02	223,5	1	0,2
12	8,02	450,7	3	0,4	55	0,49	350,0	3	0,3
13	4,48	1 227,7	9	1,0	56	10,80	1 186,0	7	1,0
14	4,35	5 348,3	27	4,4	66	0,00	1 809,8	4	1,5
15	2,01	2 123,8	6	1,8	69	0,48	448,9	2	0,4
16	0,26	869,8	8	0,7	78	0,00	85,0	1	0,1
17	1,47	983,8	4	0,8	79	0,00	767,0	3	0,6
19	0,50	76,5	1	0,1	80	0,50	242,6	1	0,2
20	2,26	2 849,1	9	2,4	84	13,00	399,7	1	0,3
21	0,24	1 965,0	8	1,6	85	0,49	691,3	3	0,6
22	3,98	1 589,4	8	1,3	87	0,33	1 516,3	5	1,3
23	4,71	1 451,4	6	1,2	88	0,49	1 545,5	6	1,3
24	0,33	2 144,7	9	1,8	89	0,48	553,8	2	0,5
26	0,50	1 563,3	3	1,3	90	0,32	1 189,3	6	1,0
28	1,50	2 017,5	8	1,7	91	0,50	1 795,2	4	1,5
29	3,53	4 951,1	17	4,1	94	0,00	702,3	2	0,6
30	5,25	733,2	6	0,6	95	0,00	536,6	2	0,4
31	0,01	4 914,3	14	4,1	127	0,20	1 030,8	6	0,9
32	8,03	100,0	1	0,1	Итого	X	120 928,2	575	100,0
33	0,00	764,8	2	0,6					
35	5,01	35,0	1	<0,1					
36	0,00	797,1	3	0,7					

Рисунок 15

Динамика структуры биржевого рынка автоматического репо в 2009 году (% от объема сделок открытия)

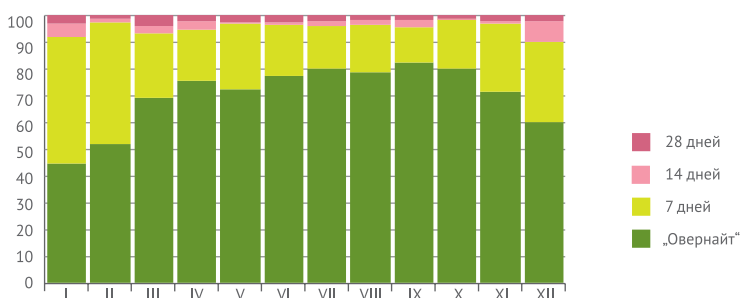


Рисунок 16

Динамика недельных средневзвешенных ставок на биржевом рынке автоматического репо по ликвидным инструментам в 2009 году (в % годовых, слева)

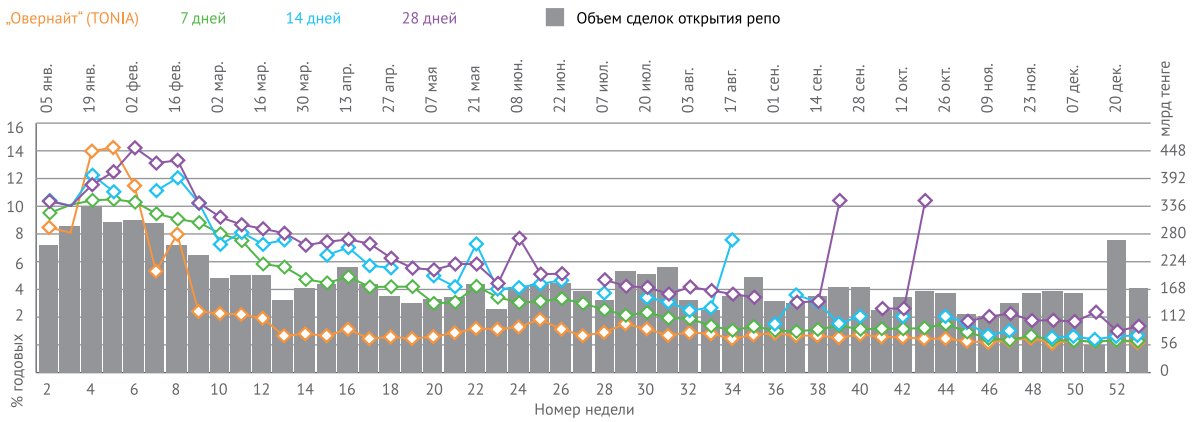


Рисунок 17

Динамика недельных средневзвешенных ставок репо „овернайт“ (слева) в различных секторах биржевого рынка и объем соответствующих операций репо по сделкам открытия репо (справа) в 2009 году

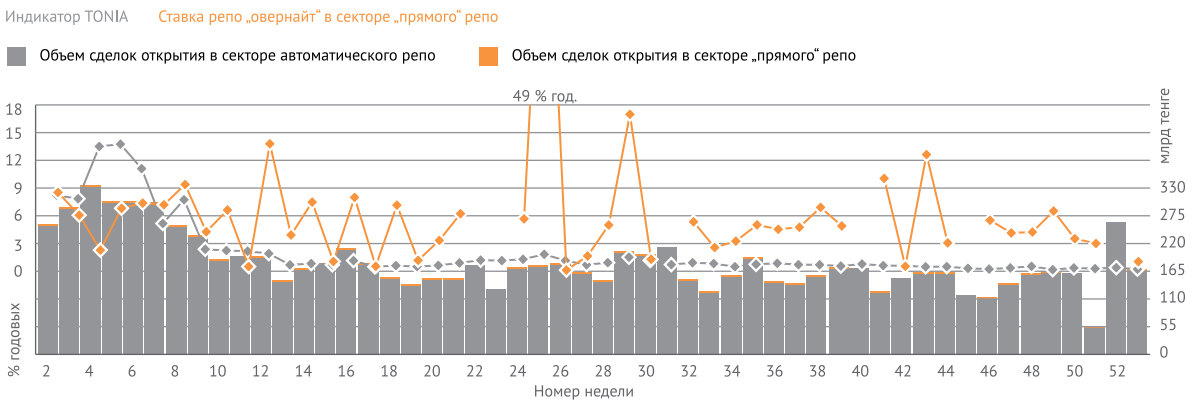


Рисунок 18

Предметы операций автоматического репо на KASE в 2009 году

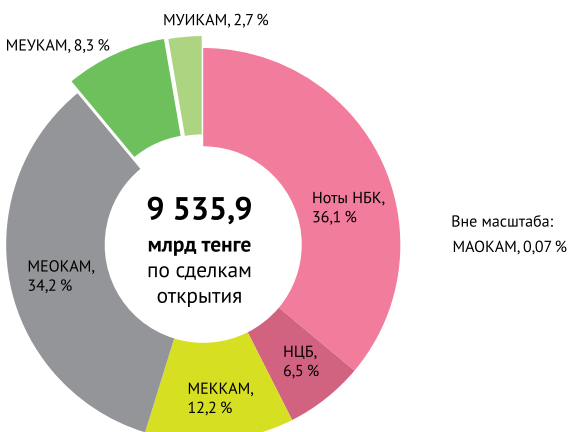


Рисунок 19

Предметы операций „прямого“ репо на KASE в 2009 году

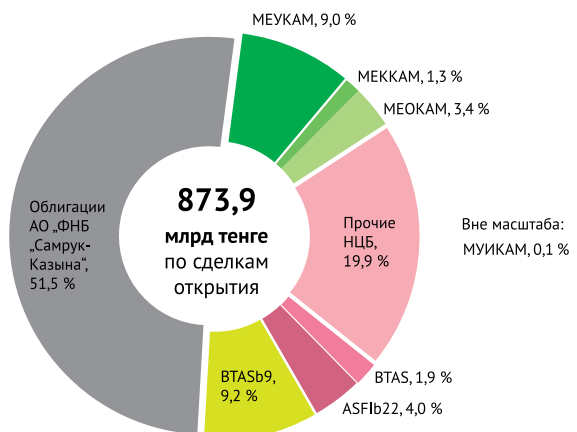


Таблица 49

Участники биржевого рынка репо в 2009 и 2008 годах

Категория участников	2009 год		2008 год		Тренд, %
	млрд KZT	доля, %	млрд KZT	доля, %	
БВУ	24 585,6	63,1	32 827,9	66,2	-25,1
Брокеры – дилеры	8 832,1	22,7	10 060,2	20,3	-12,2
Субъекты пенсионного рынка	5 504,0	14,1	6 659,6	13,4	-17,4
Управляющие компании	23,3	0,1	31,0	0,1	-24,7
Итого	38 945,0	100	49 578,7	100	X

См. раздел „Пояснения к книге фактического материала“

Таблица 50

Рэнкинг десяти наиболее активных операторов рынка репо на KASE в 2009 году

Позиция в 2009 году	Позиция в 2008 году	Краткое наименование компании	Показатель активности Ка
1	1	АО „Народный сберегательный банк Казахстана“	2,67
2	8	АО „Банк ЦентрКредит“	2,47
3	5	АО „Тенгри Финанс“	2,33
4	11	АО „Евразийский банк“	2,19
5	14	АО „Казпочта“	2,02
6	17	АО „АСЫЛ-ИНВЕСТ“	1,80
7	22	АО „Накопительный пенсионный фонд Народного Банка Казахстана, дочерняя организация АО „Народный Банк Казахстана“	1,70
8	34	АО „Delta Bank“	1,65
9	4	АО „Дочерняя организация акционерного общества „БТА Банк“ „БТА Секьюритис“	1,641
10	7	АО „Альянс Банк“	1,638

См. раздел „Пояснения к книге фактического материала“

Рынок иностранных валют

Рисунок 20

Секторная структура оборота казахстанского рынка иностранных валют и доля KASE в 2009 году

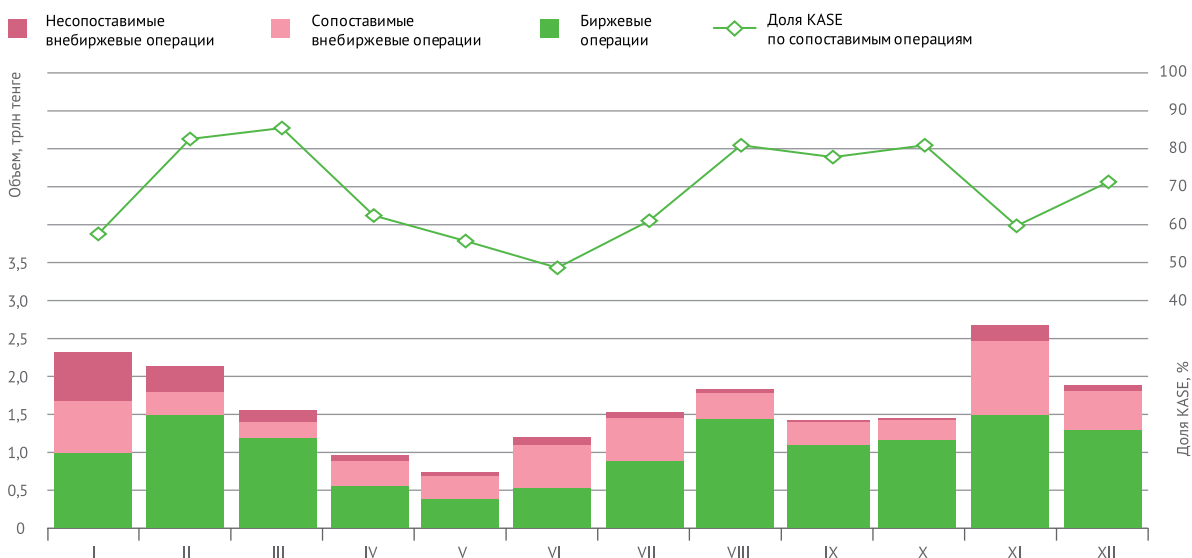


Таблица 51

Сравнительные статистические данные по рынку EUR/KZT на KASE в 2009 и 2008 годах

Показатель рынка	Единица измерения	2009 год	2008 год	2009 год к 2008 году
Число торговых дней		249	247	+0,8 %
Число результативных дней		226	29	+679,3 %
Показатель результативности торгов	%	90,8	11,7	+79,0 пп
Общий объем сделок	млн EUR	621,2	12,0	+5 098,7 %
Количество сделок	штук	350	33	+960,6 %
Доля от объема торгов всеми иностранными валютами	%	1,36	0,01	+1,35 пп
Доля от количества всех сделок с иностранными валютами	%	0,72	0,02	+0,69 пп
Средний объем одной сделки	млн EUR	1,775	0,362	390,2 %
Среднее количество сделок в день	штук	2	1	36,1 %
Среднедневной объем сделок	млн EUR	2,749	0,412	567,1 %

Таблица 52

Сравнительные статистические данные по рынку RUB/KZT на KASE в 2009 и 2008 годах

Показатель рынка	Единица измерения	2009 год	2008 год	2009 год к 2008 году
Число торговых дней		243	241	+0,8 %
Число результативных дней		99	150	-34,0 %
Показатель результативности торгов	%	40,7	62,2	-21,5 пп
Общий объем сделок	млн RUB	1 241,9	575,6	+115,8 %
Количество сделок	штук	371	217	+71,0 %
Доля от объема торгов всеми иностранными валютами	%	0,06	0,02	+0,04 пп
Доля от количества всех сделок с иностранными валютами	%	0,76	0,15	+0,61 пп
Средний объем одной сделки	млн RUB	3,347	2,653	+26,2 %
Среднее количество сделок в день	штук	4	1	+159,0 %
Среднедневной объем сделок	млн RUB	12,5	3,8	+226,9 %

Таблица 53

Сравнительные статистические данные по рынку USD/KZT на KASE в 2009 и 2008 годах

Показатель рынка	Единица измерения	2009 год	2008 год	2009 год к 2008 году
Число торговых дней		249	249	0 %
Число результативных дней		249	249	0 %
Показатель результативности торгов	%	100	100	0 пп
Общий объем сделок	млн USD	66 760,0	138 832,9	-51,9 %
при биржевом обороте	млн USD	84 312,5	138 837,9	-39,3 %
Количество сделок	штук	48 018	140 122	-65,7 %
Доля от объема торгов всеми иностранными валютами	%	98,53	99,97	-1,44 пп
Доля от количества всех сделок с иностранными валютами	%	98,50	99,82	-1,33 пп
Средний объем одной сделки	млн USD	1,390	0,991	+40,3 %
Среднее количество сделок в день	штук	193	563	-65,7 %
Среднедневной объем сделок	млн USD	268,1	557,6	-51,9 %

См. раздел „Пояснения к книге фактического материала“

Таблица 54

Объем и структура торгов иностранными валютами на KASE в 2009 году

Месяц	на спот-рынке,					Объем торгов		Биржевой (расчетный) оборот,	
	тыс. USD/ KZT	тыс. EUR/ KZT	тыс. EUR/ USD	тыс. RUB/ KZT	на своп- рынке, тыс. USD/KZT	итого, млрд KZT	итого, млн USD	млрд KZT	млн USD
Январь	7 868 930	500	X	72 300	85 100	965,7	7 956,9	976,0	8 042,0
Февраль	8 853 540	2 430	X	20 700	767 650	1 378,1	9 624,9	1 492,9	10 392,5
Март	3 760 320	6 300	X	40 800	2 067 450	880,1	5 837,4	1 191,7	7 904,8
I квартал	20 482 790	9 230	X	133 800	2 920 200	3 223,8	23 419,2	3 660,7	26 339,4
Апрель	2 592 150	4 250	X	159 100	549 000	474,9	3 151,5	557,7	3 700,5
Май	1 838 485	61 540	X	91 600	322 500	337,9	2 247,8	386,4	2 570,3
Июнь	2 139 870	71 290	X	0	657 100	435,6	2 897,0	534,4	3 554,1
II квартал	6 570 505	137 080	X	250 700	1 528 600	1 248,4	8 296,3	1 478,5	9 824,9
Июль	3 277 490	73 300	X	0	1 274 000	701,3	4 655,1	893,3	5 929,1
Август	3 589 230	84 800	X	0	2 954 000	1 004,9	6 664,4	1 450,3	9 618,4
Сентябрь	2 556 165	106 300	X	16 400	2 274 200	752,3	4 985,7	1 095,4	7 259,9
III квартал	9 422 885	264 400	X	16 400	6 502 200	2 458,4	16 305,2	3 439,0	22 807,4
Октябрь	2 968 230	104 700	X	0	2 287 500	815,8	5 410,9	1 160,7	7 698,4
Ноябрь	6 111 960	52 735	X	246 000	1 853 500	1 204,6	8 052,6	1 482,0	9 906,1
Декабрь	3 651 150	53 100	22 500	595 000	2 460 500	927,9	6 241,6	1 293,7	8 702,1
IV квартал	12 731 340	210 535	22 500	841 000	6 601 500	2 948,3	19 705,0	3 936,5	26 306,5
Всего 2009 год	49 207 520	621 245	22 500	1 241 900	17 552 500	9 879,0	67 725,7	12 514,6	85 278,2
Структура	71,85 %	1,36 %	0,05 %	0,06 %	26,68 %	100,0 %	100,0 %		
Справочно:									
Всего 2008 год	138 827 860	11 950	н/т	575 600	5 000	16 708,7	138 874,0	16 709,3	138 879,0
Структура	99,97 %	0,01 %	X	0,02 %	<0,01 %	100,0 %	100,0 %		
Тренд 2009 к 2008:									
в деньгах	-89 620 340	+609 295	X	+666 300	+17 547 500	-6 829,6	-71 148,3	-4 194,7	-53 600,8
в процентах	-64,6	+5 098,7	X	+115,8	+350 950,0	-40,9	-51,2	-25,1	-38,6

Рисунок 21

Распределение объема торгов иностранными валютами на спот-рынке KASE по сессиям в 2009 году

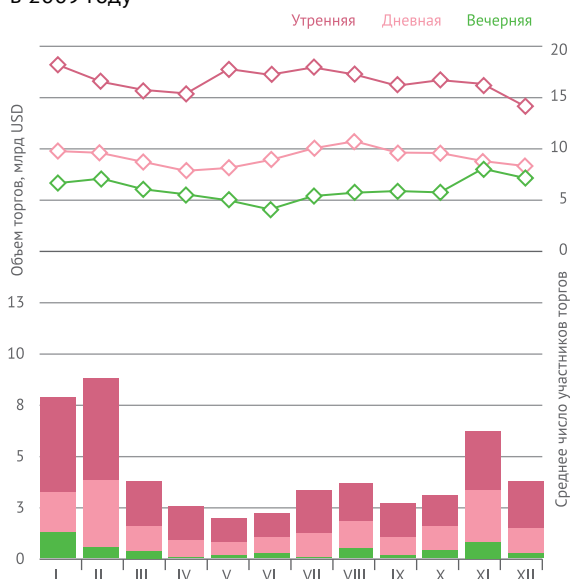


Таблица 55

Распределение объема торгов долларом США с расчетами в тенге на спот-рынке KASE по сессиям в 2009 году

Сессия	Доля, % от общего объема сделок:				
	2009	2008	2007	2006	2005
Утренняя (основная)	56,9	27,9	45,6	73,6	61,9
Дневная (дополнительная)	32,5	19,8	33,6	24,5	34,7
Вечерняя (дополнительная)	10,6	52,3	20,8	1,9	3,4
Итого	100,0	100,0	100,0	100,0	100,0

Таблица 56

Структура рынка иностранных валют KASE в 2009 и 2008 годах в разрезе инструментов

Период	Доллар США с расчетами в тенге			Операции валютного свопа			Евро с расчетами в тенге			Евро с расчетами в долларах США		Рубль РФ с расчетами в тенге
	USDKZT_TOD	USDKZT_TOM	USDKZT_SPT	USDKZT_0_001	USDKZT_0_002	USDKZT_1_002	EURKZT_TOD	EURKZT_TOM	EURKZT_SPT	EURUSD_TOD	EURUSD_TOM	RUBKZT_TOD
Количество сделок:												
2009 год	42 313	3 281	127	2 200	94	3	296	53	1	11	1	371
2008 год	107 115	21 301	11 705	1	0	0	32	1	н/г	н/г	н/г	217
Тренд, %	-60,5	-84,6	-98,9	+219 900,0	X	X	+825,0	+5 200,0	X	X	X	+71,0
Средний объем одной сделки, тыс. единиц валюты:												
2009 год	1 015,9	1 489,3	10 518,9	7 347,3	14 111,7	20 666,7	1 802,5	1 560,4	5 000,0	1 954,5	1 000,0	3 347,4
2008 год	605,9	1 214,9	4 105,4	5 000,0	0	0	342,2	1 000,0	н/г	н/г	н/г	2 652,5
Тренд, %	+67,7	+22,6	+156,2	+46,9	X	X	+426,8	+56,0	X	X	X	+26,2
Средний объем одного результативного дня, тыс. единиц валюты:												
2009 год	179 105,4	20 359,7	31 807,1	73 472,7	39 014,7	31 000,0	2 853,2	1 531,5	5 000,0	2 388,9	1 000,0	12 544,4
2008 год	135 200,4	103 927,8	237 889,5	5 000,0	0	0	331,8	1 000,0	н/г	н/г	н/г	3 837,3
Тренд, %	+32,5	-80,4	-86,6	+1 369,5	X	X	+759,9	+53,1	X	X	X	+226,9
Общий объем, тыс. единиц валюты:												
2009 год	42 985 290,0	4 886 330,0	1 335 900,0	16 164 000,0	1 326 500,0	62 000,0	533 545,0	82 700,0	5 000,0	21 500,0	1 000,0	1 241 900,0
2008 год	64 896 170,0	25 878 010,0	48 053 680,0	5 000,0	0	0	10 950,0	1 000,0	н/г	н/г	н/г	575 600,0
Тренд, %	-33,8	-81,1	-97,2	+323 180,0	X	X	+4 772,6	+8 170,0	X	X	X	+115,8

См. раздел „Пояснения к книге фактического материала“

Рисунок 22
Показатели биржевого спот-рынка EUR/KZT
в 2009 году



Рисунок 23
Показатели биржевого спот-рынка RUB/KZT
в 2009 году

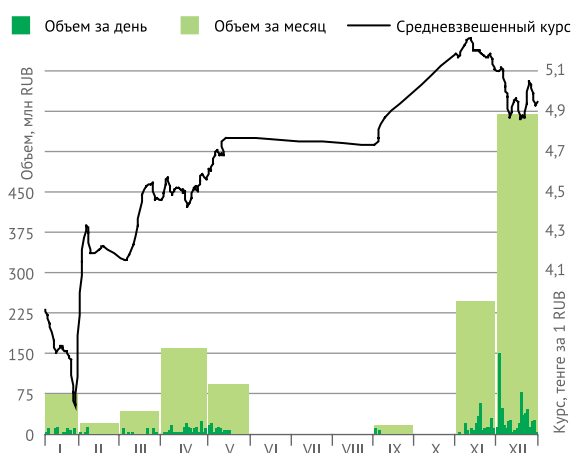


Рисунок 24
Показатели биржевого спот-рынка USD/KZT
в 2009 году



Таблица 57
Рэнкинг десяти наиболее активных операторов рынка иностранных валют на KASE в 2009 году

Позиция в 2009 году	Позиция в 2008 году	Краткое наименование компании	Показатель активности Ка
1	2	АО „Казкоммерцбанк“	1,65
2	1	АО „Дочерний Банк „RBS (Kazakhstan)“	1,58
3	4	АО „Народный сберегательный банк Казахстана“	1,401
4	7	ДБ АО „HSBC Банк Казахстан“	1,400
5	3	АО „Нурбанк“	1,27
6	8	АО „Ситибанк Казахстан“	1,16
7	21	Дочерняя организация АО „БТА Банк“ -АО „Темірбанк“	1,11
8	5	АО „БТА Банк“	1,06
9	9	АО „Банк ЦентрКредит“	1,05
10	10	АО Дочерний Банк „Альфа-Банк“	1,02

См. раздел „Пояснения к книге фактического материала“

Индикаторы межбанковских депозитов

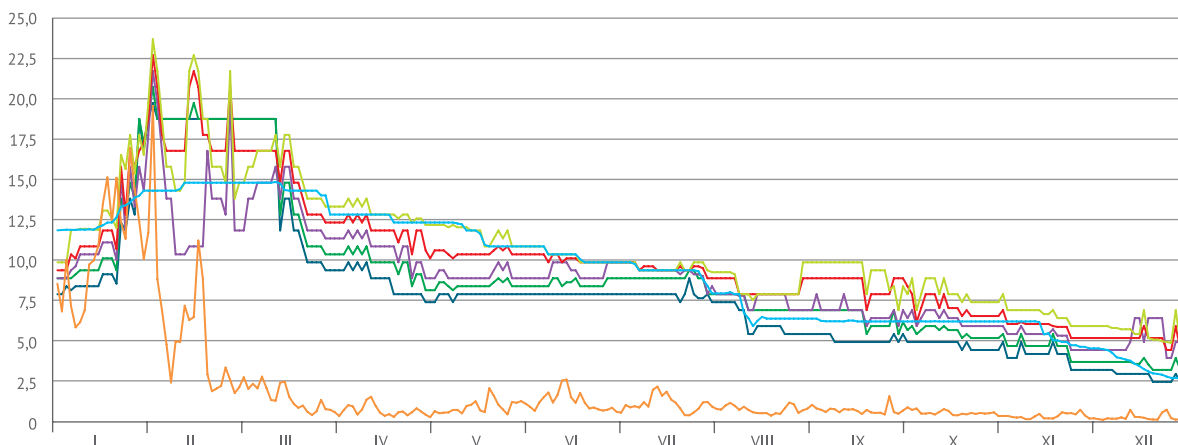
Таблица 58

Среднемесячные значения индикаторов межбанковского рынка депозитов в 2009 году

Ме-сяц	Инди-катор	7 дней	14 дней	Ме-сяц	2 меся-ца	3 меся-ца	Ме-сяц	Инди-катор	7 дней	14 дней	Ме-сяц	2 меся-ца	3 меся-ца	
I	KIBOR	10,04	10,95	11,34	12,11	13,16		KIBOR	8,00	9,00	9,52	9,69	9,73	
	KIBID	6,56	7,21	7,80	8,69	9,70		VII	KIBID	3,98	4,89	5,91	6,98	7,89
	KIMEAN	8,30	9,08	9,57	10,40	11,43		KIMEAN	5,99	6,94	7,71	8,33	8,81	
	KazPrime					12,62		KazPrime					9,56	
II	KIBOR	18,95	19,08	14,35	18,63	18,39		KIBOR	6,40	7,40	7,77	8,30	8,39	
	KIBID	9,10	9,33	9,74	10,53	13,05		VIII	KIBID	2,38	3,60	4,46	5,48	6,61
	KIMEAN	14,03	14,20	12,04	14,58	15,72		KIMEAN	4,39	5,50	6,11	6,89	7,50	
	KazPrime					14,78		KazPrime					7,02	
III	KIBOR	15,25	15,75	13,75	15,75	15,85		KIBOR	5,18	6,64	6,89	8,68	9,53	
	KIBID	8,00	8,31	8,88	9,56	12,02		IX	KIBID	1,30	2,45	3,06	4,43	5,45
	KIMEAN	11,63	12,03	11,31	12,66	13,94		KIMEAN	3,24	4,55	4,97	6,56	7,49	
	KazPrime					14,76		KazPrime					6,33	
IV	KIBOR	8,98	10,13	11,07	12,19	13,24		KIBOR	4,84	5,63	6,41	7,25	8,02	
	KIBID	6,70	7,32	7,95	9,45	11,09		X	KIBID	1,06	2,00	2,83	3,64	5,06
	KIMEAN	7,84	8,72	9,51	10,83	12,16		KIMEAN	2,95	3,82	4,62	5,45	6,54	
	KazPrime					12,90		KazPrime					6,29	
V	KIBOR	7,89	8,55	9,21	10,61	11,99		KIBOR	4,08	4,61	5,30	5,93	6,70	
	KIBID	4,82	5,53	6,25	7,58	9,01		XI	KIBID	0,46	0,92	1,89	2,60	4,17
	KIMEAN	6,36	7,04	7,73	9,09	10,50		KIMEAN	2,27	2,77	3,60	4,27	5,44	
	KazPrime					11,91		KazPrime					5,57	
VI	KIBOR	8,00	8,61	9,27	10,26	10,52		KIBOR	2,89	3,59	5,21	5,18	5,65	
	KIBID	4,00	4,63	5,47	6,39	7,44		XII	KIBID	0,23	0,51	0,90	1,64	2,34
	KIMEAN	6,00	6,62	7,37	8,32	8,98		KIMEAN	1,56	2,05	3,06	3,41	4,00	
	KazPrime					10,53		KazPrime					3,56	

Рисунок 25

Динамика ставок KIBOR, KazPrime и репо „овернайт“ в 2009 году (% годовых)



Справочная информация

Таблица 59

Основные листинговые требования KASE

Общие листинговые требования			
К финансовой отчетности	составление финансовой отчетности в соответствии с МСФО или GAAP США		
К аудиторской организации	аудит финансовой отчетности проводится аудиторской организацией, соответствующей требованиям АРД РФЦА		
К соблюдению норм корпоративного управления	для казахстанских эмитентов – наличие утвержденного общим собранием акционеров эмитента кодекса корпоративного управления для иностранных эмитентов – наличие утвержденного кодекса корпоративного управления или иного аналогичного по своему содержанию документа, если его наличие предусмотрено законодательством страны, юридическим лицом которой является эмитент		
К наличию маркет-мейкера ²⁵	при включении ценных бумаг в официальный список – подача одним из членов Биржи заявления о присвоении ему статуса маркет-мейкера по данным ценным бумагам при нахождении ценных бумаг в официальном списке – наличие маркет-мейкера по данным ценным бумагам		
К соблюдению прав инвесторов ²⁶	отсутствие в учредительных документах и/или в проспекте выпуска ценных бумаг норм, которые ущемляют или ограничивают права собственников данных ценных бумаг на их передачу (отчуждение)		
Листинговые требования сектора „акции“			
	первая (наивысшая) категория	вторая (наивысшая) категория	третья категория
К сроку существования эмитента	не менее трех лет (допускается зачет срока существования организации, в результате реорганизации которой (которых) был создан эмитент, а также меньший срок существования для организаций, единственным акционером которых является государство, национальный холдинг либо национальная управляющая компания)	не менее двух лет (допускается зачет срока существования организации, в результате реорганизации которой (которых) был создан эмитент, а также меньший срок существования для организаций, единственным акционером которых является государство, национальный холдинг либо национальная управляющая компания)	требование не установлено
К аудиту	предоставление финансовой отчетности эмитента, подтвержденной аудиторским отчетом, не менее чем за: последние три завершённых финансовых года, если заявление о листинге акций подано по истечении четырех месяцев с даты окончания последнего завершённого финансового года три последовательных завершённых финансовых года, предшествующих последнему завершённому финансовому году, если заявление о листинге акций подано в течение	предоставление финансовой отчетности эмитента, подтвержденной аудиторским отчетом, не менее чем за: последние два завершённых финансовых года, если заявление о листинге акций подано по истечении четырех месяцев с даты окончания последнего завершённого финансового года два последовательных завершённых финансовых года, предшествующих последнему завершённому финансовому году, если заявление о листинге акций подано в течение	предоставление финансовой отчетности эмитента, подтвержденной аудиторским отчетом за последний завершённый финансовый год или за период фактического существования в течение первых четырех месяцев после завершения последнего завершённого финансового года заявление о листинге акций может быть принято без предоставления финансовой отчетности за последний завершённый финансовый год, подтвержденной аудиторским отчетом,

→

²⁵ Данное требование не применяется для третьей категории сектора „акции“ и второй подкатегории категории „долговые ценные бумаги без рейтинговой оценки“.

²⁶ Данное требование не применяется при листинге ценных бумаг индексных фондов.

Таблица 59 (продолжение)

Листинговые требования сектора „акции“			
	первая (наивысшая) категория	вторая (наивысшая) категория	третья категория
	<p>четырёх месяцев с даты окончания последнего завершённого финансового года</p> <p>если с даты составления финансовой отчётности за последний завершённый финансовый год, подтверждённой аудиторским отчётом, прошло более шести месяцев до даты подачи заявления о листинге акций, предоставляется аудиторский отчёт по промежуточной финансовой отчётности или отчёт аудиторской организации по обзору промежуточной финансовой отчётности</p> <p>с даты составления последней предоставленной финансовой отчётности эмитента, по которой выпущен аудиторский отчёт или отчёт аудиторской организации по обзору промежуточной финансовой отчётности эмитента должно пройти не более шести месяцев до даты подачи заявления о листинге акций</p>	<p>четырёх месяцев с даты окончания последнего завершённого финансового года</p> <p>если с даты составления финансовой отчётности за последний завершённый финансовый год, подтверждённой аудиторским отчётом, прошло более шести месяцев до даты подачи заявления о листинге акций, предоставляется аудиторский отчёт по промежуточной финансовой отчётности или отчёт аудиторской организации по обзору промежуточной финансовой отчётности</p> <p>с даты составления последней предоставленной финансовой отчётности эмитента, по которой выпущен аудиторский отчёт или отчёт аудиторской организации по обзору промежуточной финансовой отчётности должно пройти не более шести месяцев до даты подачи заявления о листинге акций</p>	<p>в случае наличия у эмитента: финансовой отчётности, подтверждённой аудиторским отчётом, за год, предшествующий последнему завершённому финансовому году, а также отчёта аудиторской организации по обзору промежуточной финансовой отчётности, с даты составления которой прошло не более шести месяцев до даты подачи заявления о листинге акций, либо промежуточной финансовой отчётности данного эмитента, подтверждённой аудиторским отчётом, с даты составления которой прошло не более шести месяцев до даты подачи указанного заявления</p>
К размеру собственного капитала	не менее 8 560 000 МРП и не меньше уставного капитала во время нахождения акций в данной категории допускается снижение собственного капитала эмитента до величины, равной 70 % от суммы, эквивалентной 8 560 000 МРП, но не ниже уставного капитала	не менее 171 000 МРП и не меньше уставного капитала во время нахождения акций в данной категории допускается снижение собственного капитала эмитента до величины, равной 70 % от суммы, эквивалентной 171 000 МРП, но не ниже уставного капитала	не менее 51 000 МРП
К рыночной капитализации ²⁷	не менее 8 560 000 МРП по истечении шести месяцев с даты открытия торгов акциями	не менее 171 000 МРП по истечении шести месяцев с даты открытия торгов акциями	требование не установлено
К наличию чистой прибыли	не менее 85 600 МРП за каждый из трёх последних лет во время нахождения акций в данной категории допускается наличие чистой прибыли за два из трёх последних лет не менее эквивалента 85 600 МРП за каждый год	наличие чистой прибыли за один из двух последних лет	требование не установлено

→

²⁷ Требование применяется только при листинге простых акций.

Таблица 59 (продолжение)

Листинговые требования сектора „акции“				
	первая (наивысшая) категория	вторая (наивысшая) категория	третья категория	
К количеству акций в свободном обращении ²⁸	не менее 10 % от общего количества размещенных (за исключением выкупленных, обремененных и (или) блокированных) акций данного типа по истечении шести месяцев с даты открытия торгов данными акциями 15 % – по истечении одного года с даты открытия торгов данными акциями 25 % – по истечении двух лет с даты открытия торгов данными акциями для организаций, более 50 % акций которых на дату включения данных акций в официальный список принадлежит государству, национальному холдингу либо национальной управляющей компании, не менее: 5 % от общего количества размещенных акций по истечении шести месяцев с даты открытия торгов данными акциями 10 % – по истечении одного года с даты открытия торгов данными акциями	не менее 5 % от общего количества размещенных (за исключением выкупленных, обремененных и (или) блокированных) акций данного типа по истечении шести месяцев с даты открытия торгов данными акциями 10 % – по истечении одного года с даты открытия торгов данными акциями 15 % – по истечении двух лет с даты открытия торгов данными акциями для организаций, более 50 % акций которых на дату включения данных акций в официальный список принадлежит государству, национальному холдингу либо национальной управляющей компании, не менее 5 % от общего количества размещенных акций по истечении шести месяцев с даты открытия торгов данными акциями	требование не установлено	
Листинговые требования сектора „долговые ценные бумаги“				
	„долговые ценные бумаги с рейтинговой оценкой“ (наивысшая категория)	„долговые ценные бумаги без рейтинговой оценки“²⁹ первая подкатегория (наивысшая категория)	вторая подкатегория	„буферная категория“
К рейтинговой оценке	наличие у ценных бумаг рейтинговой оценки, соответствующей требованиям АРД РФЦА	требование не установлено	требование не установлено	Перевод долговых ценных бумаг в данную категорию осуществляется
К сроку существования эмитента	не менее двух лет (допускается зачет срока существования организации (организаций), в результате реорганизации которой (которых) был создан	не менее двух лет (допускается зачет срока существования организации (организаций), в результате реорганизации которой (которых) был создан	не менее одного года (допускается зачет срока существования организации (организаций), в результате реорганизации которой (которых) был создан	в случаях: несоответствия долговых ценных бумаг и их эмитентов требованиям, установленным для категории „долговые ценные

²⁸ В количество акций в свободном обращении не включаются акции, принадлежащие аффилированным лицам акционерного общества, являющимися таковыми в соответствии со статьей 64 закона Республики Казахстан „Об акционерных обществах“ от 13 мая 2003 года.

Расчет акций в свободном обращении по простым и привилегированным акциям эмитента осуществляется отдельно.

²⁹ С 01 января 2010 года данная категория предназначена только для долговых ценных бумаг, включенных в официальный список по данной категории до указанной даты.

Таблица 59 (продолжение)

Листинговые требования сектора „долговые ценные бумаги“				
	„долговые ценные бумаги с рейтинговой оценкой“ (наивысшая категория)	„долговые ценные бумаги без рейтинговой оценки“		„буферная категория“
		первая подкатегория (наивысшая категория)	вторая подкатегория	
	эмитент, а также меньший срок существования для организаций, единственным акционером которых является государство, национальный холдинг либо национальная управляющая компания)	эмитент, а также меньший срок существования для организаций, единственным акционером которых является государство, национальный холдинг либо национальная управляющая компания)	эмитент, а также меньший срок существования для организаций, единственным акционером которых является государство, национальный холдинг либо национальная управляющая компания)	бумаги без рейтинговой оценки“; дефолта эмитента по выплате вознаграждения по своим обязательствам (за исключением вознаграждения за последний купонный период);
К аудиту	предоставление финансовой отчетности эмитента, подтвержденной аудиторским отчетом, не менее чем за: последние два завершённых финансовых года, если заявление о листинге долговых ценных бумаг подано по истечении четырех месяцев с даты окончания последнего завершённого финансового года	предоставление финансовой отчетности эмитента, подтвержденной аудиторским отчетом, не менее чем за: последние два завершённых финансовых года, если заявление о листинге долговых ценных бумаг подано по истечении четырех месяцев с даты окончания последнего завершённого финансового года	предоставление финансовой отчетности эмитента, подтвержденной аудиторским отчетом, не менее чем за: последний завершённый финансовый год, если заявление о листинге долговых ценных бумаг подано по истечении четырех месяцев с даты окончания последнего завершённого финансового года	реструктуризации обязательств эмитента
	два последовательных завершённых финансовых года, предшествующих последнему завершённому финансовому году, если заявление о листинге долговых ценных бумаг подано в течение четырех месяцев с даты окончания последнего завершённого финансового года	два последовательных завершённых финансовых года, предшествующих последнему завершённому финансовому году, если заявление о листинге долговых ценных бумаг подано в течение четырех месяцев с даты окончания последнего завершённого финансового года	завершённый финансовый год, предшествующий последнему завершённому финансовому году, если заявление о листинге долговых ценных бумаг подано в течение четырех месяцев с даты окончания последнего завершённого финансового года	
	если с даты составления финансовой отчетности за последний завершённый финансовый год, подтвержденной аудиторским отчетом, прошло более шести месяцев до даты подачи заявления	если с даты составления финансовой отчетности за последний завершённый финансовый год, подтвержденной аудиторским отчетом, прошло более шести месяцев до даты подачи заявления	если с даты составления финансовой отчетности за последний завершённый финансовый год, подтвержденной аудиторским отчетом, прошло более шести месяцев до даты подачи заявления о листинге долговых	



Таблица 59 (продолжение)

Листинговые требования сектора „долговые ценные бумаги“				
	„долговые ценные бумаги с рейтинговой оценкой“ (наивысшая категория)	„долговые ценные бумаги без рейтинговой оценки“		„буферная категория“
		первая подкатегория (наивысшая категория)	вторая подкатегория	
	о листинге долговых ценных бумаг, предоставляется аудиторский отчет по промежуточной финансовой отчетности или отчет аудиторской организации по обзору промежуточной финансовой отчетности эмитента с даты составления последней, предоставленной инициатором допуска, финансовой отчетности эмитента, по которой выпущен аудиторский отчет или отчет аудиторской организации по обзору промежуточной финансовой отчетности эмитента должно пройти не более шести месяцев до даты подачи заявления о листинге долговых ценных бумаг	о листинге долговых ценных бумаг, предоставляется аудиторский отчет по промежуточной финансовой отчетности или отчет аудиторской организации по обзору промежуточной финансовой отчетности эмитента с даты составления последней, предоставленной инициатором допуска, финансовой отчетности эмитента, по которой выпущен аудиторский отчет или отчет аудиторской организации по обзору промежуточной финансовой отчетности эмитента должно пройти не более шести месяцев до даты подачи заявления о листинге долговых ценных бумаг	ценных бумаг, предоставляется аудиторский отчет по промежуточной финансовой отчетности или отчет аудиторской организации по обзору промежуточной финансовой отчетности эмитента с даты составления последней, предоставленной инициатором допуска финансовой отчетности эмитента, по которой выпущен аудиторский отчет или отчет аудиторской организации по обзору промежуточной финансовой отчетности эмитента должно пройти не более шести месяцев до даты подачи заявления о листинге долговых ценных бумаг	
К размеру собственного капитала	требование не установлено	не менее 2 050 000 МРП и не меньше уставного капитала	не менее 340 000 МРП и не меньше уставного капитала	
К наличию чистой прибыли	требование не установлено	не менее 85 600 МРП за один из двух последних лет	наличие чистой прибыли за один из последних трех завершаемых финансовых лет	
К объему продаж ³⁰	требование не установлено	не менее 2 050 000 МРП за каждый из двух последних лет	не менее 340 000 МРП за последний год	
Листинговые требования сектора „ценные бумаги инвестиционных фондов“³¹				
Общие листинговые требования				
К сроку действия лицензии на управление инвестиционным портфелем	не менее одного года на дату подачи заявления о листинге ценных бумаг инвестиционного фонда			→

³⁰ Требование применяется только к нефинансовым организациям, за исключением лизинговых организаций и кредитных товариществ.

³¹ Требования применяются к управляющей компании инвестиционного фонда или к акционерному инвестиционному фонду, если он обладает лицензией на управление инвестиционным портфелем, либо соответствующим документом, предусмотренным законодательством страны-регистрации инвестиционного фонда в качестве юридического лица.

Таблица 59 (продолжение)

Листинговые требования сектора „ценные бумаги инвестиционных фондов“				
Общие листинговые требования				
К аудиту	<p>предоставление финансовой отчетности, подтвержденной аудиторским отчетом за последний полный завершённый финансовый год либо за период фактического существования.</p> <p>В течение первых четырех месяцев после завершения последнего финансового года заявление о листинге ценных бумаг инвестиционного фонда может быть принято без предоставления финансовой отчетности за последний завершённый финансовый год, подтвержденной аудиторским отчетом, в случае наличия:</p> <p>финансовой отчетности, подтвержденной аудиторским отчетом, за год, предшествующий последнему завершённому финансовому году, а также отчета по обзору промежуточной финансовой отчетности, с даты составления которой прошло не более шести месяцев до даты подачи указанного заявления, либо промежуточной финансовой отчетности, подтвержденной аудиторским отчетом, с даты составления которой прошло не более шести месяцев до даты подачи указанного заявления</p>			
К размеру собственного капитала	не менее 400 000 МРП и не меньше уставного капитала			
К исполнению обязательств	в течение всего срока существования инвестиционного фонда отсутствуют случаи неисполнения или несвоевременного исполнения обязательств перед держателями ценных бумаг инвестиционного фонда			
К стоимости чистых активов	<p>не менее 215 000 МРП</p> <p>в случае отсутствия на дату включения в официальный список размещенных ценных бумаг инвестиционного фонда данное требование применяется через три месяца с даты открытия торгов этими ценными бумагами</p>			
К числу держателей ценных бумаг	не менее пятидесяти по истечении трех месяцев с даты открытия торгов ценными бумагами инвестиционного фонда			
К раскрытию инвестиционной декларации	осуществляется в соответствии с требованиями, установленными внутренними документами фондовой биржи			
	для паев инвестиционного фонда	для акций инвестиционного фонда	для акций фонда недвижимости	для ценных бумаг индексного фонда
К сроку существования ³²	требование не установлено	государственная регистрация акционерного инвестиционного фонда осуществлена не менее чем за год до дня подачи заявления о включении его ценных бумаг в официальный список		требование не установлено
К оценке активов	требование не установлено	оценка активов акционерного инвестиционного фонда производится одним из оценщиков, входящим в перечень признаваемых фондовой биржей оценщиков		требование не установлено
К чистой прибыли	требование не установлено	наличие чистой прибыли у акционерного инвестиционного фонда за каждый год существования		требование не установлено
К размещению и обращению	в соответствии с законодательством страны-регистрации выпуска ценных бумаг инвестиционного фонда выпущенные им ценные бумаги должны быть разрешены к размещению и обращению в торговой системе фондовой биржи		требование не установлено	требование не установлено

→

³² Требование не применяется к фонду недвижимости, которому присвоена рейтинговая оценка одним из рейтинговых агентств, признаваемых АРД РФЦА.

Таблица 59 (продолжение)

	для паев инвестиционного фонда	для акций инвестиционного фонда	для акций фонда недвижимости	для ценных бумаг индексного фонда
К размеру обязательств	требование не установлено		размер обязательств по выпущенным ценным бумагам и/или другим обязательствам в совокупности не превышают десяти процентов собственного капитала фонда недвижимости	требование не установлено
К размеру инвестиционных доходов ³²	требование не установлено		не менее семидесяти пяти процентов инвестиционных доходов фонда недвижимости составляют доходы, полученные в результате сдачи в аренду недвижимого имущества	требование не установлено
К недвижимости, входящей в активы фонда недвижимости	требование не установлено		не приобретена у аффилированных лиц управляющей компании фонда недвижимости не обременена либо передана в доверительное управление срок сдачи недвижимости в аренду, установленный договором аренды, составляет не менее одного года недвижимость сдается в аренду в течение двух лет до дня подачи заявления о листинге акций ³³	требование не установлено
К ценным бумагам, входящим в представительский список индекса	требование не установлено			включены в официальный список одной из фондовых бирж, входящих в перечень фондовых бирж, признаваемых АРД РФЦА

См. раздел „Пояснения к книге фактического материала“

³³ Требование данного абзаца не применяется к фонду недвижимости, которому присвоена рейтинговая оценка одним из рейтинговых агентств, признаваемых АРД РФЦА.

Таблица 60

Компании, допустившие дефолты по своим долговым ценным бумагам в 2009 году

Код	Объект дефолта	Дата дефолта	Объем дефолта, млн тенге	Объем урегулированной задолженности, млн тенге
ALB Finance B.V.				
ASB№2	купон	22.11.09	1 338,1	
ASB№3	купон	19.10.09	1 060,2	
Итого по эмитенту:			2 398,3	
TuranAlem Finance B.V.				
BTASe3	купон	02.12.09	3 231,8	
BTASe4	купон	24.09.09	2 319,2	
BTASe5	купон	10.08.09	2 242,9	
BTASe6	купон	25.10.09	1 461,1	
Итого по эмитенту:			9 255,0	
АО „GLOTUR“ (ГЛОТУР)				
GLOTb2	купон	20.03.09	946,2	
GLOTb2	купон	20.09.09	448,9	
Итого по эмитенту:			1 395,1	
АО „Альянс Банк“				
ASB№1	купон	23.12.09	135,0	
ASB№1	основной долг	23.12.09	3 000,0	
ASB№10	купон	08.11.09	340,9	
ASB№12	купон	20.09.09	8,4	
ASB№13	купон	20.09.09	0,1	
ASB№14	купон	20.09.09	145,5	
ASB№3	купон	29.10.09	159,0	
ASB№6	основной долг	10.04.09	6 990,7	
ASB№8	купон	26.06.09	189,8	174,9
ASB№8	купон	26.12.09	174,9	
Итого по эмитенту:			11 144,2	174,9
АО „Астана-Финанс“				
ASFb10	купон	28.09.09	9,2	
ASFb11	купон	28.09.09	322,5	
ASFb12	купон	29.09.09	240,1	
ASFb13	купон	07.06.09	3 308,8	
ASFb15	купон	25.09.09	423,7	
ASFb16	купон	19.11.09	1 129,1	
ASFb17	купон	14.11.09	953,8	
ASFb18	купон	06.06.09	626,5	
ASFb20	купон	26.06.09	58,6	
ASFb20	основной долг	26.06.09	1 440,4	
ASFb21	купон	26.06.09	50,9	
ASFb21	купон	26.12.09	50,9	
ASFb22	купон	29.08.09	549,5	
ASFb23	купон	29.08.09	235,8	
ASFb24	купон	29.08.09	299,6	
ASFb4	купон	18.11.09	106,2	
ASFb6	купон	22.12.09	48,2	
ASFb7	купон	30.12.09	17,7	
ASFb9	купон	12.11.09	232,3	
Итого по эмитенту:			10 103,5	

→

Таблица 60 (продолжение)

Код	Объект дефолта	Дата дефолта	Объем дефолта, млн тенге	Объем урегулированной задолженности, млн тенге
АО „БИЛД ИНВЕСТМЕНТС ГРУПП“				
BIGRb1	купон	28.06.09	90,0	
BIGRb1	основной долг	28.06.09	2 001,0	
Итого по эмитенту:			2 091,0	
АО „БТА Банк“				
BTASb2	купон	29.10.09	168,8	
BTASb3	купон	06.11.09	401,3	
BTASb4	купон	10.12.09	711,7	
BTASb5	купон	30.12.09	89,6	
BTASb7	купон	29.12.09	3 374,5	
BTASb9	купон	16.12.09	2 241,7	
Итого по эмитенту:			6 987,4	
АО „БУРЛИНГАЗСТРОЙ“				
BGSTb1	купон	01.08.09	150,0	
Итого по эмитенту:			150,0	
АО „Досжан темир жолы (ДТЖ)“				
DTJLb1	купон	01.08.09	5 983,8	
Итого по эмитенту:			5 983,8	
АО „КОМБИСНАБ“				
KMSBb1	купон	02.03.09	39,7	
KMSBb1	купон	02.07.09	39,7	
KMSBb1	купон	02.11.09	44,6	
Итого по эмитенту:			124,0	
АО „Казахская дистрибуционная компания“				
KZDKb1	купон	01.03.09	55,0	7,4
KZDKb1	купон	01.09.09	55,0	
Итого по эмитенту:			110,0	7,4
АО „Казнефтехим“				
KZNNb2	купон	18.02.09	200,0	200,0
KZNNb2	купон	18.08.09	200,0	
Итого по эмитенту:			400,0	200,0
АО „Орнек XXI“				
ORNKb1	купон	20.03.09	220,0	
Итого по эмитенту:			220,0	
АО „РОСА“				
ROSAb2	купон	18.05.09	86,3	
Итого по эмитенту:			86,3	
АО „РТ Холдинг“				
KSMKb2	купон	06.11.09	71,2	
Итого по эмитенту:			71,2	
АО „РЭМИКС-Р“				
RMXRb1	купон	29.06.09	80,7	
Итого по эмитенту:			80,7	
АО „Транстроймост“				
TSSMb1	купон	06.04.09	224,7	
Итого по эмитенту:			224,7	
АО „Эль-ДОС“				
ELDSb1	купон	06.05.09	44,4	8,8

→

Таблица 60 (продолжение)

Код	Объект дефолта	Дата дефолта	Объем дефолта, млн тенге	Объем урегулированной задолженности, млн тенге
ELDSb1	основной долг	06.05.09	592,4	8,8
Итого по эмитенту:			636,8	17,6
Дочерняя организация Акционерного общества „БТА Банк“-АО „Темірбанк“				
TEBNb10	купон	29.11.09	105,3	
TEBNb11	купон	29.11.09	142,4	
TEBNb6	купон	30.12.09	182,0	
TEBNb7	купон	01.12.09		
TEBNb8	купон	01.12.09	171,2	
Итого по эмитенту:			600,9	
ТОО „Акмола Курлыс Материалдары“				
AKKMb1	купон	12.07.09	117,4	
Итого по эмитенту:			117,4	
Итого по всем эмитентам:			52 180,4	399,9

См. раздел „Пояснения к книге фактического материала“

Таблица 61

Динамика основных индикаторов рынка KASE в 2009 году

Дата расчета индикатора	Рынок акций			Рынок корпоративных облигаций					Рынок репо	Рынок иностранных валют				Индикаторы депозитов
	индекс KASE	капита- лизация	объем сделок	индекс KASE_BC	индекс KASE_BP	индекс KASE_BY	капита- лизация	объем сделок	индикатор TONIA	средневзвешенный курс тенге к:			объем торгов	KazPrime-3М
		млн USD	тыс. USD				% год.	млн USD		тыс. USD	% год.	1 USD		
05.01.09	892	30 950,0	8 751,4	145,74	243,85	10,39	12 586,9	11 386,6	8,66	120,86	-	-	408 040,0	12,01
06.01.09	878	30 435,9	4 208,0	145,09	242,80	10,47	12 543,3	1 727,9	6,92	120,95	163,73	-	130 026,8	12,03
08.01.09	855	31 424,1	1 253,4	144,74	242,15	10,54	12 541,1	18 880,1	10,16	120,99	-	-	523 430,0	12,05
09.01.09	873	31 176,9	4 651,0	139,65	235,03	12,59	12 556,2	74 761,2	7,25	121,00	-	-	181 005,0	12,04
12.01.09	886	31 038,4	4 881,0	146,13	243,62	12,47	12 554,0	6 240,6	5,92	121,04	-	3,9099	406 072,7	12,04
13.01.09	867	31 055,3	15 438,6	144,59	241,41	11,16	12 605,5	3 364,6	6,24	121,14	-	3,8889	279 233,1	12,06
14.01.09	869	31 194,3	2 196,3	145,61	242,51	11,07	12 598,8	1 667,0	6,99	121,26	-	3,8450	541 485,4	12,05
15.01.09	841	30 228,1	1 054,1	145,16	241,75	11,08	12 597,1	14 629,1	9,87	121,37	-	-	291 385,0	12,07
16.01.09	846	30 149,5	4 183,2	145,28	241,63	11,14	12 644,7	17 830,2	10,12	121,31	-	3,7625	627 795,2	12,05
19.01.09	838	30 199,2	1 869,4	142,93	238,12	11,95	12 653,5	9 592,5	11,03	121,29	-	3,7023	358 412,1	12,22
20.01.09	804	29 440,2	8 675,9	145,40	241,46	11,15	12 652,4	7 746,0	13,66	121,30	-	-	333 280,0	12,32
21.01.09	783	28 956,6	1 145,1	145,46	241,46	11,13	12 651,8	3 631,6	15,33	121,31	-	3,7350	385 136,9	12,50
22.01.09	779	29 317,1	3 642,2	144,69	240,10	11,20	12 661,0	46 469,0	12,54	121,32	-	3,7231	352 772,9	12,50
23.01.09	772	28 308,0	26 230,5	146,02	241,46	11,17	12 664,8	12 043,5	15,31	121,60	-	3,7120	1 281 187,7	12,82
26.01.09	726	28 419,1	13 891,7	145,84	241,23	11,15	12 661,4	14 270,9	12,52	121,65	-	3,7090	207 014,9	13,50
27.01.09	723	27 399,4	30 355,2	146,41	241,68	11,13	12 657,8	37 730,7	11,48	121,70	-	3,6840	558 250,3	13,58
28.01.09	694	27 739,3	3 254,1	147,18	242,64	11,09	12 657,3	2 937,4	17,18	121,71	-	3,6652	309 016,6	13,76
29.01.09	664	27 349,4	7 133,0	147,08	242,38	11,19	12 665,6	12 296,9	14,58	121,56	-	3,5020	361 665,3	14,06
30.01.09	622	26 662,0	11 572,5	145,85	240,26	11,27	12 653,6	12 880,3	12,57	121,47	-	3,4458	336 611,1	14,18
02.02.09	581	25 915,1	2 994,3	146,14	240,77	11,50	12 631,5	17 383,0	10,20	121,87	-	-	624 460,0	14,50
03.02.09	577	25 826,8	304,2	147,06	241,72	11,47	12 607,2	11 797,3	11,86	122,32	-	-	1 570 120,0	14,50
04.02.09	656	24 586,2	4 740,2	147,23	241,69	11,47	11 629,3	21 266,1	19,82	143,98	-	-	591 565,0	14,50
05.02.09	665	24 195,1	3 341,8	142,80	235,21	12,03	11 412,0	25 819,1	8,94	149,97	-	-	348 500,0	14,50
06.02.09	673	24 130,2	1 897,9	145,96	239,52	11,57	11 418,9	35 562,7	7,01	149,54	191,60	-	197 151,9	14,50
09.02.09	687	25 154,8	10 004,7	142,12	233,93	11,94	11 421,9	13 787,4	4,85	148,50	-	-	73 845,0	14,50
10.02.09	684	25 272,4	62 672,4	140,68	232,14	12,22	11 429,0	73 990,7	2,46	148,30	191,10	-	859 078,9	14,50
11.02.09	691	24 836,7	4 783,3	142,28	234,36	12,92	11 435,6	21 896,0	5,05	148,11	-	4,1550	101 528,2	14,50
12.02.09	682	25 049,7	15 992,6	140,59	231,53	13,39	11 427,0	51 540,2	4,99	148,39	192,17	-	225 477,0	14,60
13.02.09	632	24 458,5	7 728,5	143,53	235,12	13,34	11 409,1	3 309,8	7,28	148,90	-	4,3270	437 355,2	15,00

↓

Таблица 61 (продолжение)

Дата расчета индикатора	Рынок акций			Рынок корпоративных облигаций					Рынок репо	Рынок иностранных валют				Индикаторы депозитов
	индекс KASE	капита- лизация млн USD	объем сделок тыс. USD	индекс KASE_BC	индекс KASE_BP	индекс KASE_BY % год.	капита- лизация млн USD	объем сделок тыс. USD	индикатор TONIA % год.	средневзвешенный курс тенге к:			объем торгов тыс. USD	KazPrime-3M % год.
										1 USD тенге	1 EUR тенге	1 RUB тенге		
16.02.09	633	27 626,7	206 979,3	143,88	235,69	13,28	11 398,4	6 639,6	6,38	149,11	-	4,2927	197 974,3	15,00
17.02.09	638	27 318,8	2 727,9	143,63	234,97	13,19	11 389,9	13 116,5	6,56	149,28	-	4,1900	297 669,6	15,00
18.02.09	641	26 883,3	4 220,9	144,73	236,12	13,09	11 449,4	13 680,7	11,37	149,42	-	-	200 200,0	15,00
19.02.09	621	26 984,2	4 736,5	143,39	234,25	13,16	11 447,8	2 748,1	8,96	149,00	187,25	-	171 833,7	15,00
20.02.09	643	26 579,9	5 472,6	144,00	234,62	13,13	11 435,1	19 159,9	2,98	149,36	-	-	421 200,0	15,00
23.02.09	641	26 343,2	5 200,2	142,38	232,05	13,38	11 412,7	4 385,8	1,91	150,00	-	-	265 500,0	15,00
24.02.09	633	25 985,4	330,1	142,93	232,43	13,51	11 406,1	5 711,9	2,08	150,19	191,40	-	1 002 799,9	15,00
25.02.09	639	26 315,3	562,6	142,51	231,41	13,50	11 402,5	644,8	2,24	150,00	-	4,2100	554 828,1	15,00
26.02.09	640	26 113,6	732,0	141,75	230,46	13,52	11 393,5	8 056,1	3,40	150,26	-	-	475 225,0	15,00
27.02.09	627	26 069,8	916,2	142,19	230,84	13,60	11 387,3	5 650,8	2,63	150,43	191,00	4,2270	240 907,7	15,00
02.03.09	621	26 192,7	219,5	142,53	231,03	13,60	11 381,5	1 675,2	1,80	150,60	-	-	237 380,0	15,00
03.03.09	598	25 550,5	218,3	143,50	232,13	13,44	11 383,5	1 544,7	2,16	150,54	-	4,1600	264 848,7	15,00
04.03.09	595	25 192,8	2 154,9	146,54	236,78	12,12	11 387,7	4 550,2	2,79	150,42	-	-	210 600,0	15,00
05.03.09	614	23 416,7	260,5	139,43	228,73	14,09	11 422,6	1 395,9	2,06	150,31	189,85	4,1850	134 536,1	15,00
06.03.09	603	23 342,6	225,5	140,00	229,23	14,41	11 416,3	11 480,5	2,38	150,49	-	-	216 800,0	15,00
10.03.09	604	23 462,3	261,0	139,99	229,19	14,31	11 414,9	3 209,0	2,09	150,53	-	4,2390	102 355,5	15,00
11.03.09	624	24 253,4	4 662,7	140,06	228,64	17,65	11 415,3	7 787,8	2,83	150,52	-	-	252 185,0	15,00
12.03.09	621	23 378,6	34 394,4	140,10	228,59	17,78	11 419,1	7 681,3	2,11	150,48	-	-	115 660,0	15,00
13.03.09	641	24 858,7	2 592,3	140,20	227,85	17,82	11 425,7	7 566,3	1,36	150,29	-	4,3310	178 263,2	15,00
16.03.09	649	24 938,8	57 090,2	140,16	228,02	17,85	11 427,1	8 654,5	1,32	150,25	194,80	-	107 529,7	15,04
17.03.09	660	24 703,3	793,4	140,04	227,58	17,92	11 555,5	481,1	2,45	150,38	195,97	-	65 410,9	14,95
18.03.09	674	24 780,2	1 664,2	139,96	227,14	18,01	11 548,4	759,2	2,51	150,58	195,80	-	187 110,1	14,54
19.03.09	683	24 913,1	3 264,7	142,13	228,33	17,78	11 536,0	17 753,0	1,56	150,93	-	4,4850	396 108,9	14,50
20.03.09	679	25 524,7	4 613,5	140,00	225,72	18,12	11 530,0	61 605,8	1,12	151,10	-	-	202 650,0	14,50
24.03.09	718	26 949,8	2 185,1	140,73	226,82	18,16	11 541,0	510,2	0,87	151,31	206,00	4,5260	164 077,6	14,50
25.03.09	693	26 321,4	14 152,3	140,89	227,08	18,26	11 538,5	852,3	1,01	151,38	203,83	-	150 182,3	14,50
26.03.09	709	26 733,4	488,3	140,03	225,52	18,37	11 539,6	17 423,4	0,62	151,35	-	4,5370	99 615,0	14,50
27.03.09	720	27 908,2	28 612,6	140,49	225,96	18,41	11 539,6	7 774,4	0,42	151,35	-	4,5452	237 335,3	14,50
30.03.09	704	26 406,2	5 682,7	139,82	225,05	18,14	11 537,8	7 950,1	0,65	151,40	200,00	4,4580	186 152,5	14,50
31.03.09	684	26 203,2	1 216,9	141,08	225,76	17,90	11 549,1	17 086,1	1,37	151,08	-	4,4670	261 141,6	14,20

↓

Таблица 61 (продолжение)

Дата расчета индикатора	Рынок акций			Рынок корпоративных облигаций					Рынок репо	Рынок иностранных валют				Индикаторы депозитов
	индекс KASE	капита- лизация млн USD	объем сделок тыс. USD	индекс KASE_BC	индекс KASE_BP	индекс KASE_BY % год.	капита- лизация млн USD	объем сделок тыс. USD	индикатор TONIA % год.	средневзвешенный курс тенге к:			объем торгов тыс. USD	KazPrime-3M % год.
										1 USD тенге	1 EUR тенге	1 RUB тенге		
01.04.09	683	26 201,2	13 241,3	140,42	224,30	17,82	11 509,2	3 712,6	0,78	150,99	-	4,4550	115 289,5	14,20
02.04.09	720	27 734,0	11 584,0	142,12	225,23	17,49	11 506,8	751,3	0,75	150,98	-	4,4900	84 014,2	13,00
03.04.09	748	28 962,0	3 036,6	139,84	222,04	17,78	11 505,8	699,0	0,60	151,01	-	4,5350	55 915,1	13,00
06.04.09	770	28 914,0	2 264,0	142,18	223,44	17,81	11 493,5	572,3	0,36	151,08	-	4,5675	77 676,3	13,00
07.04.09	729	27 926,7	1 481,1	141,12	221,82	17,66	11 494,6	2 271,2	0,74	151,05	201,90	4,5241	120 921,6	13,00
08.04.09	721	27 830,0	786,1	141,76	221,57	17,65	11 492,9	17 768,0	1,04	151,00	199,40	4,4830	67 673,2	13,00
09.04.09	797	28 424,9	855,6	142,01	221,02	17,53	11 500,9	364,8	0,96	150,77	-	-	80 875,0	13,00
10.04.09	839	30 163,5	698,7	145,31	223,65	17,31	11 454,8	5 406,2	0,45	150,76	-	4,5050	141 361,7	13,00
13.04.09	813	30 398,5	896,2	148,33	225,35	17,19	11 450,6	7 352,8	0,76	150,83	-	4,5150	173 964,9	13,00
14.04.09	840	30 937,3	3 586,0	148,96	225,30	17,23	11 465,7	456,5	1,38	150,66	-	4,5171	340 449,9	13,00
15.04.09	847	31 597,7	24 341,8	148,54	224,11	17,37	11 478,0	12 526,4	1,57	150,31	199,75	4,5050	282 465,7	13,00
16.04.09	846	31 235,8	14 774,4	148,17	222,96	17,32	11 482,9	3 210,2	0,99	150,17	-	4,4915	75 749,9	13,00
17.04.09	854	31 976,3	11 916,9	148,18	222,15	17,28	11 483,6	7 867,7	0,56	150,15	197,00	4,5047	79 774,4	13,00
20.04.09	860	32 240,7	1 782,4	148,04	221,20	17,37	11 477,3	1 925,4	0,37	150,33	-	4,4962	97 986,9	13,00
21.04.09	855	30 769,9	6 646,8	150,06	222,44	17,19	11 471,6	1 455,5	0,47	150,49	-	4,4200	80 319,3	12,99
22.04.09	854	31 852,1	883,8	149,68	221,22	17,16	11 462,4	1 444,9	0,30	150,76	-	4,4380	220 413,9	12,50
23.04.09	878	32 464,4	1 015,7	153,90	223,87	17,19	11 468,3	21 156,9	0,59	150,59	-	4,4700	75 227,5	12,50
24.04.09	891	32 722,0	5 014,6	154,51	223,77	17,13	11 468,6	5 619,6	0,64	150,58	198,50	4,5100	70 458,9	12,50
27.04.09	863	32 510,2	4 038,3	155,20	223,78	17,04	11 465,9	4 971,9	0,40	150,66	198,15	4,5220	47 574,9	12,50
28.04.09	865	32 640,1	2 611,8	155,42	223,07	17,06	11 465,5	12 612,4	0,59	150,67	-	4,5029	98 302,3	12,50
29.04.09	877	32 426,7	749,3	155,71	222,67	17,00	11 464,6	126,4	0,84	150,72	-	4,5513	125 670,8	12,50
30.04.09	900	33 155,1	1 889,4	156,04	222,14	17,25	11 467,4	3 866,4	0,64	150,64	-	4,5840	90 427,3	12,50
04.05.09	959	34 373,1	906,0	156,09	221,49	17,26	11 466,0	2 806,6	0,44	150,68	198,85	4,5633	78 200,2	12,50
05.05.09	983	35 884,2	1 615,6	155,56	220,07	17,38	11 466,7	802,5	0,28	150,66	202,00	4,6120	76 363,2	12,50
06.05.09	1 032	37 050,1	941,3	155,77	219,84	17,42	11 484,3	32 714,9	0,66	150,61	-	-	35 760,0	12,50
07.05.09	1 053	39 005,0	2 671,6	155,55	218,73	17,53	11 522,7	2 112,2	0,53	150,46	-	4,6000	90 646,7	12,50
08.05.09	1 074	38 198,7	1 052,9	156,31	218,72	17,73	11 512,8	8 681,3	0,57	150,46	-	4,6321	89 508,3	12,50
12.05.09	1 036	37 869,1	2 071,0	156,69	218,45	17,67	11 520,2	1 751,8	0,58	150,25	201,50	4,6755	66 718,2	12,50
13.05.09	1 025	37 567,6	2 746,6	159,42	220,27	17,55	11 529,1	4 951,8	0,74	150,00	204,29	4,7021	109 492,7	12,50
14.05.09	1 004	36 362,5	600,8	158,89	219,17	17,63	11 602,3	3 013,5	0,74	149,82	204,10	4,6800	105 892,3	12,44

↓

Таблица 61 (продолжение)

Дата расчета индикатора	Рынок акций			Рынок корпоративных облигаций					Рынок репо	Рынок иностранных валют				Индикаторы депозитов
	индекс KASE	капита- лизация млн USD	объем сделок тыс. USD	индекс KASE_BC	индекс KASE_BP	индекс KASE_BY % год.	капита- лизация млн USD	объем сделок тыс. USD	индикатор TONIA % год.	средневзвешенный курс тенге к:			объем торгов тыс. USD	KazPrime-3M % год.
										1 USD тенге	1 EUR тенге	1 RUB тенге		
15.05.09	1 071	36 725,4	3 892,2	160,24	219,42	17,50	11 590,4	3 986,1	0,52	150,15	204,15	4,6850	164 355,9	12,38
18.05.09	1 088	36 346,9	857,6	160,04	218,81	17,68	11 585,5	20 259,2	0,99	150,27	204,03	4,6750	96 253,1	12,00
19.05.09	1 129	36 892,0	3 624,4	161,12	219,21	17,63	11 580,1	28 904,6	1,06	150,42	204,00	-	79 511,7	12,00
20.05.09	1 146	36 877,1	4 945,0	161,20	218,42	17,65	11 602,7	2 002,6	1,28	150,59	204,05	4,7650	183 956,6	12,00
21.05.09	1 156	38 127,4	4 641,5	160,90	217,49	17,67	11 602,4	25 805,6	0,71	150,58	204,98	-	105 910,7	11,80
22.05.09	1 165	37 957,6	1 410,0	161,69	217,20	17,70	11 611,8	10 747,6	0,60	150,30	204,15	-	118 219,3	11,10
25.05.09	1 141	37 842,5	708,4	162,13	217,23	17,67	11 629,0	29 899,3	2,10	150,07	206,02	-	119 795,3	11,00
26.05.09	1 104	37 374,2	1 185,3	162,08	216,46	17,70	11 622,9	4 488,0	1,63	149,96	209,44	-	60 600,3	11,00
27.05.09	1 156	38 798,0	786,0	163,45	216,88	17,58	11 616,8	1 595,1	1,06	150,13	209,60	-	80 498,7	11,00
28.05.09	1 134	38 298,1	1 079,6	163,25	216,01	17,40	11 621,4	6 475,6	0,77	150,39	209,70	-	157 213,1	11,00
29.05.09	1 157	39 682,0	3 432,1	163,06	215,08	17,40	11 618,1	24 054,2	0,46	150,44	209,80	-	106 413,7	11,00
01.06.09	1 185	40 189,4	11 778,9	163,33	214,75	17,43	11 606,1	33 193,2	1,24	150,22	209,90	-	90 772,4	11,00
02.06.09	1 224	42 267,8	13 029,4	163,71	214,32	17,40	11 545,0	17 258,1	1,19	150,29	212,74	-	69 811,7	11,00
03.06.09	1 216	41 402,2	8 073,3	164,72	214,65	17,29	11 715,5	2 723,8	1,29	150,27	214,70	-	72 492,3	11,00
04.06.09	1 170	40 477,4	2 119,8	165,93	214,50	16,82	11 716,6	8 809,4	1,13	150,24	213,00	-	81 539,2	11,00
05.06.09	1 200	41 837,6	1 441,2	166,16	213,82	16,75	11 713,3	3 260,4	0,93	150,33	213,40	-	45 859,6	11,00
08.06.09	1 165	41 459,9	691,8	165,83	212,94	16,77	11 708,6	121,8	0,68	150,46	214,70	-	118 111,9	11,00
09.06.09	1 169	40 888,7	357,1	165,86	212,00	16,76	11 714,4	11 591,7	1,21	150,30	208,70	-	56 306,7	11,00
10.06.09	1 206	42 441,7	819,8	163,62	208,85	16,94	11 712,6	7 479,7	1,54	150,35	211,90	-	103 079,1	11,00
11.06.09	1 192	42 886,3	484,6	164,10	208,67	16,92	11 711,1	23 985,7	1,83	150,39	210,60	-	77 567,1	10,50
12.06.09	1 180	42 796,9	1 077,7	163,40	207,04	16,96	11 712,6	20 420,3	1,20	150,35	211,50	-	66 081,2	10,50
15.06.09	1 166	42 514,0	527,0	167,68	209,49	16,67	11 707,1	8 367,9	1,67	150,13	209,03	-	111 932,4	10,50
16.06.09	1 140	42 045,1	369,4	166,84	207,77	16,92	11 702,3	3 296,2	2,58	150,26	208,47	-	69 467,3	10,50
17.06.09	1 118	40 625,5	398,4	166,07	205,46	17,04	11 693,0	23 659,0	2,64	150,29	208,55	-	25 663,5	10,50
18.06.09	1 090	40 188,5	835,5	166,22	204,04	17,02	11 692,6	20 609,7	1,53	150,30	209,70	-	45 426,1	10,50
19.06.09	1 101	40 197,3	354,4	165,54	203,43	17,07	11 662,7	18 606,0	1,19	150,30	209,30	-	108 279,6	10,50
22.06.09	1 089	39 453,2	2 224,7	165,54	203,33	16,69	11 659,4	17 105,0	1,80	150,39	208,77	-	97 844,0	10,20
23.06.09	1 015	36 843,4	1 017,6	166,88	204,60	16,77	11 658,0	23 241,2	1,20	150,43	208,40	-	110 732,1	10,00
24.06.09	1 056	38 959,6	900,0	167,05	204,75	16,81	11 654,0	14 950,3	0,83	150,54	212,30	-	70 786,8	10,00
25.06.09	1 070	39 807,4	1 291,1	167,17	204,79	16,25	11 659,8	30 918,3	0,89	150,38	210,16	-	96 643,0	10,00

↓

Таблица 61 (продолжение)

Дата расчета индикатора	Рынок акций			Рынок корпоративных облигаций					Рынок репо	Рынок иностранных валют				Индикаторы депозитов
	индекс KASE	капита- лизация млн USD	объем сделок тыс. USD	индекс KASE_BC	индекс KASE_BP	индекс KASE_BY % год.	капита- лизация млн USD	объем сделок тыс. USD	индикатор TONIA % год.	средневзвешенный курс тенге к:			объем торгов тыс. USD	KazPrime-3M % год.
										1 USD тенге	1 EUR тенге	1 RUB тенге		
26.06.09	1 044	38 593,4	987,5	170,36	207,33	15,33	11 658,3	28 629,9	0,77	150,42	211,28	-	183 240,2	10,00
29.06.09	1 049	38 272,3	272,4	172,29	209,05	15,36	11 645,4	28 770,7	0,70	150,41	210,80	-	139 705,8	10,00
30.06.09	1 070	39 886,7	535,0	172,20	209,22	15,25	11 644,7	31 260,2	0,75	150,43	212,47	-	398 536,0	10,00
01.07.09	1 089	39 934,7	228,0	171,66	208,75	15,33	11 645,4	3 481,7	0,88	150,41	211,05	-	140 383,2	10,00
02.07.09	1 067	39 676,4	371,6	171,27	208,29	14,74	11 648,3	16 597,6	0,62	150,33	212,50	-	156 617,1	10,00
03.07.09	1 047	38 907,0	688,5	171,89	209,02	14,71	11 648,3	16 158,5	0,57	150,33	210,50	-	190 470,8	10,00
07.07.09	1 026	38 123,0	377,8	167,20	205,44	16,66	11 643,9	5 665,7	1,04	150,45	210,24	-	126 094,8	10,00
08.07.09	1 001	37 829,8	13 761,2	170,31	207,83	15,43	11 637,8	2 612,8	0,90	150,62	209,69	-	137 894,5	10,00
09.07.09	994	37 601,2	597,2	168,41	206,33	15,90	11 638,9	11 384,9	0,97	150,53	-	-	93 300,0	9,90
10.07.09	995	37 695,7	379,8	168,66	206,50	16,12	11 665,8	15 769,9	0,89	150,59	210,57	-	73 336,3	9,50
13.07.09	991	36 917,8	300,6	167,33	205,47	16,21	11 656,0	19 804,5	1,22	150,44	209,39	-	106 883,7	9,50
14.07.09	1 015	38 343,4	443,2	166,33	204,77	16,89	11 672,2	13 488,2	0,95	150,65	-	-	153 510,0	9,50
15.07.09	1 033	39 450,3	4 358,7	163,44	202,27	17,47	11 669,7	40 809,2	2,01	150,72	-	-	431 775,0	9,50
16.07.09	1 044	40 310,3	1 502,4	163,88	202,70	17,12	11 668,6	7 786,1	2,20	150,75	212,31	-	144 736,8	9,50
17.07.09	1 057	41 061,0	5 614,4	173,30	209,62	14,99	11 669,3	21 228,9	1,63	150,73	-	-	178 960,0	9,50
20.07.09	1 064	41 080,7	357,2	169,44	206,86	15,04	11 667,5	10 625,0	1,88	150,78	-	-	139 855,0	9,50
21.07.09	1 094	42 965,0	191,8	170,19	207,45	14,96	11 664,7	4 485,7	1,39	150,86	214,40	-	124 135,2	9,50
22.07.09	1 052	41 040,9	2 310,8	170,82	207,89	17,42	11 668,6	16 429,7	1,19	150,75	214,13	-	102 362,3	9,50
23.07.09	1 065	41 085,3	902,5	171,04	207,70	17,54	11 669,3	42 494,7	0,83	150,73	214,43	-	197 861,5	9,50
24.07.09	1 098	43 309,4	829,0	172,35	208,98	17,42	11 669,7	5 569,3	0,41	150,72	214,30	-	98 112,1	9,50
27.07.09	1 107	42 674,7	2 591,7	173,39	210,00	17,51	11 667,9	3 453,1	0,40	150,77	214,76	-	134 901,1	9,50
28.07.09	1 140	44 520,5	1 105,9	173,59	210,04	17,68	11 668,3	8 903,7	0,58	150,76	215,26	-	108 965,9	9,50
29.07.09	1 123	43 651,1	690,5	174,85	211,06	17,54	11 671,1	13 936,7	0,81	150,68	213,50	-	199 692,8	9,44
30.07.09	1 145	44 211,7	583,2	175,52	211,45	17,59	11 670,1	4 179,6	1,21	150,71	211,99	-	223 918,6	8,93
31.07.09	1 192	45 619,4	665,3	177,56	213,05	17,56	11 670,1	3 996,7	1,24	150,71	213,07	-	117 301,0	8,52
03.08.09	1 267	46 814,7	854,2	178,58	213,62	17,67	11 668,6	5 572,6	0,95	150,75	214,81	-	115 592,1	8,05
04.08.09	1 281	47 881,9	1 870,9	179,14	214,18	17,65	11 666,8	7 145,4	0,80	150,80	217,09	-	245 789,5	8,05
05.08.09	1 297	48 574,6	502,4	180,64	215,26	17,64	11 666,1	2 843,8	0,76	150,82	217,01	-	323 900,5	8,05
06.08.09	1 297	49 578,9	811,6	182,26	216,48	17,66	11 666,5	3 989,9	1,02	150,81	217,09	-	215 603,8	8,05
07.08.09	1 288	47 889,7	1 633,3	183,18	217,33	17,73	11 669,3	2 444,0	1,18	150,73	216,36	-	141 170,1	8,13

↓

Таблица 61 (продолжение)

Дата расчета индикатора	Рынок акций			Рынок корпоративных облигаций					Рынок репо	Рынок иностранных валют				Индикаторы депозитов
	индекс KASE	капита- лизация млн USD	объем сделок тыс. USD	индекс KASE_BC	индекс KASE_BP	индекс KASE_BY % год.	капита- лизация млн USD	объем сделок тыс. USD	индикатор TONIA % год.	средневзвешенный курс тенге к:			объем торгов тыс. USD	KazPrime-3M % год.
										1 USD тенге	1 EUR тенге	1 RUB тенге		
10.08.09	1 321	49 275,0	459,7	184,55	218,45	17,71	11 668,6	1 136,1	1,00	150,75	214,16	-	203 337,4	8,00
11.08.09	1 316	48 852,2	518,6	185,73	219,39	17,72	11 669,7	593,1	0,74	150,72	213,73	-	165 808,1	8,00
12.08.09	1 269	46 459,0	271,2	186,65	220,02	17,69	11 667,5	354,2	0,94	150,78	212,97	-	246 214,9	6,83
13.08.09	1 295	47 592,3	584,9	187,79	220,71	17,67	11 667,9	17 012,9	0,74	150,77	215,16	-	177 890,6	6,50
14.08.09	1 304	47 712,8	202,6	189,05	221,70	17,64	11 667,2	6 313,3	0,59	150,79	215,49	-	205 429,1	6,00
17.08.09	1 238	45 589,5	263,2	190,42	222,92	17,61	11 666,8	6 311,0	0,54	150,80	213,53	-	171 764,0	6,33
18.08.09	1 266	46 095,4	890,8	191,17	223,48	17,71	11 665,4	3 364,7	0,53	150,84	213,17	-	140 343,8	6,58
19.08.09	1 282	46 706,2	362,8	192,47	224,73	17,67	11 663,9	3 966,8	0,54	150,88	212,63	-	210 880,7	6,47
20.08.09	1 316	47 356,5	456,7	193,60	225,60	17,76	11 665,7	5 557,4	0,38	150,83	214,72	-	175 764,6	6,47
21.08.09	1 337	47 501,9	926,2	195,29	226,97	17,71	11 665,0	3 637,9	0,53	150,85	214,75	-	152 751,8	6,47
24.08.09	1 382	49 903,8	1 116,2	196,25	227,99	17,72	11 667,9	2 198,3	0,49	150,77	216,00	-	159 684,0	6,47
25.08.09	1 382	49 671,0	601,1	197,10	228,58	17,66	11 671,1	1 634,0	0,84	150,68	215,11	-	191 193,0	6,47
26.08.09	1 383	49 902,6	589,0	199,00	230,36	17,65	11 616,4	4 248,8	1,20	150,75	215,99	-	184 539,1	6,47
27.08.09	1 360	48 244,6	164 114,9	200,40	231,47	17,62	11 615,7	1 225,4	1,09	150,77	214,81	-	145 628,5	6,47
28.08.09	1 394	49 346,9	434,8	202,27	232,59	17,67	11 614,6	12 058,8	0,55	150,80	216,50	-	137 120,7	6,47
01.09.09	1 372	48 736,1	511,3	203,71	234,49	17,69	11 616,4	352,1	0,72	150,75	216,47	-	117 378,9	6,47
02.09.09	1 309	46 580,5	954,5	204,73	235,35	17,76	11 617,8	2 140,6	0,82	150,71	214,53	4,7280	98 631,9	6,47
03.09.09	1 331	47 942,3	550,6	200,25	230,87	18,06	11 616,0	4 049,2	1,06	150,76	215,37	-	140 199,7	6,47
04.09.09	1 366	48 321,0	847,9	201,42	232,05	18,21	11 614,3	1 493,0	0,83	150,81	215,46	4,7600	177 472,8	6,47
07.09.09	1 363	48 878,4	180,0	202,15	232,64	18,69	11 613,2	5 368,0	0,75	150,84	216,23	-	115 763,5	6,33
08.09.09	1 396	50 059,2	938,5	203,62	233,92	18,16	11 613,2	5 885,2	0,61	150,84	215,80	-	67 853,3	6,30
09.09.09	1 430	50 507,5	21 811,6	213,58	242,56	17,61	11 613,9	25 850,6	0,82	150,82	218,56	4,8650	136 956,9	6,30
10.09.09	1 455	51 364,6	2 636,9	211,52	240,80	17,84	11 612,5	3 265,5	0,78	150,86	219,86	-	130 064,2	6,30
11.09.09	1 472	51 682,1	2 219,5	211,92	241,01	17,83	11 611,4	3 034,2	0,59	150,89	220,26	-	116 473,0	6,30
14.09.09	1 421	49 867,7	507,0	213,19	242,02	17,96	11 560,3	5 967,9	0,79	150,92	219,75	-	139 022,5	6,29
15.09.09	1 452	50 649,7	827,9	215,62	244,08	17,41	11 559,3	4 959,2	0,76	150,95	220,64	-	135 690,1	6,35
16.09.09	1 500	51 519,4	1 101,3	218,24	245,84	17,00	11 612,7	11 468,0	0,78	150,94	221,85	-	84 029,5	6,35
17.09.09	1 514	52 408,2	4 854,3	219,43	246,69	17,08	11 613,8	244,4	0,67	150,91	222,66	-	93 273,0	6,29
18.09.09	1 546	51 779,8	380,5	221,38	248,16	17,06	11 613,1	8 092,5	0,48	150,93	222,22	-	173 913,8	6,29
21.09.09	1 553	51 984,2	1 439,8	222,52	249,12	17,11	11 614,9	2 749,6	0,74	150,88	221,30	-	171 008,6	6,29

↓

Таблица 61 (продолжение)

Дата расчета индикатора	Рынок акций			Рынок корпоративных облигаций					Рынок репо	Рынок иностранных валют				Индикаторы депозитов
	индекс KASE	капита- лизация млн USD	объем сделок тыс. USD	индекс KASE_BC	индекс KASE_BP	индекс KASE_BY % год.	капита- лизация млн USD	объем сделок тыс. USD	индикатор TONIA % год.	средневзвешенный курс тенге к:			объем торгов тыс. USD	KazPrime-3M % год.
										1 USD тенге	1 EUR тенге	1 RUB тенге		
22.09.09	1 568	51 938,5	3 568,9	224,83	250,79	17,11	12 310,0	115,8	0,58	150,90	222,87	-	106 666,6	6,29
23.09.09	1 589	52 892,4	994,8	226,27	251,84	17,16	12 309,1	447,3	0,55	150,92	223,72	-	78 932,4	6,29
24.09.09	1 573	52 233,5	20 862,6	227,48	252,66	17,04	12 308,7	1 470,4	0,57	150,93	222,24	-	88 888,7	6,29
25.09.09	1 507	51 191,6	13 352,8	228,93	253,82	16,97	12 307,9	5 332,7	0,45	150,95	221,78	-	114 124,2	6,29
28.09.09	1 490	49 359,3	7 182,6	231,04	255,53	16,98	12 307,9	323,9	1,60	150,95	220,86	-	109 068,7	6,29
29.09.09	1 510	50 440,6	1 425,3	231,19	255,67	17,13	12 274,8	6 446,9	0,60	150,95	220,79	-	117 706,0	6,29
30.09.09	1 513	51 160,2	1 609,0	232,32	255,91	16,50	12 274,8	15 157,0	0,50	150,95	220,76	-	198 382,5	6,30
01.10.09	1 539	51 805,7	1 722,8	233,55	256,89	16,45	12 274,8	9 128,6	0,70	150,95	220,01	-	119 269,5	6,29
02.10.09	1 481	49 457,9	1 341,4	233,51	257,28	16,45	12 221,6	4 001,5	0,90	150,97	219,84	-	143 825,1	6,29
05.10.09	1 471	49 332,3	121,6	234,99	258,63	16,52	12 220,8	179,6	0,74	150,99	221,06	-	126 219,6	6,29
06.10.09	1 505	50 788,1	13 141,1	236,48	259,68	16,47	12 221,6	5 773,3	0,83	150,97	222,53	-	100 872,0	6,29
07.10.09	1 547	51 530,8	35 236,3	242,00	264,54	16,73	12 023,1	6 728,1	0,51	150,94	221,81	-	73 884,3	6,30
08.10.09	1 552	52 926,9	959,1	242,86	265,06	16,63	12 028,7	21 629,3	0,51	150,84	222,70	-	189 382,8	6,29
09.10.09	1 528	52 506,8	1 009,6	244,24	266,12	16,60	12 032,7	3 486,5	0,55	150,74	222,10	-	217 406,7	6,29
12.10.09	1 583	53 083,0	793,3	244,88	266,93	16,66	11 951,0	923,3	0,45	150,67	221,71	-	59 435,7	6,30
13.10.09	1 595	53 578,9	676,9	245,71	267,37	16,27	11 947,7	9 967,3	0,61	150,75	222,90	-	139 419,3	6,29
14.10.09	1 620	54 750,3	566,4	246,91	268,64	16,22	11 946,0	3 314,4	0,79	150,75	224,43	-	79 163,8	6,29
15.10.09	1 648	55 907,7	872,4	248,50	270,00	16,24	17 129,8	1 788,2	0,68	150,75	225,58	-	113 963,2	6,29
16.10.09	1 663	55 756,8	841,2	250,02	271,09	16,21	17 653,2	2 756,0	0,41	150,69	225,07	-	108 973,6	6,29
19.10.09	1 659	54 639,3	4 284,4	251,45	272,14	16,12	17 595,5	583,7	0,40	150,73	224,59	-	121 910,4	6,29
20.10.09	1 693	56 608,4	539,8	253,44	273,52	16,11	17 621,5	14 229,0	0,50	150,78	225,56	-	134 733,5	6,29
21.10.09	1 679	55 525,0	21 029,5	254,22	274,16	16,12	17 622,8	23 181,9	0,46	150,76	225,50	-	81 710,3	6,29
22.10.09	1 674	55 122,7	680,4	256,16	275,70	16,10	17 631,5	4 593,8	0,55	150,64	225,89	-	156 106,5	6,29
23.10.09	1 739	57 147,4	3 422,5	258,73	277,27	16,06	18 144,0	5 104,8	0,49	150,64	226,34	-	217 832,5	6,29
26.10.09	1 723	56 369,6	677,2	259,35	277,63	16,25	18 139,4	11 463,6	0,55	150,68	226,66	-	215 228,4	6,29
27.10.09	1 700	55 470,8	2 132,3	259,97	278,50	16,09	19 914,2	41 871,4	0,51	150,71	225,06	-	189 708,2	6,29
28.10.09	1 623	54 421,7	646,8	265,43	282,27	16,06	19 914,2	15 086,4	0,53	150,71	223,47	-	155 092,4	6,29
29.10.09	1 599	53 309,7	26 833,1	266,36	282,85	16,08	19 909,4	4 790,0	0,59	150,74	222,18	-	128 663,9	6,29
30.10.09	1 681	56 096,3	54 113,2	268,42	284,40	16,19	19 893,7	22 319,7	0,36	150,74	224,01	-	250 575,2	6,29
02.11.09	1 629	53 134,8	949,7	270,86	286,33	16,08	20 091,9	349,7	0,36	150,75	222,94	5,1770	182 601,6	6,29

↓

Таблица 61 (продолжение)

Дата расчета индикатора	Рынок акций			Рынок корпоративных облигаций					Рынок репо	Рынок иностранных валют				Индикаторы депозитов
	индекс KASE	капита- лизация млн USD	объем сделок тыс. USD	индекс KASE_BC	индекс KASE_BP	индекс KASE_BY % год.	капита- лизация млн USD	объем сделок тыс. USD	индикатор TONIA % год.	средневзвешенный курс тенге к:			объем торгов тыс. USD	KazPrime-3M % год.
										1 USD тенге	1 EUR тенге	1 RUB тенге		
03.11.09	1 599	52 821,0	495,1	271,57	286,54	16,17	19 645,1	21 672,9	0,36	150,85	223,29	5,1600	204 474,0	6,29
04.11.09	1 637	53 455,6	672,0	273,99	288,53	16,15	19 648,6	4 610,2	0,30	150,81	222,70	-	117 135,3	6,29
05.11.09	1 624	53 846,4	676,2	276,40	290,45	16,16	19 568,5	27 182,6	0,26	150,82	224,28	-	155 737,2	6,29
06.11.09	1 634	53 576,2	1 762,2	277,82	291,72	16,14	19 569,4	25 006,2	0,29	150,82	224,36	-	141 587,6	6,29
09.11.09	1 665	53 911,1	839,2	279,10	292,68	16,07	19 606,4	218,9	0,16	150,90	225,74	5,2257	293 454,5	6,29
10.11.09	1 684	54 958,8	8 941,5	281,63	294,55	16,13	19 696,5	105,2	0,16	150,78	225,91	5,2475	84 388,9	6,29
11.11.09	1 716	55 293,4	1 484,4	282,57	295,21	16,13	19 743,8	101,0	0,33	150,69	225,87	-	139 571,4	6,30
12.11.09	1 720	54 907,2	1 104,3	282,75	295,80	16,19	19 900,9	1 346,4	0,49	150,43	225,54	5,2556	503 723,7	6,25
13.11.09	1 698	54 316,1	1 409,9	288,89	298,87	15,83	19 902,2	3 248,7	0,21	149,95	222,90	5,2008	483 871,8	5,48
16.11.09	1 743	55 530,9	1 854,4	291,49	300,97	15,80	20 022,6	1 469,0	0,21	149,50	223,83	5,2013	851 574,8	5,55
17.11.09	1 765	56 172,2	1 059,7	290,52	300,81	15,72	20 052,6	1 248,2	0,20	149,17	223,06	5,2012	516 313,7	5,10
18.11.09	1 807	56 308,5	969,5	288,94	300,05	15,73	20 055,3	6 767,4	0,34	149,14	222,35	5,1970	695 921,8	5,10
19.11.09	1 808	57 051,4	1 131,2	287,82	300,30	15,76	19 998,7	7 141,8	0,59	148,89	-	5,1806	330 307,4	5,00
20.11.09	1 772	55 223,5	1 510,5	286,56	300,18	15,69	19 998,0	13 623,2	0,52	148,90	221,93	5,1751	303 681,0	5,00
23.11.09	1 813	55 540,9	2 523,5	281,90	298,52	16,35	20 007,2	9 359,4	0,54	148,80	222,89	5,1634	476 519,9	4,80
24.11.09	1 805	55 544,8	1 714,4	281,16	298,30	16,31	20 016,6	1 645,4	0,46	148,75	222,41	5,1640	225 896,8	4,80
25.11.09	1 822	55 596,1	2 603 147,8	280,12	298,16	16,28	20 060,9	2 285,3	0,75	148,94	-	5,1814	186 102,0	4,70
26.11.09	1 804	55 256,8	1 748,8	280,90	299,56	16,09	20 001,8	6 873,0	0,40	148,72	224,49	5,1517	193 606,3	4,70
30.11.09	1 838	55 452,8	984,5	280,72	300,05	16,14	20 006,4	7 854,2	0,20	148,67	223,78	5,1052	112 603,8	4,60
01.12.09	1 855	58 968,9	1 046,6	280,00	299,99	16,13	19 988,9	9 466,4	0,21	148,68	223,29	5,1000	119 184,3	4,60
02.12.09	1 862	59 385,6	528,0	281,30	301,04	15,91	20 576,3	594,7	0,16	148,69	224,20	5,1101	93 515,5	4,60
03.12.09	1 870	59 060,5	901,9	277,90	299,47	16,83	20 565,4	6 276,9	0,12	148,81	224,99	5,0916	76 776,2	4,55
04.12.09	1 859	59 070,9	3 293,9	277,97	299,91	16,72	20 571,8	2 338,4	0,21	148,74	224,00	5,0970	159 656,5	4,50
07.12.09	1 835	59 061,1	1 362,9	278,11	300,97	16,60	20 553,5	290,6	0,19	148,94	220,48	5,0223	284 408,6	4,33
08.12.09	1 808	58 427,4	527,3	283,58	303,02	16,67	20 545,2	4 425,4	0,19	149,03	220,94	4,9698	182 258,8	4,04
09.12.09	1 763	56 842,8	537,1	283,08	302,81	16,68	20 541,4	32 120,7	0,27	149,08	219,64	4,8620	127 833,9	3,98
10.12.09	1 791	57 648,3	862,9	284,01	303,93	16,60	20 544,5	3 393,3	0,18	149,08	219,70	4,8900	102 135,5	3,90
11.12.09	1 801	58 000,2	2 056,7	283,09	304,04	16,27	20 571,7	5 866,0	0,74	149,27	219,55	4,9396	221 684,6	3,83
14.12.09	1 749	56 760,3	458,0	281,53	303,91	16,24	20 613,8	4 136,3	0,30	148,80	-	4,9581	237 559,8	3,63
15.12.09	1 772	56 920,0	1 551,1	286,61	305,86	16,24	20 613,8	795,2	0,29	148,80	217,90	4,9383	132 542,6	3,49

↓

Таблица 61 (продолжение)

Дата расчета индикатора	Рынок акций			Рынок корпоративных облигаций					Рынок репо	Рынок иностранных валют				Индикаторы депозитов
	индекс KASE	капита- лизация	объем сделок	индекс KASE_BC	индекс KASE_BP	индекс KASE_BY	капита- лизация	объем сделок	индикатор TONIA	средневзвешенный курс тенге к:			объем торгов	KazPrime-3M
		млн USD	тыс. USD				% год.	млн USD		тыс. USD	% год.	1 USD		
20.12.09	1 769	56 813,5	809,5	321,82	324,74	13,06	20 670,0	702,3	0,25	148,67	-	-	71 800,0	3,30
21.12.09	1 768	56 855,4	659,7	321,70	325,41	13,04	20 621,3	6 698,7	0,16	148,59	213,33	4,8569	273 397,7	3,15
22.12.09	1 752	57 154,3	638,9	320,82	325,42	13,04	20 693,1	6 580,7	0,14	148,50	212,80	4,8779	348 187,5	3,03
23.12.09	1 753	57 237,5	1 772,6	312,74	321,50	14,95	21 168,7	5 742,1	0,13	148,42	211,65	4,8660	141 249,0	3,00
24.12.09	1 735	56 805,8	421,8	311,83	321,54	13,10	21 239,0	8 832,9	0,58	148,36	212,85	4,9336	275 094,4	2,95
25.12.09	1 782	57 060,6	180 749,0	310,66	321,30	13,20	21 557,5	16 122,2	0,75	148,30	-	5,0410	154 965,0	2,83
28.12.09	1 775	56 880,5	247,1	309,86	320,72	13,22	21 460,0	12 538,1	0,22	148,44	-	5,0302	182 279,4	2,75
29.12.09	1 764	57 806,8	307,9	311,59	323,22	13,15	21 473,3	9 575,8	0,13	148,35	-	4,9876	403 279,0	2,75
30.12.09	1 744	57 006,7	948,1	311,56	323,82	13,13	21 320,5	37 062,2	0,16	148,36	214,13	4,9235	172 938,4	2,74
31.12.09	1 768	57 296,5	290,4	311,92	324,88	13,11	21 308,1	103,9	0,41	148,46	-	4,9390	20 329,8	2,71

См. раздел „Пояснения к книге фактического материала“

Таблица 62

Перечень внутренних документов KASE, утвержденных в 2009 году

- 1. Изменения и дополнения № 19 в Регламент торгов и работы Системы подтверждения**

Дата утверждения: 06 января 2009 года
Утвержден: Правлением
Дата ввода в действие: 12 января 2009 года
Комментарии: основным содержанием поправок является сдвиг начала вечерней торговой сессии по иностранным валютам с 14:00 на 11:30 ALT, то есть с 12 января 2009 года дневная и вечерняя торговые сессии по иностранным валютам начинаются в одно и то же время (в 11:30 ALT), но заканчиваются в разное: дневная торговая сессия – в 15:30 ALT, а вечерняя торговая сессия – в 17:00 ALT.
Целью указанных поправок является улучшение торгового сервиса, предоставляемого KASE участникам торгов иностранными валютами, в увязке с частными параметрами проведения торгов в части операций валютного свопа.
Кроме того, поправки носят редакционный характер.
- 2. Изменение № 22 в Листинговые правила**

Дата утверждения: 08 января 2009 года
Утвержден: Биржевым советом
Дата ввода в действие: 25 января 2009 года
Комментарии: изменение внесено в целях обеспечения соответствия Листинговых правил с Правилами осуществления деятельности организаторов торгов с ценными бумагами и иными финансовыми инструментами, утвержденными постановлением Правления АФН от 29 октября 2008 года № 170.
- 3. Изменения и дополнения № 10 в Правила осуществления операций репо**

Дата утверждения: 08 января 2009 года
Утвержден: Биржевым советом
Дата ввода в действие: 25 января 2009 года
Комментарии: поправки внесены в целях обеспечения соответствия Правил биржевой торговли ценными бумагами с Правилами осуществления деятельности организаторов торгов с ценными бумагами и иными финансовыми инструментами, утвержденными постановлением Правления АФН от 29 октября 2008 года № 170
Наиболее существенными из указанных поправок являются:
– ограничение 90 днями максимального срока операций репо, осуществляемых „прямым“ способом;
– запрещение продления срока операции репо, осуществляемой „прямым“ способом, если такое продление ведет к нарушению вышеприведенного максимального срока операции репо;
– запрещение продления срока операции репо, осуществляемой „автоматическим“ способом.
В остальной части указанные поправки носят терминологический и редакционный характер.
- 4. Изменения и дополнения № 9 в Правила биржевой торговли ценными бумагами**

Дата утверждения: 08 января 2009 года
Утвержден: Биржевым советом
Дата ввода в действие: 25 января 2009 года
Комментарии: поправки внесены в целях обеспечения соответствия Правил биржевой торговли ценными бумагами с Правилами осуществления деятельности организаторов торгов с ценными бумагами и иными финансовыми инструментами, утвержденными постановлением Правления АФН от 29 октября 2008 года № 170.
- 5. Изменения № 10 в Правила биржевой торговли ценными бумагами**

Дата утверждения: 11 февраля 2009 года
Утвержден: Биржевым советом
Дата ввода в действие: 11 марта 2009 года
Комментарии: изменения разработаны в целях приведения Правил биржевой торговли ценными бумагами в соответствие с реализованными в торговой системе KASE условиями автоматического приостановления торгов. Кроме того, указанные изменения носят редакционный характер.
- 6. Изменения и дополнения № 1 в Методику расчета показателей активности членов АО „Казахстанская фондовая биржа“**

Дата утверждения: 23 февраля 2009 года
Утвержден: Правлением

→

Таблица 62 (продолжение)

Дата ввода в действие:	23 февраля 2009 года и применены для расчета показателей активности членов KASE за 2008 год (за нижеприведенным исключением).
Комментарии:	в соответствии с поправками: 1) изменена формула расчета показателя активности на рынке иностранных валют, в том числе за счет замены показателя объема сделок на новый показатель нетто-позиции; 2) установлено, что при расчете показателя объема сделок на рынке операций репо в расчет принимается объем только исполненных сделок закрытия и относящихся только к тем операциям репо, сроки которых не продлевались; 3) установлено, что в целях исключения влияния отдельных сделок нерыночного характера KASE вправе исключить при расчете показателя активности сделки, которые по мнению KASE: – по своей сути (в том числе по уровню своих цен) не являются рыночными сделками; – заключены с целью искусственного (намеренного) завышения показателей объема сделок, количества сделок и количества торговых счетов; – заключены вследствие явных технических ошибок трейдера; 4) включен новый пункт процедурного характера, который описывает порядок осуществления установленных названной Методикой функций и полномочий KASE. Кроме того, указанные поправки носят редакционный характер.
7. Изменение № 8 в Правила ежегодного поощрения наиболее отличившихся членов биржи	
Дата утверждения:	23 февраля 2009 года
Утвержден:	Правлением
Дата ввода в действие:	23 февраля 2009 года и применено для определения членов KASE в целях их поощрения по результатам 2008 года.
Комментарии:	в соответствии с изменением устанавливается новый порядок определения членов KASE для их поощрения по номинациям „Лидер биржевого валютного рынка“, „Лидер биржевого рынка государственных ценных бумаг“, „Лидер биржевого рынка акций“, „Лидер биржевого рынка корпоративных облигаций“, „Лидер рынка операций репо“. Основным содержанием указанного изменения является усиление важности экспертного мнения при формировании списка кандидатов для их поощрения по указанным номинациям за счет исключения из этого списка членов KASE, допустивших существенные нарушения внутренних документов KASE и порядка работы с торговой системой KASE, а также членов KASE, по вине которых не были исполнены сделки, заключенные в соответствующих и смежных с ними секторах организованного финансового рынка Республики Казахстан.
8. Изменения и дополнение № 2 в Правила ежегодного поощрения листинговых компаний	
Дата утверждения:	03 марта 2009 года
Утвержден:	Правлением
Дата ввода в действие:	03 марта 2009 года и применены для определения листинговых компаний KASE в целях их поощрения по результатам 2008 года.
Комментарии:	в соответствии с поправками: 1) поощрение листинговых компаний будет производиться в их следующих группах – листинговые компании финансового сектора экономики, листинговые компании промышленного, сырьевого и энергетического секторов экономики, листинговые компании иных секторов экономики; 2) распределение листинговых компаний между секторами экономики будет осуществляться согласно классификатору Global Industry Classification Standard (GICS); 3) в каждой из вышеназванных групп будут поощряться не более двух листинговых компаний.
9. Изменения и дополнения № 23 в Листинговые правила	
Дата утверждения:	05 марта 2009 года
Утвержден:	Биржевым советом
Дата ввода в действие:	06 марта 2009 года
Комментарии:	в соответствии с указанными поправками в пункте 1 статьи 21-2 „Расчет размеров листинговых сборов“ Листинговых правил была уточнена база начисления вступительных листинговых сборов, а сама эта статья была дополнена новым пунктом, который устанавливает, что: – при одновременном включении в официальный список KASE акций нескольких наименований, выпущенных одним и тем же эмитентом, эти акции рассматриваются как ценные бумаги одного наименования;

→

Таблица 62 (продолжение)

- при одновременном включении в официальный список KASE облигаций нескольких выпусков, выпущенных в пределах одной облигационной программы, вступительный листинговый сбор начисляется от суммарной номинальной стоимости облигаций всех данных выпусков;
 - при одновременном включении в официальный список KASE облигаций нескольких выпусков, выпущенных в пределах одной облигационной программы, максимальный размер вступительного листингового сбора повышается с 4 000 до 10 000 МРП.
- Кроме того, указанные поправки носят редакционный характер.
- 10. Инструкция по предварительной проверке сделок с ценными бумагами на предмет возможности их отнесения к числу подозрительных**
- Дата утверждения: 11 марта 2009 года
Утвержден: Правлением
Дата ввода в действие: 12 марта 2009 года
Комментарии: Инструкция разработана в соответствии с:
- законом Республики Казахстан „О рынке ценных бумаг“ от 02 июля 2003 года;
 - Правилами осуществления деятельности структурного подразделения организатора торгов, осуществляющего деятельность по надзору за совершаемыми сделками в торговой системе организатора торгов, утвержденными постановлением Правления АФН от 28 ноября 2008 года № 195;
 - Правилами признания сделок, заключенных на организованном рынке ценных бумаг как совершенных в целях манипулирования, и формирования и работы комитета совета директоров фондовой биржи по вопросу признания сделок с ценными бумагами, совершенных в целях манипулирования, а также его количественный состав, утвержденными постановлением Правления АФН от 28 ноября 2008 года № 196;
 - Положением о Надзорном отделе,
- и определяет порядок предварительной проверки Биржей сделок с ценными бумагами на предмет возможности их отнесения к числу подозрительных.
- 11. Дополнения и изменения № 24 в Листинговые правила**
- Дата утверждения: 16 марта 2009 года
Утвержден: Биржевым советом
Дата ввода в действие: 22 апреля 2009 года
Комментарии: поправки внесены в целях приведения Листинговых правил в соответствие с нормами постановлений Правления АФН „О требованиях к эмитентам и их ценным бумагам, допускаемым (допущенным) к обращению на фондовой бирже, а также к отдельным категориям списка фондовой биржи“ от 26 мая 2008 года № 77 и „О требованиях к организационной структуре организатора торгов и к составу листинговой комиссии фондовой биржи, и об утверждении Правил осуществления деятельности структурного подразделения организатора торгов, осуществляющего деятельность по надзору за совершаемыми сделками в торговой системе организатора торгов“ от 28 ноября 2008 года № 195. В основном указанные поправки касаются передачи Листинговой комиссии полномочий Биржевого совета KASE по вопросам листинга, делистинга или смены категории (подкатегории) официального списка KASE, а также установления листинговых требований к ценным бумагам и их эмитентам через отсылочную норму на соответствующий нормативный правовой акт АФН.
- Кроме того, указанные поправки носят редакционный характер.
- 12. Дополнения № 10 в Спецификацию рынка автоматического репо**
- Дата утверждения: 19 марта 2009 года
Утвержден: Правлением
Дата ввода в действие: с 01 апреля 2009 года
Комментарии: поправки были разработаны во исполнение решения Биржевого совета от 05 марта 2009 года о введении системы запретов по использованию ценных бумаг в качестве предметов операций репо.
- 13. Положение о Надзорном отделе**
- Дата утверждения: 26 марта 2009 года
Утвержден: Биржевым советом
Дата ввода в действие: 21 мая 2009 года

→

Таблица 62 (продолжение)

Комментарии:	<p>Положение разработано в соответствии с:</p> <ul style="list-style-type: none"> – законом Республики Казахстан „О рынке ценных бумаг“ от 02 июля 2003 года; – законом Республики Казахстан „О пенсионном обеспечении в Республике Казахстан“ от 20 июня 1997 года; – законом Республики Казахстан „Об инвестиционных фондах“ от 07 июля 2004 года; – Правилами осуществления деятельности структурного подразделения организатора торгов, осуществляющего деятельность по надзору за совершаемыми сделками в торговой системе организатора торгов, утвержденными постановлением Правления АФН от 28 ноября 2008 года № 195; – Правилами признания сделок, заключенных на организованном рынке ценных бумаг как совершенных в целях манипулирования, и формирования и работы комитета совета директоров фондовой биржи по вопросу признания сделок с ценными бумагами, совершенных в целях манипулирования, а также его количественный состав, утвержденными постановлением Правления АФН от 28 ноября 2008 года № 196, <p>и определяет основные задачи, функции, полномочия, ответственность и порядок осуществления деятельности Надзорного отдела KASE.</p>
14. Положение об Экспертном комитете Биржевого совета	
Дата утверждения:	26 марта 2009 года
Утвержден:	Биржевым советом
Дата ввода в действие:	21 мая 2009 года
Комментарии:	<p>Положение разработано в соответствии с законом Республики Казахстан „О рынке ценных бумаг“ от 02 июля 2003 года и Правилами признания сделок, заключенных на организованном рынке ценных бумаг как совершенных в целях манипулирования, и формирования и работы комитета совета директоров фондовой биржи по вопросу признания сделок с ценными бумагами, совершенных в целях манипулирования, а также его количественный состав, утвержденными постановлением Правления АФН от 28 ноября 2008 года № 196, и определяет задачи, функции, структуру, полномочия, ответственность и порядок осуществления деятельности Экспертного комитета Биржевого совета.</p> <p>Экспертный комитет Биржевого совета KASE является комитетом совета директоров фондовой биржи по вопросу признания сделок с ценными бумагами, совершенными в целях манипулирования, обязательность создания которого установлена статьей 56 названного закона и пунктом 8 упомянутых Правил.</p>
15. Дополнения № 11 в Правила осуществления операций репо	
Дата утверждения:	26 марта 2009 года
Утвержден:	Биржевым советом
Дата ввода в действие:	01 апреля 2009 года
Комментарии:	дополнения были разработаны во исполнение решения Биржевого совета KASE от 05 марта 2009 года о введении системы запретов по использованию ценных бумаг в качестве предметов операций репо.
16. Изменение и дополнение № 2 в Методику расчета индикаторов фондового рынка	
Дата утверждения:	31 марта 2009 года
Утвержден:	Правлением
Дата ввода в действие:	01 апреля 2009 года
Комментарии:	указанными поправками описаны случаи, при которых KASE осуществляет внеочередной расчет ограничительных коэффициентов для акций, находящихся в представительском списке для расчета Индекса KASE.
17. Изменения и дополнения № 12 в Правила осуществления операций репо	
Дата утверждения:	23 апреля 2009 года
Утвержден:	Биржевым советом
Дата ввода в действие:	21 мая 2009 года
Комментарии:	<p>в соответствии с поправками:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1) KASE прекращает использовать слово „выкуп“ в отношении операций репо, в том числе с учетом того, что в законодательстве Республики Казахстан о рынке ценных бумаг и акционерных обществах данное слово применяется только в совершенно определенном контексте; 2) перечень случаев, при которых ценные бумаги любых наименований, выпущенные одним и тем же эмитентом ценных бумаг, запрещаются к использованию в качестве предметов операций репо,

→

Таблица 62 (продолжение)

	осуществляемых „прямым“ способом, дополнен случаем дефолта по выплате номинальной стоимости долговых ценных бумаг, выпущенных данным эмитентом и допущенных к обращению на KASE, по окончании срока их обращения.
18. Дополнение № 11 в Спецификацию рынка автоматического репо	
Дата утверждения:	28 апреля 2009 года
Утвержден:	Правлением
Дата ввода в действие:	21 мая 2009 года
Комментарии:	дополнение было разработано в связи с утверждением 23 апреля 2009 года Биржевым советом изменений и дополнений № 12 в Правила осуществления операций репо. В соответствии с дополнением ценные бумаги любых наименований из числа указанных в подпункте 2) пункта 2 названной Спецификации, выпущенные одним и тем же эмитентом ценных бумаг, решением Правления Биржи запрещаются к использованию в качестве предметов операций репо в случае если данный эмитент своевременно не выплатил номинальную стоимость своих долговых ценных бумаг, допущенных к обращению на KASE, по окончании срока их обращения.
19. Изменение № 20 в Регламент торгов и работы Системы подтверждения	
Дата утверждения:	22 мая 2009 года
Утвержден:	Правлением
Дата ввода в действие:	25 мая 2009 года
Комментарии:	суть изменения заключается в том, что торги, проводимые методом непрерывного встречного аукциона, переводятся в режим ожидания, во время которого они проводятся методом франкфуртских торгов, в случае совпадения или пересечения цен заявок на продажу и покупку всех акций, допущенных к обращению на Бирже, за исключением случаев, указанных в подпункте 1) пункта 3 статьи 5 Регламента. Ранее эта норма применялась только для акций, включенных в официальный список KASE.
20. Изменение и дополнение № 2 в Спецификацию статуса маркет-мейкера рубля Российской Федерации (Приложение 3–2 к Правилам деятельности маркет-мейкеров)	
Дата утверждения:	25 мая 2009 года
Утвержден:	Биржевым советом
Дата ввода в действие:	07 июля 2009 года
Комментарии:	в соответствии с поправками: 1) при наличии маркет-мейкера рубля Российской Федерации твердые котировки в торговой системе KASE в торгах рублем Российской Федерации имеет право устанавливать только маркет-мейкер; 2) при отсутствии маркет-мейкера рубля Российской Федерации члены KASE в течение торгов рублем Российской Федерации имеют право выставлять твердые котировки и заключать сделки.
21. Изменение и дополнения № 25 в Листинговые правила	
Дата утверждения:	28 мая 2009 года
Утвержден:	Биржевым советом
Дата ввода в действие:	29 мая 2009 года
Комментарии:	поправки внесены в связи с исключением терминов „резидент“ и „нерезидент“, как имеющих несколько значений в казахстанском законодательстве, и исключением ссылок на несуществующие элементы названных правил. Кроме того, они носят редакционный характер.
22. Дополнения и изменения № 13 в Правила осуществления операций репо	
Дата утверждения:	28 мая 2009 года
Утвержден:	Биржевым советом
Дата ввода в действие:	04 мая 2010 года
Комментарии:	в соответствии с поправками Правила осуществления операций репо дополнены Приложением № 1 „Соглашение об общих условиях осуществления операций репо „прямым“ способом“, которое разработано в целях снижения рисков неисполнения участниками операций репо, осуществляемых „прямым“ способом, своих обязательств по сделкам закрытия. Названное соглашение в частности определяет: – порядок расчета цены открытия операции репо, осуществляемой „прямым“ способом, суммы сделки закрытия и ставки операции репо; – новый порядок осуществления расчетов по операциям репо, осуществляемым „прямым“ способом, в том числе порядок досрочного исполнения сделки закрытия репо;

→

Таблица 62 (продолжение)

- порядок взаимодействия участников операции репо при осуществлении эмитентом ценных бумаг, являющихся предметом операции репо, корпоративных действий;
- порядок переоценки обязательств по операциям репо;
- новый порядок урегулирования ситуаций неисполнения участниками операций репо своих обязательств по сделкам закрытия.

В связи с дополнением Правил названным соглашением в текст Правил внесен ряд поправок.

В целях обеспечения соответствия с пунктом 38 Правил осуществления деятельности организаторов торгов с ценными бумагами и иными финансовыми инструментами, утвержденных постановлением Правления АФН от 29 октября 2008 года № 170, текст Правил дополнен нормой, устанавливающей, что „Ценные бумаги любых наименований решением (решениями) Правления биржи запрещаются к использованию в качестве предметов операций репо, осуществляемых „прямым“ способом, если в соответствии с внутренним документом биржи „Методика оценки ценных бумаг“ оценка данных ценных бумаг не производится в течение двух недель подряд“.

23. Изменения № 21 в Регламент торгов и работы Системы подтверждения

Дата утверждения: 29 мая 2009 года
Утвержден: Правлением
Дата ввода в действие: 01 июня 2009 года
Комментарии: в соответствии с указанными изменениями в Приложение 1 к названному Регламенту „Перечень акций и их сокращенных обозначений (торговых кодов), по отношению к торгам которыми не применяется метод франкфуртских торгов в случае совпадения или пересечения цен заявок на продажу и покупку“ будут включаться акции, по которым имеется специалист, или акции, включенные в представительский список для расчета индекса рынка акций (Индекса KASE).

24. Изменение № 22 в Регламент торгов и работы Системы подтверждения

Дата утверждения: 05 июня 2009 года
Утвержден: Правлением
Дата ввода в действие: 05 июня 2009 года
Комментарии: в соответствии с изменением привилегированные акции АО „Астана-Финанс“ (НИН – KZ1P37670117, торговый код – ASFlp) исключены из Приложения 1 к Регламенту „Перечень акций и их сокращенных обозначений (торговых кодов), по отношению к торгам которыми не применяется метод франкфуртских торгов в случае совпадения или пересечения цен заявок на продажу и покупку“. В соответствии с пунктом 5 статьи 5 Регламента торги акциями, проводимые методом непрерывного встречного аукциона, не переводятся в режим ожидания, во время которого они проводятся методом франкфуртских торгов, в случае совпадения или пересечения цен заявок на их продажу и покупку, если по акциям данного наименования имеется специалист. С 04 июня 2009 года АО „Астана-Финанс“ лишено статуса специалиста по указанным акциям в связи с отстранением его от участия в торгах ценными бумагами на KASE с указанной даты.

25. Изменения № 23 в Регламент торгов и работы Системы подтверждения

Дата утверждения: 16 июня 2009 года
Утвержден: Правлением
Дата ввода в действие: 16 июня 2009 года
Комментарии: в соответствии с изменениями торговая система KASE будет автоматически отказывать в приеме заявок, подаваемых участниками торгов иностранными валютами, если цены в этих заявках будут превышать следующие лимиты отклонения таких цен:

- по инструментам USD_TOD, USD_TOM и USD_SPT – 0,5 % от цены последней сделки (ранее данный лимит отклонения цены применялся только при торговле иностранными валютами на утренней сессии);
- по инструментам EUR_TOD и EUR_TOM – 3 % от цены последней сделки;
- для российского рубля – 3 % от цены последней сделки.

Указанные лимиты являются преодолимыми. Это означает, что любой заинтересованный участник торгов вправе обратиться к маклеру Биржи с просьбой снять или увеличить указанный лимит.

26. Дополнение № 11 в Положение о членстве

Дата утверждения: 18 июня 2009 года
Утвержден: Биржевым советом
Дата ввода в действие: 21 июля 2009 года

→

Таблица 62 (продолжение)

Комментарии:	в соответствии с дополнением установлено, что в случае допущения трейдером какого-либо члена KASE ошибки, повлекшей за собой приостановление торгов финансовыми инструментами, данный трейдер может быть отстранен от участия в торгах по решению Правления KASE.
27. Изменение и дополнение № 11 в Правила биржевой торговли ценными бумагами	
Дата утверждения:	18 июня 2009 года
Утвержден:	Биржевым советом
Дата ввода в действие:	21 июля 2009 года
Комментарии:	поправки касаются случаев возобновления ранее приостановленных торгов ценными бумагами; внесены в связи с вводом в действие с 09 июня 2009 года постановления Правления АФН „О внесении изменений и дополнений в постановление Правления Агентства Республики Казахстан по регулированию и надзору финансового рынка и финансовых организаций от 29 октября 2008 года № 170 „Об утверждении Правил осуществления деятельности организаторов торгов с ценными бумагами и иными финансовыми инструментами“ от 27 марта 2009 года № 60.
28. Изменения и дополнения № 3 в Методику расчета индикаторов фондового рынка	
Дата утверждения:	30 июня 2009 года
Утвержден:	Правлением
Дата ввода в действие:	15 июля 2009 года
Комментарии:	<p>в соответствии с поправками названная Методика дополнена новым индикатором – ценой закрытия по ценным бумагам, которая будет рассчитываться ежедневно по всем ценным бумагам, допущенным к обращению на KASE, по окончании торгового дня по ним.</p> <p>Цена закрытия по ценной бумаге какого-либо наименования рассчитывается как цена последней сделки с ценной бумагой данного наименования, заключенной в текущий торговый день при условии, что эта сделка исполнена или ожидает исполнения. Если в течение торгового дня сделок с ценной бумагой какого-либо наименования заключено не было, цена закрытия по ценной бумаге данного наименования в этот день рассчитываться не будет.</p> <p>Биржа оставляет за собой право осуществить перерасчет цены закрытия по ценной бумаге какого-либо наименования за какой-либо торговый день, если в этот торговый день цена закрытия по ценной бумаге данного наименования была рассчитана на основании цены сделки, которая в последствии не была исполнена в установленном внутренними документами KASE порядке. Срок и порядок такого перерасчета определены Методикой.</p> <p>Кроме того, поправки носят редакционный характер.</p>
29. Изменение № 24 в Регламент торгов и работы Системы подтверждения	
Дата утверждения:	10 июля 2009 года
Утвержден:	Правлением
Дата ввода в действие:	10 июля 2009 года
Комментарии:	<p>в соответствии с изменением пункт 9 статьи 10 изложен в следующей редакции:</p> <p>„9. Особенностью проведения торгов российским рублем является то, что при наличии маркет–мейкера по российскому рублю сделки с ним могут заключаться только по тем ценам, которые указаны в заявках, поданных маркет–мейкером, при отсутствии маркет–мейкера по российскому рублю члены Биржи в течение торгов российским рублем имеют право выставлять твердые котировки и заключать сделки.“</p> <p>Изменение было внесено для обеспечения соответствия названного Регламента внутреннему документу KASE „Спецификация статуса маркет–мейкера рубля Российской Федерации (Приложение 3–2 к Правилам деятельности маркет–мейкеров)“.</p>
30. Правила функционирования торговой площадки АО „Казахстанская фондовая биржа“ в качестве специальной торговой площадки регионального финансового центра города Алматы	
Дата утверждения:	30 июля 2009 года
Утвержден:	Биржевым советом
Дата ввода в действие:	09 ноября 2009 года
Комментарии:	<p>Правила разработаны в соответствии:</p> <ul style="list-style-type: none"> – с законом Республики Казахстан „О региональном финансовом центре города Алматы“ от 05 июня 2006 года;

→

Таблица 62 (продолжение)

– с приказом и.о. Председателя АРД РФЦА „Об определении акционерного общества „Казахстанская фондовая биржа“ в качестве специальной торговой площадки регионального финансового центра города Алматы“ от 15 декабря 2006 года № 74;

и определяют отдельные условия функционирования торговой площадки KASE в качестве специальной торговой площадки регионального финансового центра города Алматы, не урегулированные внутренними документами Биржи.

Правила являются одним из основных документов, регламентирующих деятельность площадки, образованной объединением действующих в настоящее время ОТП KASE и СТП РФЦА.

31. Дополнения и изменения № 8 в Методику оценки ценных бумаг

Дата утверждения: 30 июля 2009 года

Утвержден: Биржевым советом

Дата ввода в действие: 04 сентября 2009 года

Комментарии: необходимость внесения поправок вызвана:

- согласованием АФН 03 июля 2009 года дополнений и изменений № 13 в Правила осуществления операций репо, утвержденных решением Биржевого совета KASE 28 мая 2009 года;
- приведением названной Методики в соответствие с действующими нормативными правовыми актами;
- реклассификацией ГЦБ с целью оптимального применения к ним описанных в Методике алгоритмов определения рыночной цены и доходности;
- редакционными и уточняющими правками текста названной Методики.

В соответствии с поправками:

- расширен перечень целей, для которых Методикой установлен порядок оценки ценных бумаг – в целях расчета цены открытия операций репо;
- значения рыночных цен ценных бумаг, исключенных из списка ценных бумаг, которые допущены к обращению на KASE, в целях расчета цены открытия операций репо, текущей рыночной стоимости, дефицита компенсационного платежа, суммы компенсационного платежа и суммы сделки закрытия операции репо при ее досрочном исполнении при осуществлении операций репо „прямым“ способом, приравниваются к нулю;
- исключена информация о МАОКО и МЕИКАМ ввиду отсутствия их в обращении и упоминания о них в действующих Правилах выпуска, размещения, обращения, обслуживания и погашения государственных казначейских обязательств Республики Казахстан;
- в целях оценки ГЦБ разделены не на пять, как ранее, а на шесть групп; при этом все индексированные ГЦБ перенесены из второй и четвертой групп в пятую или шестую группы (в зависимости от их срока до погашения) с целью сосредоточения ценных бумаг с похожими характеристиками в одной группе для более точного описания алгоритма расчета их рыночных цен и доходности;
- установлены уровни дисконтирования индексированных ГЦБ.

32. Изменения и дополнения № 12 в Положение о членстве

Дата утверждения: 30 июля 2009 года

Утвержден: Биржевым советом

Дата ввода в действие: 04 сентября 2009 года

Комментарии: в соответствии с поправками:

- изменены условия допуска членов KASE к биржевым торгам, в частности, установлены требования к финансовому состоянию членов KASE и определено, что для получения допуска к торгам члены KASE должны соответствовать этим требованиям;
- установлено, что заключение о возможности приема компании, подавшей соответствующее заявление, в члены KASE готовится Правлением Биржи, а не членами Биржевого совета;
- введена норма, согласно которой ухудшение финансового состояния члена KASE может служить основанием для его отстранения от участия в биржевых торгах как по всем видам финансовых инструментов (операций), так и по отдельным;
- решение о допуске члена KASE к осуществлению операций репо принимается Биржевым советом, член KASE может быть допущен к осуществлению операций репо не ранее, чем через три месяца с момента его допуска к участию в торгах ценными бумагами (осуществлению обычных сделок

→

Таблица 62 (продолжение)

	купли-продажи), если Биржевой совет не установит другой срок на основании имеющейся у его членов информации о фактах нарушения данным членом Биржи платежной дисциплины либо иных сведений репутационного характера.
33. Дополнения и изменение № 14 в Правила осуществления расчетов по итогам торгов иностранными валютами	
Дата утверждения:	27 августа 2009 года
Утвержден:	Биржевым советом
Дата ввода в действие:	09 октября 2009 года
Комментарии:	поправками уточнено, что участниками биржевых торгов иностранными валютами могут быть банки или небанковские организации, являющиеся членами Биржи соответствующей категории. При этом для расчетов по итогам биржевых торгов иностранными валютами банки вправе использовать только один банковский счет, небанковские организации могут одновременно использовать несколько банковских (клиентских и собственных) счетов. Кроме того, указанными поправками установлено, что участник торгов – небанковская организация при использовании нескольких банковских счетов для зачисления казахстанских тенге, поступающих от KASE в оплату ее нетто-обязательств, обязан предоставлять KASE соответствующее распоряжение по форме Приложения 2а к названным Правилам.
34. Методика расчета индикаторов рынка иностранных валют	
Дата утверждения:	29 сентября 2009 года
Утвержден:	Правлением
Дата ввода в действие:	07 октября 2009 года
Комментарии:	Методика определяет перечень индикаторов рынка иностранных валют, рассчитываемых KASE, и порядок расчета этих индикаторов.
35. Дополнение и изменения № 25 в Регламент торгов и работы Системы подтверждения	
Дата утверждения:	29 сентября 2009 года
Утвержден:	Правлением
Дата ввода в действие:	05 октября 2009 года
Комментарии:	в соответствии с поправками статья 5 названного Регламента была дополнена пунктом 5 следующего содержания: „5. При проведении торгов методом непрерывного встречного аукциона для отдельных групп финансовых инструментов настоящим Регламентом или настройками торговой системы за несколько минут до окончания торгового дня может быть установлена возможность перевода торгов в режим их проведения методом франкфуртских торгов с целью формирования репрезентативного значения цены закрытия торгового дня (далее – аукцион закрытия). В случае проведения аукциона закрытия по отдельным группам финансовых инструментов: 1) такой аукцион осуществляется ежедневно (каждый рабочий день) за 15 минут до окончания торгового дня; 2) минимальная продолжительность аукциона закрытия составляет 13 минут, максимальная – 15 минут; 3) аукцион закрытия завершается в случайный момент времени, определенный торговой системой автоматически методом генерирования случайных чисел, с 14-й по 15-ю минуту его проведения; 4) окончание торгового дня осуществляется одновременно с окончанием аукциона закрытия; 5) заявки, поданные до начала аукциона закрытия и в ходе его проведения, могут быть аннулированы, равно как и могут быть изменены их условия.“ Кроме того, текст названного Регламента унифицирован в части описания частных примеров проведения торгов акциями, как включенными в официальный список KASE, так и допущенными к обращению в секторе „Нелистинговые ценные бумаги“.
36. Изменения № 14 в Правила осуществления операций репо	
Дата утверждения:	01 октября 2009 года
Утвержден:	Биржевым советом
Дата ввода в действие:	04 мая 2010 года
Комментарии:	поправки внесены в Приложение 1 „Соглашение об общих условиях осуществления операций репо „прямым“ способом“ к названным Правилам и уточняют распределение обязанностей, которые возникают или могут возникнуть между участниками операций репо, осуществляемых „прямым“ способом.

→

Таблица 62 (продолжение)

Указанными поправками:

- введено понятие „Двухстороннее соглашение“, которое участники операции „прямого“ репо могут заключить между собой без использования торговой системы KASE, что позволит урегулировать взаимоотношение сторон сделки при осуществлении эмитентом, ценные бумаги которого являются предметом операции репо, корпоративных действий, способных привести к возникновению дополнительных прав или обязательств у участников операции репо;
- изменены порядок перевода продавцу репо суммы выплаченного дохода по ценным бумагам, которые являются предметом операции репо, порядок определения суммы дохода, подлежащей переводу, а также порядок выплаты процентов за период просрочки по передаче такого дохода; предусмотрена возможность отказа продавца репо от получения названного дохода через выбор соответствующей опции в торговой системе KASE при заключении сделки открытия репо; участникам операции репо предоставлена возможность оговорить порядок возврата и исчисления названного дохода в Двухстороннем соглашении;
- установлено, что если на момент составления списка лиц, имеющих право на участие в общем собрании акционеров эмитента ценных бумаг, являющихся предметом операции репо, в него включен покупатель репо, то право участия в общем собрании акционеров и право голоса по предмету операции репо принадлежит покупателю репо, если иное не установлено участниками операции репо в Двухстороннем соглашении; для передачи права участия в общем собрании акционеров и права голоса по предмету операции продавцу репо в Двухстороннем соглашении должно быть установлено, что покупатель репо обязан предоставить продавцу репо доверенность на участие в общем собрании акционеров и право голоса по предмету операции репо;
- установлено, что если в течение срока операции репо эмитентом ценных бумаг, являющихся предметом данной операции репо, принимается решение об осуществлении иных корпоративных действий, которые ведут или могут привести к возникновению дополнительных прав или обязательств у кого-либо из участников этой операции репо, то порядок урегулирования данной ситуации определяется участниками операции репо в Двухстороннем соглашении; в случае невозможности такого урегулирования любой из участников данной операции репо имеет право потребовать досрочного исполнения сделок закрытия репо, предметом которых являются ценные бумаги данного эмитента.

37. Изменения № 4 в Положение о методах проведения торгов

- Дата утверждения: 01 октября 2009 года
Утвержден: Биржевым советом
Дата ввода в действие: 01 января 2010 года
Комментарии: изменения разработаны в соответствии с решением Биржевого совета от 27 августа 2009 года об изменении механизма использования метода франкфуртских торгов, согласно которому:
- 1) данный метод будет использоваться не при любой попытке заключения сделки, а в случае существенного отклонения цены предлагаемой сделки с акциями от последней цены сделки с данными акциями;
 - 2) решено предоставить участникам торгов возможность во время режима ожидания удалять заявки, поданные ими до его начала.

38. Изменения № 26 в Регламент торгов и работы Системы подтверждения

- Дата утверждения: 05 октября 2009 года
Утвержден: Правлением
Дата ввода в действие: 05 октября 2009 года
Комментарии: изменения уточняют порядок проведения на KASE аукционов закрытия.

39. Изменения и дополнение № 10 в Инструкцию о порядке кодировки членов АО „Казахстанская фондовая биржа“, финансовых инструментов и эмитентов ценных бумаг

- Дата утверждения: 16 октября 2009 года
Утвержден: Правлением
Дата ввода в действие: 16 октября 2009 года
Комментарии: поправками определен порядок присвоения кодов МАОКАМ.
Порядок выпуска, размещения, обращения, обслуживания и погашения МАОКАМ установлен постановлением Правительства Республики Казахстан „О внесении изменений и дополнений в постановление Правительства Республики Казахстан „Об утверждении Правил выпуска, размещения, обращения, обслуживания и погашения государственных казначейских обязательств Республики

→

Таблица 62 (продолжение)

Казахстан от 03 апреля 2009 года № 466“ от 01 сентября 2009 года № 295.

Кроме того, поправки носят редакционный характер.

40. Изменения № 9 в Методику оценки ценных бумаг

Дата утверждения: 29 октября 2009 года

Утвержден: Биржевым советом

Дата ввода в действие: 09 декабря 2009 года

Комментарии: необходимость внесения изменений вызвана тем, что существующая редакция Методики не позволяет однозначно трактовать случаи, когда по корпоративным облигациям какого-либо наименования отсутствует маркет-мейкер, но при этом членами Биржи регулярно подаются заявки на покупку и продажу данных ценных бумаг и заключаются сделки, которые позволяют осуществить рыночную оценку данных облигаций в соответствии с названной Методикой.

Изменениями установлено, что при определении доходности корпоративных облигаций для целей их рыночной оценки в случае отсутствия маркет-мейкера по ним будут отбираться заявки объемом не менее 2 000-кратного размера МРП каждая и сделки, заключенные на основе этих заявок, суммарным объемом не менее 2 000-кратного размера МРП. В случае наличия маркет-мейкеров, как и ранее, в качестве критерия отбора заявок или сделок будет выступать минимальный размер обязательной котировки, который был установлен для маркет-мейкеров по облигациям данного наименования на дату присвоения им такого статуса.

Кроме того, изменения носят редакционный характер.

41. Листинговые правила

Дата утверждения: 05 ноября 2009 года

Утвержден: Биржевым советом

Дата ввода в действие: 09 ноября 2009 года

Комментарии: новая редакция Листинговых правил разработана на базе действующей редакции данного документа с целью:

- нормативного обеспечения предстоящего объединения официальных списков ОТП KASE и СТП РФЦА; новая редакция Листинговых правил предусматривает единые процедуры, касающиеся листинга ценных бумаг, смены категорий (подкатегорий) официального списка, делистинга ценных бумаг, а также единые условия нахождения ценных бумаг в официальном списке и санкции за неисполнение инициаторами допуска ценных бумаг обязанностей по раскрытию информации, которые установлены Листинговыми правилами, без разделения на ОТП KASE и СТП РФЦА;
- приведения Листинговых правил в соответствие с действующим законодательством;
- обобщения практики, накопленной за время применения действующей редакции Листинговых правил, и решения наиболее часто возникающих вопросов, которые связаны с процедурой листинга;
- создания новой версии Листинговых правил, так как действующая редакция данного документа подвергалась многочисленным корректировкам, в результате чего возникла необходимость изменения структуры документа.

Листинговые правила в новой редакции являются универсальными, поскольку не содержат описания структуры официального списка и листинговых требований, установленных нормативными актами АФН и АРД РФЦА, но содержат ссылки на такие нормативные акты.

Помимо этого, в новой редакции Листинговых правил учтены ситуации, не урегулированные действующей редакцией. В частности, это касается процедур принятия решений Листинговой комиссией, условий принятия заявлений от инициаторов допуска к рассмотрению, вопросов перевода ценных бумаг из одной категории (подкатегорий) официального списка в другую, ответственности за несвоевременную уплату вступительного и первого ежегодного листинговых сборов, а также сроков открытия торгов ценными бумагами, включенными в официальный список.

42. Изменение № 2 в Методику расчета показателей активности членов АО „Казахстанская фондовая биржа“

Дата утверждения: 09 ноября 2009 года

Утвержден: Правлением

Дата ввода в действие: 09 ноября 2009 года

Комментарии: в соответствии с изменением из текста названной Методики исключена норма, на основании которой при расчете показателей активности членов KASE не учитывались сделки, заключенные на СТП РФЦА.

43. Изменение и дополнение № 27 в Регламент торгов и работы Системы подтверждения

Дата утверждения: 18 ноября 2009 года

→

Таблица 62 (продолжение)

Утвержден:	Правлением
Дата ввода в действие:	18 ноября 2009 года
Комментарии:	поправками установлен следующий размер лота при проведении торгов МАОКАМ – сумма в тенге, эквивалентная 10 долларам США (в номинальной стоимости специальных среднесрочных казначейских обязательств).
44. Изменения № 13 в Положение о членстве	
Дата утверждения:	23 ноября 2009 года
Утвержден:	Биржевым советом
Дата ввода в действие:	13 января 2010 года
Комментарии:	изменения разработаны в соответствии со Стратегией развития АО „Казахстанская фондовая биржа“ на 2007–2010 годы и во исполнение Плана основных работ биржи на 2009 год в связи с изменением системы категорий членства на Бирже. В соответствии с указанными изменениями члены Биржи подразделяются на следующие категории в зависимости от видов финансовых инструментов, в торгах которыми они имеют право принимать участие: – „член фондового рынка“ – с правом участия в торгах ценными бумагами, допущенными к обращению (торговле) на Бирже; – „член валютного рынка“ – с правом участия в биржевых торгах иностранными валютами; – „член срочного рынка“ – с правом участия в биржевых торгах производными финансовыми инструментами.
45. Изменения № 14 в Положение о членских взносах и биржевых сборах	
Дата утверждения:	23 ноября 2009 года
Утвержден:	Биржевым советом
Дата ввода в действие:	13 января 2010 года
Комментарии:	изменения разработаны в соответствии со Стратегией развития АО „Казахстанская фондовая биржа“ на 2007–2010 годы и во исполнение Плана основных работ биржи на 2009 год в связи с изменением системы категорий членства на Бирже.
46. Изменения № 1 в Правила размещения государственных казначейских обязательств Республики Казахстан	
Дата утверждения:	23 ноября 2009 года
Утвержден:	Биржевым советом
Дата ввода в действие:	13 января 2010 года
Комментарии:	изменения разработаны в соответствии со Стратегией развития АО „Казахстанская фондовая биржа“ на 2007–2010 годы и во исполнение Плана основных работ биржи на 2009 год в связи с изменением системы категорий членства на Бирже.
47. Изменение № 4 в Правила допуска ценных бумаг к обращению в секторе „Нелистинговые ценные бумаги“	
Дата утверждения:	23 ноября 2009 года
Утвержден:	Биржевым советом
Дата ввода в действие:	13 января 2010 года
Комментарии:	изменения разработаны в соответствии со Стратегией развития АО „Казахстанская фондовая биржа“ на 2007–2010 годы и во исполнение Плана основных работ биржи на 2009 год в связи с изменением системы категорий членства на Бирже.
48. Изменения № 7 в Правила допуска ценных бумаг международных финансовых организаций к обращению	
Дата утверждения:	23 ноября 2009 года
Утвержден:	Биржевым советом
Дата ввода в действие:	13 января 2010 года
Комментарии:	изменения разработаны в соответствии со Стратегией развития АО „Казахстанская фондовая биржа“ на 2007–2010 годы и во исполнение Плана основных работ биржи на 2009 год в связи с изменением системы категорий членства на Бирже.
49. Изменения и дополнение № 13 в Спецификацию статуса маркет-мейкера для членов фондового рынка (Приложение 1 к Правилам деятельности маркет-мейкеров)	
Дата утверждения:	23 ноября 2009 года
Утвержден:	Биржевым советом
Дата ввода в действие:	13 января 2010 года

→

Таблица 62 (продолжение)

- Комментарии: изменения разработаны в соответствии со Стратегией развития АО „Казахстанская фондовая биржа“ на 2007–2010 годы и во исполнение Плана основных работ биржи на 2009 год в связи с изменением системы категорий членства на Бирже.
- 50. Дополнение и изменения № 3 в Положение об ответственности за нарушение сроков расчетов по итогам торгов иностранными валютами**
- Дата утверждения: 23 ноября 2009 года
Утвержден: Биржевым советом
Дата ввода в действие: 13 января 2010 года
Комментарии: изменения разработаны в соответствии со Стратегией развития АО „Казахстанская фондовая биржа“ на 2007–2010 годы и во исполнение Плана основных работ биржи на 2009 год в связи с изменением системы категорий членства на Бирже.
- 51. Изменение № 5 в Правила биржевой торговли иностранными валютами**
- Дата утверждения: 23 ноября 2009 года
Утвержден: Биржевым советом
Дата ввода в действие: 13 января 2010 года
Комментарии: изменения разработаны в соответствии со Стратегией развития АО „Казахстанская фондовая биржа“ на 2007–2010 годы и во исполнение Плана основных работ биржи на 2009 год в связи с изменением системы категорий членства на Бирже.
- 52. Изменения № 15 в Правила осуществления расчетов по итогам торгов иностранными валютами**
- Дата утверждения: 23 ноября 2009 года
Утвержден: Биржевым советом
Дата ввода в действие: 13 января 2010 года
Комментарии: изменения разработаны в соответствии со Стратегией развития АО „Казахстанская фондовая биржа“ на 2007–2010 годы и во исполнение Плана основных работ биржи на 2009 год в связи с изменением системы категорий членства на Бирже.
- 53. Изменения № 9 в Правила биржевой торговли и расчетов по срочным контрактам**
- Дата утверждения: 23 ноября 2009 года
Утвержден: Биржевым советом
Дата ввода в действие: 13 января 2010 года
Комментарии: изменения разработаны в соответствии со Стратегией развития АО „Казахстанская фондовая биржа“ на 2007–2010 годы и во исполнение Плана основных работ биржи на 2009 год в связи с изменением системы категорий на Бирже.
- 54. Изменения № 4 в Правила биржевой торговли векселями**
- Дата утверждения: 23 ноября 2009 года
Утвержден: Биржевым советом
Дата ввода в действие: 13 января 2010 года
Комментарии: изменения разработаны в соответствии со Стратегией развития АО „Казахстанская фондовая биржа“ на 2007–2010 годы и во исполнение Плана основных работ биржи на 2009 год в связи с изменением системы категорий членства на Бирже.
- 55. Положение об условиях коммерческого предоставления биржевой информации о торгах в режиме реального времени**
- Дата утверждения: 26 ноября 2009 года
Утвержден: Биржевым советом
Дата ввода в действие: 01 января 2010 года
Комментарии: Положение разработано в целях установления единых фиксированных тарифных условий для всех распространителей биржевой информации о торгах в режиме реального времени и определяет порядок, общие условия и стоимость предоставления Биржей такой информации ее вторичным распространителям.
- 56. Изменения и дополнения № 11 в Инструкцию о порядке кодировки членов АО „Казахстанская фондовая биржа“, финансовых инструментов и эмитентов ценных бумаг**
- Дата утверждения: 01 декабря 2009 года
Утвержден: Правлением
Дата ввода в действие: 14 декабря 2009 года
Комментарии: необходимость внесения поправок была обусловлена:



Таблица 62 (продолжение)

- 1) запуском нового инструмента на биржевом рынке иностранных валют – евро с расчетами в долларах США;
- 2) запуском биржевых операций валютного свопа в отношении евро как предмета этих операций;
- 3) введением в действие внутреннего документа KASE „Правила функционирования торговой площадки АО „Казахстанская фондовая биржа“ в качестве специальной торговой площадки регионального финансового центра города Алматы“.

Указанными поправками установлено следующее:

1. Сокращенные обозначения (торговые коды) торгуемых на KASE иностранных валют, ранее состоявшие из основы кода торгуемой валюты и обозначения срока расчетов, дополнены основой кода валюты, в которой осуществляются расчеты (например, USDKZT_TOD вместо USD_TOD).
2. Изменен состав кодов операций валютного свопа, которые также дополнены основой кода иностранной валюты, в которой осуществляются расчеты по сделкам с валютой, являющейся предметом операции валютного свопа. Принципиальные изменения внесены в части обозначения сроков исполнения сделок, входящих в операции валютного свопа. Первой цифрой в коде обозначается длительность перерыва в рабочих днях между днем заключения сделок, входящих в данную операцию валютного свопа, и днем исполнения сделки с более ранним сроком осуществления расчетов; три последующие цифры обозначают число, равное длительности периода в рабочих днях между днем заключения сделок, входящих в данную операцию валютного свопа, и днем исполнения сделки с более поздним сроком осуществления расчетов (например, USDKZT_0_001 вместо USD_TOD_TOM, USDKZT_1_002 вместо USD_TOM_SPT).
3. Исключена статья 15-1 „Особенности кодировки финансовых инструментов на специальной торговой площадке регионального финансового центра города Алматы“.

Кроме того, указанные поправки носят редакционный характер.

57 Изменение и дополнение № 28 в Регламент торгов и работы Системы подтверждения

Дата утверждения: 01 декабря 2009 года

Утвержден: Правлением

Дата ввода в действие: 14 декабря 2009 года

Комментарии: указанными поправками предусмотрено следующее.

- 1) Изменен и дополнен перечень случаев применения режима ожидания при проведении биржевых торгов акциями. В частности, торги акциями будут переводиться в режим ожидания, во время которого они проводятся методом франкфуртских торгов, при совпадении или пересечении цен заявок на продажу и покупку акций, если цена предполагаемой сделки отличается от цены последней сделки с данными акциями на 10 % по ликвидным акциям и на 5 % по неликвидным акциям, либо при отсутствии сделок с данными акциями в течение 15 календарных дней и более. Списки ликвидных и неликвидных акций будут формироваться ежеквартально в соответствии с внутренним документом KASE „Методика определения показателей ликвидности ценных бумаг“.
- 2) Сокращен торговый день по неликвидным акциям. Торги неликвидными акциями будут начинаться в 15:00 и заканчиваться в 17:00 ALT.
- 3) Установлен регламент торгов по следующим новым финансовым инструментам:
 - евро с расчетами в тенге на второй рабочий день после дня заключения сделки (EURKZT_SPT);
 - евро с расчетами в долларах США в день заключения сделки (EURUSD_TOD);
 - евро с расчетами в долларах США на следующий рабочий день после дня заключения сделки (EURUSD_TOM);
 - евро с расчетами в долларах США на второй рабочий день после дня заключения сделки (EURUSD_SPT).

Кроме того, в текст названного Регламента торгов и работы Системы внесены уточняющие поправки в связи с изменением порядка кодировки иностранных валют, торгуемых на KASE, в том числе в части операций валютного свопа.

58. Методика определения показателей ликвидности ценных бумаг

Дата утверждения: 01 декабря 2009 года

Утвержден: Правлением

Дата ввода в действие: 14 декабря 2009 года

Комментарии: Методика определяет порядок расчета значений показателя ликвидности ценной бумаги какого-либо наименования из числа ценных бумаг одного вида (например, акций, корпоративных облигаций),

→

Таблица 62 (продолжение)

находящихся в списках KASE, с целью определения степени ликвидности ценной бумаги данного наименования по отношению к остальным ценным бумагам этого же вида, которые находятся в списках KASE.

Показатели ликвидности ценных бумаг будут рассчитываться на основании показателей объема и количества сделок с данными ценными бумагами, числа результативных дней, а также количества членов KASE, принимавших участие в заключении сделок с данными ценными бумагами. Названная Методика предусматривает защиту от влияния на результаты расчета особо крупных сделок нерегулярного характера, заключенных с заведомо неликвидными ценными бумагами.

Методика позволит KASE получить критерий, по которому торгуемые на KASE ценные бумаги будут разделены условно на ликвидные и неликвидные для различных целей. Решением Биржевого совета от 29 октября на KASE установлен различный регламент торгов для ликвидных и неликвидных акций, списки которых будут пересматриваться один раз в квартал.

59. Положение о Комитете по рынку иностранных валют

Дата утверждения: 24 декабря 2009 года

Утвержден: Биржевым советом

Дата ввода в действие: 09 февраля 2010 года

Комментарии: Положение разработано по поручению Биржевого совета KASE в целях повышения безопасности расчетов по сделкам с иностранными валютами и определяет основные задачи, функции, полномочия, ответственность и порядок осуществления деятельности Комитета по рынку иностранных валют.

В соответствии с Положением Комитет по рынку иностранных валют является постоянным внеструктурным органом KASE, основной задачей которого является выявление ситуаций неплатежеспособности членов валютного рынка, и, в случае необходимости, принятие решений об их переводе из режима срочной в режим предварительной поставки продаваемой и/или оплаты покупаемой иностранной валюты. Кроме того, Комитет по рынку иностранных валют призван выполнять иные задачи, связанные с торгами иностранными валютами и не отнесенные к компетенции других органов KASE.

60. Дополнение и изменения № 16 в Правила осуществления расчетов по итогам торгов иностранными валютами

Дата утверждения: 24 декабря 2009 года

Утвержден: Биржевым советом

Дата ввода в действие: 09 февраля 2010 года

Комментарии: поправки внесены в связи с утверждением Биржевым советом KASE 24 декабря 2009 года Положения о Комитете по рынку иностранных валют.

61. Положение о Листинговой комиссии

Дата утверждения: 24 декабря 2009 года

Утвержден: Биржевым советом

Дата ввода в действие: 08 февраля 2010 года

Комментарии: Положение разработано в соответствии с законодательством Республики Казахстан и определяет структуру, функции и порядок их осуществления, полномочия и обязанности Листинговой комиссии.

В соответствии с Положением Листинговая комиссия является постоянным внеструктурным органом KASE, основной задачей и основными функциями которого являются рассмотрение и принятие решений по вопросам листинга, делистинга, смены категории (подкатегории) официального списка ценных бумаг, дача согласия на включение в официальный список KASE облигаций, предполагаемых к выпуску (выпущенных) в соответствии с законодательством других, помимо Республики Казахстан, государств.

62. Изменения и дополнения № 10 в Методику оценки ценных бумаг

Дата утверждения: 24 декабря 2009 года

Утвержден: Биржевым советом

Дата ввода в действие: 08 февраля 2010 года

Комментарии: поправками, наряду с редакционными уточнениями, устанавливается право АФН самостоятельно публиковать данные о рыночных ценах ценных бумаг и/или данные, необходимые для осуществления рыночной оценки ценных бумаг, на Интернет-сайте KASE. Кроме этого, поправками снимается ответственность с KASE за достоверность и своевременность публикации данных АФН на Интернет-сайте KASE, а также определяется порядок осуществления рыночной оценки ценных бумаг, отсутствующих в списках KASE.

Итого в 2009 году Биржевым советом и Правлением KASE утверждены 9 внутренних документов KASE и 53 поправки во внутренние документы KASE.

Таблица 63

Список кодов корпоративных эмитентов, ценные бумаги которых находились в списках KASE в 2009 году

Код	Краткое наименование эмитента	Код	Краткое наименование эмитента
ABDI	АО „АБДИ Компани“	DNTL	АО „Dent-Lux“ (Дент-Люкс)
ACCT	АО „Акцепт-Терминал“	DTJL	АО „Досжан темир жолы (ДТЖ)“
AESO	ТОО „Алматыэнергосбыт“	EKGS	ТОО „Экибастузская ГРЭС-1“
AGKK	АО „Аграрная кредитная корпорация“	EKTN	АО „ЭКОТОН+“
AKFI	АО „AMF Group“	ELDS	АО „Эль-ДОС“
AKKM	ТОО „Акмола Курлыс Материалдары“	ERKA	ТОО „ZHERSU POWER“
ALBN	АО Дочерний Банк „Альфа-Банк“	EUBN	АО „Евразийский банк“
ALLZ	АО „Альтернативные Финансы“	EXBN	АО „Эксимбанк Казахстан“
ALPL	АО „Страховая компания „Алтын Полис“	GB_ENRC	EURASIAN NATURAL RESOURCES CORPORATION PLC
ALSA	АО „Алматинский Сахар“	GB_KZMS	KAZAKHMYS PLC
ALTM	АО „Алматытемір“	GG_TPL_	Tethys Petroleum Limited
ALVZ	АО „Zhansaya-Producing“	GLOT	АО „GLOTUR“ (ГЛОТУР)
AMGZ	АО „СНПС - Ақтобе мунайгаз“	GMED	АО „G-Media“
AMIN	АО „Страховая компания „Amanat Insurance“	GRNT	АО „Накопительный пенсионный фонд ГРАНТУМ“
APKI	ТОО „Корпорация „АПК-Инвест“	HSBK	АО „Народный сберегательный банк Казахстана“
ARAL	АО „Международный аэропорт Алматы“	IFDR	АО „Инвестиционный Финансовый Дом „RESMI“
ARSA	АО „Аэропорт „Сары-Арка“	IMSK	АО „Имсталькон“
ASAV	АО „АЗИЯ АВТО“	ISKE	АО „ISKE CAT COMPANY“
ASBN	АО „Альянс Банк“	JGOK	АО „Жайремский горно-обогатительный комбинат“
ASEL	АО „Азия-Электрик“	KAFI	АО „КазАгроФинанс“
ASFI	АО „Астана-Финанс“	KANT	АО „Кант“
ASFL	АО „Лизинговая компания „Астана-Финанс“	KASE	АО „Казахстанская фондовая биржа“
ASND	АО „Астана-Недвижимость“	KASS	АО „НГСК КазСтройСервис“
ASSA	АО „АЗИЯ САХАР“	KAST	АО „Холдинг КАЗЭКСПОРТАСТЫК“
ASTL	АО „ASTEL“	KATR	АО „Атамекен-Агро“
ASZS	АО „Астана Газ Сервис“	KAZI	АО „Карагадинский завод асбестоцементных изделий“
ATFB	АО „АТФБанк“	KDTS	АО „Кедентранссервис“
ATOL	АО „Kazakhstan Petrochemical Industries“	KIBN	АО „Казинвестбанк“
AZNO	АО „Актюбинский завод нефтяного оборудования“	KKAG	АО „Казахстан Кагазы“
BGST	АО „БУРЛИНГАЗСТРОЙ“	KKGB	АО „Казкоммерцбанк“
BIGR	АО „БИЛД ИНВЕСТМЕНТС ГРУПП“	KKI_	АО „НОМЕВРОКЕР“
BM_RECH	Renaissance Securities Trading Ltd.	KMGZ	АО „Национальная компания „КазМунайГаз“
BRKZ	АО „Банк Развития Казахстана“	KMSB	АО „КОМБИСНАБ“
BSUL	АО „Баян Сулу“	KMSO	АО „Страховая Компания „Коммеск-Өмір“
BTAI	АО „Дочерняя ипотечная организация акционерного общества „БТА Банк“ „БТА Ипотека“	KOND	АО „Конденсат“
BTAS	АО „БТА Банк“	KRZH	ТОО „Караганды Жарык“
BTTR	АО „Батыс транзит“	KSM2	ТОО „Комбинат строительных материалов и конструкций-2“
CACM	АО „Central Asia Cement“	KSMK	АО „РТ Холдинг“
CBH_	АО „Caspian Beverage Holding“	KY_RRF_	Russia Renaissance Fund SPC
CCBN	АО „Банк ЦентрКредит“	KZAS	АО „КОСТАНАЙСКИЕ МИНЕРАЛЫ“
CHFM	АО „Химфарм“	KZDK	АО „Казахская дистрибуционная компания“
CSBN	АО „Kaspi Bank“	KZIK	АО „Казахстанская Ипотечная Компания“
CTEC	АО „Центрально-Азиатская топливно-энергетическая компания“	KZIS	АО „Дочерняя страховая компания Народного банка Казахстана „Халык - Казахстанстрах“
DAMU	АО „Ипотечная компания „ДАМУ“	KZNH	АО „Казнефтехим“
DNBN	АО „Данабанк“		

→

Таблица 63 (продолжение)

Код	Краткое наименование эмитента
KZPC	АО „Kazakstan“ Processing centre“
KZPF	АО „Накопительный пенсионный фонд „БТА Казахстан“ дочерняя организация АО „БТА Банк“
KZTC	АО „KazTransCom“
KZTK	АО „Казахтелеком“
KZVP	АО „Казахвзрывпром“
LNAT	АО „Дочерняя организация Акционерного общества „БТА Банк“ Страховая компания „Лондон-Алматы“
LNPT	АО „Lancaster Petroleum“
LOGC	АО „ЛОГИКОМ“
MAG_	АО „MAG“
MMGZ	АО „Мангистаумунайгаз“
MREK	АО „Мангистауская распределительная электросетевая компания“
NFBN	АО „Delta Bank“
NL_ASBN	ALB Finance B.V.
NL_ATFB	ATF Capital B.V.
NL_BTAS	TuranAlem Finance B.V.
NL_HSBK	HSBK (Europe) B.V.
NL_KKGB	Kazkommerts International B.V.
NRBN	АО „Нурбанк“
OILA	TOO „Oilan Ltd.“
ORDB	АО „Корпорация „Ордабасы“
ORDK	TOO „Кредитное товарищество „ОРДА кредит“
ORNK	АО „Орнек XXI“
ORPT	АО „Оптово-розничное предприятие торговли“
PAIN	АО „Страховая компания „Пана Иншуранс“
PDEN	АО „ПАВЛОДАРЭНЕРГО“
PDES	АО „Павлодарская Распределительная Электросетевая Компания“
PNHZ	АО „Павлодарский нефтехимический завод“
PRIN	АО „Premier Страхование“
PRKR	АО „Национальная компания „Продовольственная контрактная корпорация“
RAHT	АО „Рахат“
RDGZ	АО „Разведка Добыча „КазМунайГаз“
REAL	АО „Финансовая компания „REAL-INVEST.kz“
REAM	АО „REAL ASSET MANAGEMENT“
RESC	TOO „Группа компаний „RESMI“
RGBR	АО „RG Brands“
RMXR	АО „РЭМИКС-Р“
ROSA	АО „РОСА“
RTCP	АО „РТС Деко“
SAS_	АО „С.А.С.“
SATC	АО „SAT & Company“
SHMO	АО „Шымкент Мунай онімдері“
SHUK	АО „Шубарколь комир“
SKKZ	АО „Фонд национального благосостояния „Самрук-Казына“
SKYS	АО „SKY SILK“

Код	Краткое наименование эмитента
SNBN	АО „СЕНИМ-БАНК“
SUMB	АО „Сумбе“
SVMH	TOO „Связьмонтаж Холдинг“
TEBN	Дочерняя организация Акционерного общества „БТА Банк“ -АО „Темірбанк“
TEMA	TOO „ТЕМА Ко.“
TKUD	АО „Горно-обогатительный комбинат „Торт-Кудык“
TMLZ	АО „Темірлизинг“
TSAS	TOO „Концерн „Цесна-Астык“
TSBN	АО „Цеснабанк“
TSNA	АО „Корпорация „Цесна“
TSSM	АО „Трансстроймост“
TXBN	Дочерний Банк АО „Сбербанк России“
UKAZ	АО „Усть-Каменогорский арматурный завод“
UKPF	АО „Усть-Каменогорская птицефабрика“
ULBA	АО „Ульбинский металлургический завод“
UPDK	АО „Управление по обслуживанию дипломатического корпуса“
US_JPM_	JPMorgan Chase Bank, National Association
US_MER_	Merrill Lynch & Co., Inc
UTMK	АО „Усть-Каменогорский титано-магниевого комбинат“
VITA	АО „VITA“
VMZV	АО „Востокмашзавод“
VSTN	АО „Акционерный инвестиционный фонд недвижимости „Великая Стена“
ZERD	АО „Kazcat“
ZNGR	АО „Казахский Республиканский Торговый Дом „ЗАНГАР“

См. раздел „Пояснения к книге фактического материала“

Пояснения к книге фактического материала

Общая часть

К настоящей Книге фактического материала применимы следующие определения (если отдельным пояснением не установлено иное):

средневзвешенный курс доллара США – индикатор биржевого рынка иностранных валют (USD/KZT), условия расчета и порядок действия которого установлены внутренним документом KASE „Методика расчета индикаторов рынка иностранных валют“ (http://www.kase.kz/files/normative_base/ind_currency.pdf);

объем торгов – суммарный объем сделок в каком-либо секторе или секторах рынка, при этом объем торгов на рынках операций репо и валютного свопа исчисляется по сделкам открытия таких операций;

биржевой оборот – суммарный объем сделок в каком-либо секторе или секторах рынка, при этом по рынкам операций репо и валютного свопа учитываются сделки открытия и сделки закрытия таких операций.

Если отдельным пояснением не установлено иное, эквивалент объема торгов и биржевого оборота в различных секторах биржевого рынка в долларах США вычислен по средневзвешенному курсу тенге к доллару США, сложившемуся на утренней сессии KASE в день заключения каждой из сделок, входящих в расчет указанных показателей.

Акции и акционеры

Таблица 1. Список акционеров KASE по состоянию на 01 января 2010 года

Галочкой помечены юридические лица, ставшие акционерами KASE в 2009 году.

На 01 января 2010 года у Биржи зарегистрировано 5,0 млн объявленных акций, из которых размещено 457 907 акций.

Статистическая характеристика биржевого финансового рынка Казахстана в 2009 году

Таблица 6. Динамика структуры биржевого рынка за последние 10 лет (млрд USD) и удельный вес объема биржевых торгов в ВВП Казахстана

В итоговой строке приводится отношение суммарного объема торгов за указанные годы к ВВП Казахстана. Данные о биржевом обороте приводятся в справочных целях, а также для сопоставления с отчетами KASE за 2000–2007 годы, в которых публиковался только биржевой оборот.

Таблица 8. Структура объема биржевых торгов в 2009 году (млн USD, %)

В объеме торгов вторичного рынка долевых ценных бумаг и долговых корпоративных ценных бумаг теоретически может присутствовать объем сделок по размещению ценных бумаг эмитентами, если такие сделки были заключены на KASE в секторе купли-продажи и не регистрировались участниками торгов как сделки первичного рынка.

В таблице приводятся данные по объему торгов. Это значит, что операции репо и валютного свопа учитываются только по сделкам открытия.

Рынок долевых ценных бумаг

В заголовке и далее в настоящем разделе под долевыми ценными бумагами подразумеваются ценные бумаги, находившиеся на указанные в таблицах или на рисунках даты и/или в указанных в таблицах или на рисунках периоды в секторах „акции“ и „ценные бумаги инвестиционных фондов“ официального списка KASE, а также допущенные к обращению в секторе „Нелистинговые ценные бумаги“; если отдельным пояснением не указано иное.

Таблица 9. Список KASE на 01 января 2009 года

Последняя цена каждого из приведенных в таблице долевых инструментов представляет собой средневзвешенную цену, рассчитанную по сделкам, заключенным в торговой системе Биржи с данным

инструментом в течение последнего (до указанной в заголовке таблицы даты) результативного для данного инструмента торгового дня.

Рыночная капитализация эмитента на KASE рассчитана в тенге в соответствии с пунктом 4 статьи 3 внутреннего документа KASE „Методика расчета индикаторов фондового рынка“ (http://www.kase.kz/files/normative_base/indicators_met.pdf). Полученные значения переведены в доллары США в соответствии с подпунктом 1) пункта 5 статьи 3 того же внутреннего документа KASE. При этом если в официальный список KASE были включены только привилегированные акции какого-либо эмитента, рыночная капитализация такого эмитента на KASE не рассчитывалась.

Показатель рыночной капитализации эмитента публикуется в таблице в строке инструмента, отвечающего простым акциям данного эмитента.

Таблица 10. Изменения в списке KASE в 2009 году

Под новым эмитентом подразумевается компания, долевые ценные бумаги которой ранее никогда не находились в официальном списке KASE, под первым листингом – листинг долевых ценных бумаг эмитента, который до этого никогда не являлся листинговой компанией KASE.

Таблица 11. Динамика структуры списка KASE в 2009 году (на 01 января 2010 года, изменение за год)

Поскольку в 2009 году произошло объединение СТП РФЦА и ОТП KASE, а также, принимая во внимание тот факт, что листинговые требования к ценным бумагам, находящимся в официальных списках СТП РФЦА и ОТП KASE, и их эмитентам фактически были унифицированы в 2008 году (см. раздел Объединение торговых площадок на основе новых листинговых требований), тренды в таблице были рассчитаны на основании суммарных данных по СТП РФЦА и ОТП KASE на 01 января 2009 года.

Таблица 12. Отраслевая структура списка KASE (акции по рыночной стоимости)

Для составления таблицы использовался отраслевой классификатор MSCI Barra и Standard & Poor's „Global Industry Classification Standard“ (GICS®). Компании, ценные бумаги которых находились в секторе „акции“ официального списка KASE на указанные в таблице даты, были отнесены к тому или иному сектору экономики в соответствии с критериями упомянутого выше классификатора.

Для каждого сектора экономики была вычислена суммарная рыночная стоимость всех размещенных (за минусом выкупленных эмитентом) акций тех компаний, которые были отнесены к данному сектору. Вычисления производились в тенге в соответствии с пунктом 4 статьи 3 внутреннего документа KASE „Методика расчета индикаторов фондового рынка“ (http://www.kase.kz/files/normative_base/indicators_met.pdf). Полученные значения были переведены в доллары США в соответствии с подпунктом 1) пункта 5 статьи 3 того же внутреннего документа KASE.

Поскольку в 2009 году произошло объединение СТП РФЦА и ОТП KASE, а также, принимая во внимание тот факт, что листинговые требования к ценным бумагам, находящимся в официальных списках СТП РФЦА и ОТП KASE, и их эмитентам фактически были унифицированы в 2008 году (см. раздел Объединение торговых площадок на основе новых листинговых требований), в таблице по состоянию на 01 января 2009 года приведены суммарные данные СТП РФЦА и ОТП KASE.

Таблица 13. Объем торгов долевыми ценными бумагами на KASE в 2009 году (по месяцам, кварталам и секторам)

„Спецторги по размещению“ представляют из себя IPO – размещение в торговой системе KASE акций листинговых компаний для неограниченного круга лиц методом специализированных торгов. „Прочие спецторги“ включают исполненные сделки вторичного рынка, заключенные в торговой системе KASE методом специализированных торгов. В колонках „регламентные торги“ приводится суммарный объем исполненных сделок, которые были заключены в ТС KASE методом непрерывного встречного аукциона, а также методом заключения прямых сделок.

Таблица 14. Распределение объема сделок купли-продажи долевых ценных бумаг по категориям списка KASE в 2009 году

При составлении таблицы не учитывались сделки, заключенные в рамках проведенных биржей специализированных торгов.

Таблица 15. Сравнительные статистические данные по рынку долевых ценных бумаг KASE в 2009 и 2008 годах

В разделе таблицы „Рыночные сделки“ приводятся данные по исполненным сделкам, которые были

заключены на KASE в секторе купли-продажи (за исключением сделок, заключенных в рамках специализированных торгов по продаже, размещению или выкупу ценных бумаг) методом непрерывного встречного аукциона. Указанный сектор обычно используется для торговли на вторичном рынке. Однако здесь могут заключаться и сделки по размещению ценных бумаг эмитентами. Если такие сделки не регистрировались участниками торгов как сделки первичного рынка, Биржа не может выделить их в отдельную статистическую группу.

В разделе таблицы „Прямые сделки“ приводятся данные по исполненным сделкам, которые были заключены на KASE в секторе купли-продажи методом заключения прямых сделок. Указанный сектор обычно используется для торговли на вторичном рынке. Однако здесь могут заключаться и сделки по размещению ценных бумаг эмитентами. Если такие сделки не регистрировались участниками торгов как сделки первичного рынка, Биржа не может выделить их в отдельную статистическую группу.

В разделе таблицы „Специализированные торги“ приводятся данные по исполненным сделкам, которые были заключены в рамках специализированных торгов, проведенных на KASE.

Рисунок 3. Объем и доля отдельных видов биржевых сделок с долевыми ценными бумагами в секторе купли-продажи в 2009 году

Приведены данные по исполненным сделкам без учета сделок, заключенных в рамках проведенных KASE специализированных торгов по продаже, размещению или выкупу ценных бумаг.

Таблица 16. Отраслевая структура объема торгов акциями на KASE в 2009 и 2008 годах

Для составления таблицы использовался отраслевой классификатор MSCI Barra и Standard & Poor's „Global Industry Classification Standard“ (GICS®).

Таблица составлена на основании суммарного объема исполненных сделок купли-продажи акций, заключенных в TC KASE за соответствующие периоды (без учета сделок, заключенных в рамках специализированных торгов).

Сортировка в таблице выполнена по значению доли отрасли в объеме торгов акциями за 2009 год. В качестве справочной информации в таблице приведена отраслевая структура официального списка KASE по состоянию на 01 января 2010 года.

Таблица 18. Десять самых ликвидных акций на вторичном рынке KASE в 2009 году

Для составления таблицы использовано значение показателя ликвидности (Kl), который рассчитан в соответствии с внутренним документом KASE „Методика определения показателей ликвидности ценных бумаг“ (http://www.kase.kz/files/normative_base/metodika_liquid.pdf) для акции каждого наименования за указанный в заголовке таблицы период.

Сортировка в таблице выполнена по убыванию значения Kl (чем выше Kl, тем выше ликвидность и, соответственно, более высокая позиция в таблице).

Таблица 19. Брутто-оборот торгов акциями на KASE в 2009 и 2008 годах в разрезе основных категорий инвесторов

Приведенные в таблице значения рассчитаны по объему исполненных сделок купли-продажи акций, включая сделки, заключенные на специализированных торгах по продаже, размещению или выкупу акций. При этом из расчета исключена позиция единственного продавца (или покупателя)³⁴ акций на специализированных торгах.

Таблица 20. Рэнкинг десяти наиболее активных операторов биржевого вторичного рынка акций в 2009 году

Рэнкинг составлен согласно внутреннему документу KASE „Методика расчета показателей активности членов АО „Казахстанская фондовая биржа““ (http://www.kase.kz/files/normative_base/members_activity.pdf).

Таблица 21. Представительский список Индекса KASE по состоянию на 01 января 2010 года

Free-float – доля акций данного наименования, находящихся в свободном обращении на указанную в заголовке таблицы дату, которая рассчитывается в соответствии с пунктом 7 статьи 5 внутреннего документа KASE „Методика расчета индикаторов фондового рынка“ (http://www.kase.kz/files/normative_base/indicators_met.pdf).

³⁴ Термин используется в трактовке пункта 1 статьи 9 внутреннего документа KASE „Положение о методах проведения торгов“ (http://www.kase.kz/files/normative_base/methods.pdf).

Стоимость free-float – суммарная рыночная стоимость акций данного наименования, находящихся в свободном обращении на указанную в заголовке таблицы дату. Показатель выражен в долларах США по средневзвешенному биржевому курсу тенге к доллару, действовавшему на ту же дату.

Доля в стоимости акций – доля суммарной рыночной стоимости акций данного наименования в суммарной рыночной стоимости акций всех наименований, находящихся в представительском списке Индекса KASE, которая при необходимости ограничена ограничительным коэффициентом (статья 8 внутреннего документа KASE „Методика расчета индикаторов фондового рынка“).

Таблица 23. Некоторые характеристики акций, входивших в представительский список Индекса KASE по состоянию на 01 января 2010 года

Изменение цены за год – выраженная в процентах разница между средневзвешенными ценами, сложившимися в последний результативный торговый день 2009 и 2008 годов для акций каждого из указанных в таблице наименований.

Показатель оборачиваемости для free-float отражает длительность периода в днях, в течение которого объем сделок с акциями указанного наименования на KASE мог сравняться с объемом акций этого наименования, находящихся в свободном обращении. Чем ниже показатель, тем выше оборачиваемость.

Показатель оборачиваемости для инвестиций в \$1 млн отражает количество рабочих дней, которое в среднем потребовалось бы инвестору для приобретения акций указанного наименования на сумму эквивалента 1 млн долларов США. Показатель рассчитывается как отношение 1 000 к среднему объему торгов за день в тыс. USD.

Таблица 24. Ценовые мультипликаторы Индекса KASE и его компонентов по состоянию на 01 января 2010 года

Price to Earnings (PE) – отношение рыночной цены акции данного наименования к величине чистой прибыли ее эмитента, которая приходится на одну акцию.

Price to Book (PB) – отношение рыночной цены акции данного наименования к ее балансовой стоимости.

Price to Sales (PS) – отношение рыночной цены акции к объему продаж ее эмитента, который приходится на одну акцию.

Для получения указанных ценовых мультипликаторов использовалась последняя доступная KASE на дату подготовки настоящего отчета финансовая отчетность эмитентов акций. При расчете PE и PS использовались данные по последнему двенадцатимесячному периоду, предшествовавшему дате, на которую была составлена последняя доступная Бирже финансовая отчетность.

Рисунок 7. Изменение отраслевой структуры представительского списка Индекса KASE в 2009 году

При составлении графика использовался отраслевой классификатор MSCI Barra и Standard & Poor's „Global Industry Classification Standard“ (GICS®).

Компании, акции которых находились в представительском списке Индекса KASE на указанные даты, были отнесены к тому или иному сектору экономики в соответствии с критериями упомянутого выше классификатора. Затем на эти же даты в каждом секторе была вычислена суммарная рыночная стоимость всех находящихся в свободном обращении акций, эмитенты которых были отнесены к данному сектору.

Суммарная рыночная стоимость акций определялась с учетом ограничительного коэффициента в соответствии с пунктом 4 статьи 5 внутреннего документа KASE „Методика расчета индикаторов фондового рынка“ (http://www.kase.kz/files/normative_base/indicators_met.pdf).

Рисунок 8. Динамика пятидневной скользящей средней показателя Price to Book семи наиболее ликвидных простых акций в 2009 году

При расчете показателя Price to Book использовалась имеющаяся на KASE финансовая отчетность эмитентов акций, которая была наиболее актуальной на даты заключения сделок. При этом предпочтение отдавалось аудированной финансовой отчетности.

Рынок корпоративных долговых ценных бумаг

Таблица 25. Официальный список KASE на 01 января 2010 года

Количество размещенных облигаций каждого наименования Биржа определила на основании информации, предоставленной эмитентами или инициаторами допуска ценных бумаг, о размещении облигаций данного наименования или выплате купонов по ним.

Для расчета суммарной номинальной стоимости размещенных облигаций в миллионах тенге номинал облигаций, валютой выпуска которых является доллар США, пересчитан в казахстанские тенге по средневзвешенному курсу тенге к доллару США, сложившемуся на утренней (основной) сессии 31 декабря 2009 года; номинал облигаций, валютой выпуска которых являются иные, помимо тенге и доллара США, валюты пересчитан в казахстанские тенге по курсу соответствующей валюты к тенге, установленному Национальным Банком на 31 декабря 2009 года.

Суммарная рыночная стоимость размещенных облигаций каждого наименования представляет собой произведение их суммарной номинальной стоимости и „чистой“ цены последней (по состоянию на 01 января 2010 года) исполненной сделки с облигациями данного наименования.

Эквивалент указанного в предыдущем абзаце показателя в долларах США вычислен по средневзвешенному курсу тенге к доллару США, сложившемуся на утренней (основной) сессии KASE 31 декабря 2009 года.

Таблица 26. Изменения в списках KASE в 2009 году

Под новым эмитентом подразумевается компания, долговые ценные бумаги которой ранее никогда не находились в официальном списке KASE, под первым листингом – листинг долговых ценных бумаг эмитента, который до этого никогда не являлся листинговой компанией KASE.

Кроме прочего, таблица содержит информацию о делистинге облигаций, который связан с истечением срока их обращения.

Таблица 27. Динамика структуры официального списка KASE в 2009 году (на 01 января 2010 года, изменение за год)

При расчете трендов учитывалось реальное количество ценных бумаг и эмитентов, находившихся в соответствующих категориях (подкатегориях) списков СТП РФЦА и ОТП KASE по состоянию на 01 января 2009 года.

Тренды по долговым обязательствам буферной категории рассчитать невозможно, поскольку данная категория отсутствовала в структуре списков СТП РФЦА и ОТП KASE по состоянию на 01 января 2009 года.

Таблица 28. Отраслевая структура официального списка KASE

Для составления таблицы использовался отраслевой классификатор MSCI Barra и Standard & Poor's „Global Industry Classification Standard“ (GICS®). Компании, долговые ценные бумаги которых находились в официальном списке KASE на указанные в таблице даты, были отнесены к тому или иному сектору экономики в соответствии с критериями этого классификатора.

На указанные в таблице даты была вычислена рыночная капитализация каждого из названных выше секторов в соответствии с внутренним документом Биржи „Методика расчета индикаторов фондового рынка“.

Вычисления производились в тенге, полученные значения были переведены в доллары США по средневзвешенному курсу доллара США к тенге, действовавшему на указанные в таблице даты.

Поскольку в 2009 году произошло объединение СТП РФЦА и ОТП KASE (см. раздел Объединение торговых площадок на основе новых листинговых требований), в таблице по состоянию на 01 января 2009 года приведены суммарные данные СТП РФЦА и ОТП KASE.

Таблица 29. Объем торгов корпоративными долговыми ценными бумагами на KASE в 2009 году (по месяцам, кварталам и секторам)

В колонках „купля-продажа“ приводится суммарный объем исполненных сделок, которые были заключены: методом непрерывного встречного аукциона на вторичном и первичном (такая возможность не исключается) рынке; методом прямых сделок (в основном на вторичном рынке, однако и здесь не исключено размещение ценных бумаг или выкуп их эмитентом); методом специализированных торгов на вторичном рынке.

Таблица 30. Отраслевая структура объема торгов корпоративными долговыми ценными бумагами на KASE в 2009 и 2008 годах

Для составления таблицы использовался отраслевой классификатор MSCI Barra и Standard & Poor's „Global Industry Classification Standard“ (GICS®).

Для составления таблицы компании, долговые обязательства которых находились в официальном списке KASE в указанные в таблице периоды, были отнесены к тому или иному сектору экономики в соответствии с критериями упомянутого выше классификатора. Затем за указанные в таблице периоды в каждом секторе был вычислен объем торгов названными ценными бумагами тех компаний, которые были отнесены к данному сектору. Сделки, заключенные в рамках специализированных торгов по размещению ценных бумаг при этом не учитывались.

Вычисления производились в тенге, полученные значения были переведены в доллары США по средневзвешенному курсу тенге к доллару США, сложившемуся на утренних (основных) торгах иностранной валютой в дни заключения соответствующих сделок.

Сортировка в таблице выполнена по значению доли отрасли в объеме торгов корпоративными долговыми ценными бумагами за 2009 год. В качестве справочной информации в таблице приведена отраслевая структура официального списка KASE по состоянию на 01 января 2010 года.

Таблица 31. Сравнительные статистические данные по рынку корпоративных долговых ценных бумаг KASE в 2009 и 2008 годах

В разделе таблицы „Рыночные сделки“ приводятся данные по исполненным сделкам, которые были заключены на KASE в секторе купли-продажи методом непрерывного встречного аукциона. Указанный сектор обычно используется для торговли на вторичном рынке. Однако здесь могут заключаться и сделки по размещению ценных бумаг эмитентами. Если такие сделки не регистрировались участниками торгов как сделки первичного рынка, Биржа не может выделить их в отдельную статистическую группу.

В разделе таблицы „Прямые сделки“ приводятся данные по исполненным сделкам, которые были заключены на KASE в секторе купли-продажи методом прямых сделок. Указанный сектор обычно используется для торговли на вторичном рынке. Однако здесь могут заключаться и сделки по размещению ценных бумаг эмитентами. Если такие сделки не регистрировались участниками торгов как сделки первичного рынка, Биржа не может выделить их в отдельную статистическую группу.

Таблица 32. Распределение объема биржевых сделок купли-продажи корпоративных долговых ценных бумаг по категориям официального списка в 2009 году

При составлении таблицы учитывалась диспозиция корпоративных долговых ценных бумаг в списках KASE по состоянию на дату заключения каждой сделки.

Таблица 33. Брутто-оборот торгов корпоративными долговыми ценными бумагами на KASE в 2009 и 2008 годах в разрезе основных категорий инвесторов

Приведенные в таблице значения рассчитаны по брутто-обороту (объем покупки + объем продажи) исполненных сделок купли-продажи корпоративных долговых ценных бумаг, включая сделки, заключенные на специализированных торгах по их размещению или выкупу. При этом из расчета исключена позиция единственного продавца (или покупателя)³⁵ корпоративных долговых обязательств на специализированных торгах.

Таблица 34. Рэнкинг десяти наиболее активных операторов биржевого вторичного рынка корпоративных облигаций в 2009 году

Рэнкинг активности составлен согласно внутреннему документу KASE „Методика расчета показателей активности членов АО „Казахстанская фондовая биржа““ (http://www.kase.kz/files/normative_base/members_activity.pdf).

Рынок государственных ценных бумаг

Таблица 35. Объем торгов ГЦБ на KASE в 2009 году (по месяцам, кварталам и секторам)

Здесь и далее в этой главе под ГЦБ понимаются следующие государственные ценные бумаги (если

³⁵ Термин используется в трактовке пункта 1 статьи 9 внутреннего документа KASE „Положение о методах проведения торгов“ (http://www.kase.kz/files/normative_base/methods.pdf).

в материалах не указано иное): облигации Министерства финансов Республики Казахстан, в том числе выпущенные в соответствии с законодательством других государств; ноты Национального Банка Республики Казахстан; облигации местных исполнительных органов Республики Казахстан (муниципальные облигации); иностранные государственные ценные бумаги.

Следует отметить, что в 2009 году в списках KASE отсутствовали муниципальные облигации и иностранные государственные ценные бумаги.

Рисунок 12. Динамика госдолга Казахстана, выпущенного в виде ГЦБ, за 2000–2009 годы

Эквивалент в долларах США объема госдолга, деноминированного в тенге, рассчитан по курсу Национального Банка на конец каждого из приведенных на графике периодов.

На графике учитывается номинальная стоимость долга без стоимости его обслуживания.

При построении графика учитывались базы данных KASE, выверенные по данным ЦД. Приведенная на графике информация не является официальной статистикой. Тем не менее, Биржа предприняла все возможные действия для отображения максимально достоверной и независимой от официальных источников информации.

Таблица 37. Результаты размещения ГЦБ Министерства финансов Казахстана на KASE в 2009 году

Под доходностью понимается доходность облигаций к погашению для покупателя.

Помеченные звездочкой значения представляют собой прогнозную доходность к погашению, рассчитанную по уровню инфляции, известному на момент проведения торгов.

Данные в таблице отсортированы по торговым кодам ценных бумаг на KASE в алфавитном порядке.

Таблица 39. Структура объема сделок вторичного биржевого рынка казахстанских ГЦБ в 2009 году

В таблице учтен объем исполненных сделок, заключенных с указанными в таблице облигациями в секторе вторичного рынка KASE.

„X“ – облигации этого типа отсутствовали в обращении.

Таблица 41. Рэнкинг десяти наиболее активных операторов биржевого вторичного рынка ГЦБ в 2009 году

Рэнкинг активности составлен согласно внутреннему документу KASE „Методика расчета показателей активности членов АО „Казахстанская фондовая биржа“ (http://www.kase.kz/files/normative_base/members_activity.pdf).

Рынок операций репо

Таблица 49. Участники биржевого рынка репо в 2009 и 2008 годах

Таблица составлена без учета позиции Национального Банка.

Таблица 50. Рэнкинг десяти наиболее активных операторов рынка репо на KASE в 2009 году

Рэнкинг активности составлен согласно внутреннему документу KASE „Методика расчета показателей активности членов АО „Казахстанская фондовая биржа“ (http://www.kase.kz/files/normative_base/members_activity.pdf).

Рынок иностранных валют

Таблица 53. Сравнительные статистические данные по рынку USD/KZT на KASE в 2009 и 2008 годах

Таблица составлена с учетом операций валютного свопа, которые проводились в отношении доллара США как предмета таких операций.

Таблица 56. Структура рынка иностранных валют KASE в 2009 и 2008 годах в разрезе инструментов

Помимо инструментов, указанных в таблице, для торговли на KASE с 14 декабря 2009 года был доступен инструмент EURUSD_SPT, однако в 2009 году сделок с ним на KASE заключено не было. Операции валютного свопа в отношении евро, как предмета таких операций, в 2009 году на KASE также не проводились.

„н/т“ – в 2008 году соответствующие инструменты на KASE не торговались.

Таблица 57. Рэнкинг десяти наиболее активных операторов рынка иностранных валют на KASE в 2009 году

Рэнкинг активности составлен согласно внутреннему документу KASE „Методика расчета показателей активности членов АО „Казахстанская фондовая биржа“ (http://www.kase.kz/files/normative_base/members_activity.pdf).

Справочная информация

Таблица 59. Основные листинговые требования KASE

При листинге облигаций, выпущенных специальным предприятием под гарантию его единственного учредителя (участника), листинговые требования применяются не к эмитенту данных облигаций, а к такому гаранту.

При листинге депозитарных расписок, базовым активом которых являются акции, выпущенные в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств, листинговые требования применяются по отношению к данному базовому активу и его эмитенту.

Для производных ценных бумаг листинговые требования устанавливаются правилами фондовой биржи, согласованными с АФН и АРД РФЦА.

Для инфраструктурных и секьюритизированных облигаций, ценных бумаг инвестиционных (в том числе индексных) фондов и международных финансовых организаций, иностранных государственных ценных бумаг, а также для применения упрощенной процедуры листинга ценных бумаг, приказом Председателя АРД РФЦА „Об установлении требований к эмитентам, чьи ценные бумаги предполагаются к включению или включены в список специальной торговой площадки регионального финансового центра города Алматы, а также к таким ценным бумагам“ от 08 мая 2008 года № 04.2-09/119 и постановлением Правления АФН „О требованиях к эмитентам и их ценным бумагам, допускаемым (допущенным) к обращению на фондовой бирже, а также к отдельным категориям списка фондовой биржи“ от 26 мая 2008 года № 77 установлены отдельные листинговые требования.

Таблица 60. Компании, допустившие дефолты по своим долговым ценным бумагам в 2009 году

В таблице приводятся данные только по тем компаниям, ценные бумаги которых находились в официальном списке KASE на момент наступления дефолта по их ценным бумагам. Объем рассчитан Биржей на основе последней доступной KASE информации о количестве размещенных облигаций.

Таблица 61. Динамика основных индикаторов рынка KASE в 2009 году

Показатели капитализации рынков и фондовые индексы рассчитаны в соответствии с внутренним документом KASE „Методика расчета индикаторов фондового рынка“. В объеме сделок с ценными бумагами учитываются только исполненные сделки, заключенные в секторе купли-продажи методом непрерывного встречного аукциона. По иностранным валютам приводится средневзвешенный курс по итогам сессии, которая является основной для указанной валюты; в качестве объема торгов приводится полный объем торгов за день на всех сессиях всеми валютными инструментами, включая операции валютного свопа по сделкам открытия.

Таблица 63. Список кодов корпоративных эмитентов, ценные бумаги которых находились в списках KASE в 2009 году

Инструкция о порядке кодировки членов АО „Казахстанская фондовая биржа“, финансовых инструментов и эмитентов ценных бумаг публикуется на веб-сайте KASE по адресу http://www.kase.kz/files/normative_base/code_fins.pdf



Студия „Глатис“
www.glatys.kz

Дизайн и верстка Меру Бакасова
Иллюстрации Ася Джаишева

© KASE, 2010



ГОДОВОЙ ОТЧЕТ 2009

Казахстанская фондовая биржа