

## ПРЕСС-РЕЛИЗ

г. Алматы

09 марта 2022 года

### **KASE начинает расчет индексов государственных ценных бумаг РК**

С 09 марта 2022 года АО "Казахстанская фондовая биржа" (далее – Биржа, KASE) начинает расчет и публикацию серии индексов рынка государственных ценных бумаг Республики Казахстан (ГЦБ).

Значения индексов будут рассчитываться один раз в день после завершения торгов на рынке ГЦБ и будут публиковаться на официальном интернет-ресурсе Биржи.

В качестве представительского списка для данных индексов будут использованы неиндексированные ГЦБ Республики Казахстан, которые включены в официальный список KASE, имеют фиксированную ставку купона и номинированы в тенге. Представительских список индексов сегментирован по срокам до погашения: менее одного года (s), от одного года до пяти лет (m), от пяти лет и более (l). Соответственно KASE намерена рассчитывать три серии индексов для краткосрочных, среднесрочных и долгосрочных ценных бумаг. Каждая серия включает в себя:

- KZGB\_CP – ценовой индекс "чистых" цен ГЦБ, рассчитываемый по ценам без учета накопленного и не выплаченного купонного вознаграждения;
- KZGB\_DP – ценовой индекс совокупного дохода, то есть цен с учетом начисленного купонного вознаграждения и реинвестированного купонного платежа;
- KZGB\_Y – индекс доходности, выраженный в процентах годовых.

Новые серии индексов ГЦБ показывают изменение стоимости и доходности государственных ценных бумаг на различных сроках до погашения.

Расчет индексов ГЦБ осуществляется один раз в день по сделкам ГЦБ, заключаемым в торговой системе Биржи. В случае отсутствия или недостаточности сделок в расчет будут приниматься рыночные цены ГЦБ, определенные согласно внутреннему документу KASE "Методика оценки ценных бумаг".

При определении методологии новых индексов ГЦБ Биржа учитывала общепринятую практику определения облигационных индексов Европейской комиссии по облигациям (European bond commission) и Европейской федерации обществ финансовых аналитиков (European Federation of financial analysts societies).

Напомним, что биржевой рынок KASE является источником формирования основных бэнчмарков стоимости денег и финансовых инструментов на казахстанском рынке. В частности, Индекс KASE – основной индикатор фондового рынка, кривая доходности ГЦБ и индекс TONIA – общепринятые индикаторы денежного рынка и основные бэнчмарки стоимости денег.

Индексы ГЦБ публикуются на сайте KASE в разделе "Индикаторы фондового рынка" – [https://kase.kz/ru/stock\\_market](https://kase.kz/ru/stock_market).

#### **Для справки**

АО "Казахстанская фондовая биржа" (KASE) является ведущей фондовой биржей в Центрально-Азиатском регионе. KASE занимает второе место среди бирж СНГ по объему торгов ценными бумагами, и пятое место по объему капитализации рынка акций бирж FEAS.

Это универсальная торговая площадка для корпоративных и государственных ценных бумаг, облигаций международных финансовых институтов, иностранных валют, операций рынка денег – репо и своп, а также производных инструментов. KASE является членом Международной федерации бирж (WFE), Федерации Евро-Азиатских фондовых бирж (FEAS) и других международных и отечественных профессиональных объединений, а также участником инициативы ООН "Фондовые биржи за устойчивое развитие".

Дополнительная информация: +7 (727) 237 5342, [pr@kase.kz](mailto:pr@kase.kz).