

АО "КАЗАХСТАНСКАЯ ФОНДОВАЯ БИРЖА"

У т в е р ж д е н а

решением Правления
АО "Казахстанская фондовая биржа"

(протокол заседания
от 10 ноября 2015 года № 125)

Введена в действие

с 10 ноября 2015 года

МЕТОДИКА **расчета индикаторов рынка** **иностраннных валют**

г. Алматы

2015

ЛИСТ ПОПРАВК

1. Изменения и дополнение № 1:

- утверждены решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 17 августа 2018 года № 86);
- введены в действие с 10 сентября 2018 года.

2. Изменения № 2:

- утверждены решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 06 июня 2019 года № 66);
- введены в действие с 01 июля 2019 года.

3. Изменения № 3:

- утверждены решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 12 августа 2021 года № 86);
- введены в действие с 18 августа 2021 года.

Настоящая Методика определяет перечень индикаторов рынка иностранных валют АО "Казахстанская фондовая биржа" (далее – Биржа) и порядок их расчета.

Глава 1. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

1. В настоящей Методике используются понятия, определенные другими внутренними документами Биржи.
2. Для целей настоящей Методики:
 - 1) под иностранными валютами понимаются иностранные валюты, торги которыми проводятся на Бирже в соответствии с ее внутренними документами;
 - 2) под сделками понимаются сделки, заключенные на проводимых Биржей торгах с инструментом USDKZT_TOM *(данный подпункт изменен решением Правления Биржи от 06 июня 2019 года)*.
3. Биржа рассчитывает следующие индикаторы рынка иностранных валют *(данный пункт изменен решением Правления Биржи от 06 июня 2019 года)*:
 - 1) средневзвешенный курс доллара США к казахстанскому тенге на 11.00 часов времени города Нур-Султан;
 - 2) средневзвешенный курс доллара США к казахстанскому тенге на 15.30 часов времени города Нур-Султан;
 - 3) средневзвешенный курс доллара США к казахстанскому тенге по итогам торгового дня.
4. Используемые в настоящей Методике термины могут также применяться в других внутренних документах Биржи, в служебной документации, переписке Биржи и в биржевой информации.
5. Изменения и/или дополнения в настоящую Методику подлежат размещению (опубликованию) на официальном интернет-ресурсе Биржи не менее чем за семь календарных дней до даты ввода в действие этих изменений и/или дополнений.

Глава 2. ПОРЯДОК РАСЧЕТА ИНДИКАТОРОВ РЫНКА ИНОСТРАННЫХ ВАЛЮТ

6. Расчет индикаторов рынка иностранных валют осуществляется ежедневно по рабочим дням¹ в соответствии с пунктами 10–13 настоящей Методики.
7. При расчете индикаторов рынка иностранных валют:
 - 1) не используются параметры сделок, относящихся (по имеющейся у Биржи информации) к операциям валютного свопа;
 - 2) используются параметры только тех сделок, которые были заключены методами открытых торгов.
8. *(Данный пункт исключен решением Правления Биржи от 17 августа 2018 года)*.
9. В целях обеспечения адекватности значений индикаторов рынка иностранных валют объективным характеристикам соответствующего рынка данные значения могут быть скорректированы Комитетом по индексам и индикаторам. Условия и порядок такой корректировки определены главой 3 настоящей Методики *(данный пункт изменен решением Правления Биржи от 12 августа 2021 года)*.
10. *(Данный пункт исключен решением Правления Биржи от 06 июня 2019 года)*.

¹ Под рабочими днями понимаются рабочие дни в Республике Казахстан.

11. Для расчета средневзвешенного курса доллара США к казахстанскому тенге на 11.00 часов времени города Нур-Султан используются параметры сделок, заключенных в день расчета данного индикатора в период с начала торгового дня до 11.00 часов времени города Нур-Султан.

Для расчета средневзвешенного курса доллара США к казахстанскому тенге на 15.30 часов времени города Нур-Султан используются параметры сделок, заключенных в день расчета данного индикатора в период с начала торгового дня до 15.30 часов времени города Нур-Султан.

Для расчета средневзвешенного курса доллара США к казахстанскому тенге по итогам торгового дня используются параметры сделок, заключенных в день расчета данного индикатора в период с начала торгового дня до 17.00 часов времени города Нур-Султан.

Расчет индикаторов рынка иностранных валют осуществляется по формуле, установленной пунктом 12 настоящей Методики.

Если в какой-либо рабочий день не было заключено сделок с инструментом USDKZT_TOM в период, установленный абзацем первым, вторым или третьим, то соответствующий индикатор рынка иностранных валют в данный день не рассчитывается.

(Данный пункт изменен решениями Правления Биржи от 17 августа 2018 года и от 06 июня 2019 года).

12. Значение средневзвешенного курса доллара США к казахстанскому тенге как индикатора рынка иностранных валют рассчитывается по формуле:

$$R_d = \sum_{i=1}^n (V_i \times R_i) / \sum_{i=1}^n V_i, \text{ где}$$

R_d – средневзвешенный курс доллара США к казахстанскому тенге в казахстанских тенге за один доллар США;

n – количество сделок купли-продажи доллара США, заключенных в период, установленный пунктом 11 настоящей Методики *(данный абзац изменен решением Правления Биржи от 06 июня 2019 года)*;

V_i – объем i -й сделки в долларах США;

R_i – цена i -й сделки в тенге за один доллар США.

13. Округление значений индикаторов для публикации производится до двух знаков после запятой по правилам математического округления (цифры до пяти уменьшаются до нуля, а цифры от пяти и выше увеличиваются до десяти).

Глава 3. ОСОБЫЕ ПОЛНОМОЧИЯ КОМИТЕТА ПО ИНДЕКСАМ И ИНДИКАТОРАМ В ОТНОШЕНИИ ИНДИКАТОРОВ РЫНКА ИНОСТРАННЫХ ВАЛЮТ

(Данный заголовок изменен решением Правления Биржи от 12 августа 2021 года)

14. Комитет по индексам и индикаторам (далее – Комитет) вправе корректировать значения индикаторов рынка иностранных валют, исключая из их расчета параметры тех сделок, которые, по мнению Комитета, неоправданно влияют (повлияли) на эти значения (например, неисполненных сделок; сделок, при заключении которых участника-ми торгов были допущены технические ошибки; сделок, цены которых явно диссонируют с рыночным состоянием и/или рыночной динамикой цен соответствующих иностранных валют, что позволяет предполагать их манипуляционную природу).

В случае принятия Комитетом решения об исключении из расчета того или иного индикатора рынка иностранных валют параметров какой-либо сделки (каких-либо сделок) соответствующий перерасчет данного индикатора осуществляется незамедлительно.

(Данный пункт изменен решением Правления Биржи от 12 августа 2021 года)

15. При использовании Комитетом своих особых полномочий в соответствии с пунктом 14 настоящей Методики в протоколе его заседания должны быть отражены причины использования этих полномочий и действия, предпринятые Комитетом в соответствии с этими полномочиями *(данный пункт изменен решением Правления Биржи от 12 августа 2021 года)*.

Глава 4. ЗАКЛЮЧИТЕЛЬНЫЕ ПОЛОЖЕНИЯ

(Данная глава включена решением Правления Биржи от 17 августа 2018 года)

16. Ответственность за исполнение настоящей Методики и внесение в нее изменений и/или дополнений (актуализация) возлагается на Департамент информации и статистики.
17. Настоящая Методика подлежит актуализации по мере необходимости, но не реже одного раза в три года.

И.о. Председателя Правления

Хорошевская Н.Ю.