

АО "КАЗАХСТАНСКАЯ ФОНДОВАЯ БИРЖА"

Утверждена
решением Правления
АО "Казахстанская фондовая биржа"
(протокол заседания
от 25 июля 2016 года № 74)

Введена в действие
с 01 августа 2016 года

СПЕЦИФИКАЦИЯ фьючерса на курс доллара США к тенге

ЛИСТ ПОПРАВК

1. Изменения № 1:

- утверждены решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 12 сентября 2018 года № 97);
- введены в действие с 13 сентября 2018 года.

2. Дополнение № 2:

- утверждено решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 27 сентября 2018 года № 107);
- введено в действие с 28 сентября 2018 года.

3. Изменение и дополнения № 3:

- утверждены решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 10 апреля 2019 года № 47);
- будут введены в действие с 15 апреля 2019 года.

СПЕЦИФИКАЦИЯ ФЬЮЧЕРСА НА КУРС ДОЛЛАРА США К ТЕНГЕ

Инструмент:	срочный контракт.
Вид:	Фьючерс.
Базовый актив:	курс доллара США к тенге.
Количество базового актива в срочном контракте:	1.000 (одна тысяча) долларов США.
Цена	тенге за один доллар США.
День начала обращения ¹ :	1) каждый понедельник – для недельного фьючерса; 2) 15-ое число определенного месяца исполнения ² – для месячного, трехмесячного и шестимесячного фьючерсов <i>(данный абзац дополнен решением Правления Биржи от 10 апреля 2019 года)</i> .
Последний день обращения	рабочий день, предшествующий дню исполнения – для всех валютных фьючерсов.
День исполнения ³	1) каждый понедельник – для недельного фьючерса; 2) 15-ое число определенного месяца исполнения – для месячного, трехмесячного и шестимесячного фьючерсов <i>(данный абзац дополнен решением Правления Биржи от 10 апреля 2019 года)</i> .
Срок исполнения:	1) одна неделя – для недельного фьючерса; 1-1) один месяц – для месячного фьючерса <i>(данный абзац дополнен решением Правления Биржи от 10 апреля 2019 года)</i> ; 2) три месяца – для трехмесячного фьючерса; 3) шесть месяцев – для шестимесячного фьючерса.
Теоретическая цена	Расчетный курс доллара США для даты, соответствующей дате исполнения фьючерса, рассчитанный по состоянию на начало торгов согласно статье 21 внутреннего документа Биржи "Методика определения риск-параметров финансовых инструментов <i>(данная строка изменена решением Правления Биржи от 10 апреля 2019 года)</i>
Окончательная расчетная цена:	установленный в день исполнения средневзвешенный курс доллара США по итогам утренней и дневной торговых сессий, с расчетами на следующий рабочий день; если по каким-либо причинам торги данным инструментом не проводятся, то применяется

¹ Если день начала обращения приходится на праздничный или выходной день, то днем начала обращения является ближайший после него рабочий день, в который проводятся биржевые торги срочными контрактами.

² Здесь и далее месяцем исполнения является один из месяцев, приходящийся на конец квартала: март, июнь, сентябрь, декабрь.

В день исполнения срочных контрактов начинаются торги трехмесячными и шестимесячными срочными контрактами, по которым торги ранее не проводились.

В день исполнения трехмесячной серии срочных контрактов шестимесячная серия срочных контрактов, открытая ранее, становится трехмесячной серией срочных контрактов.

³ Если день исполнения приходится на праздничный или выходной день, то днем исполнения является ближайший после него рабочий день, в который проводятся биржевые торги срочными контрактами.

средневзвешенный курс доллара США по итогам утренней и дневной торговых сессий, с расчетами T+n.

(данная строка изменена решением Правления Биржи от 12 сентября 2018 года)

Исполнение:	без поставки базового актива с выплатой/получением эквивалента в тенге разницы между расчетной ценой, определенной при последней корректировке по рынку, и окончательной расчетной ценой.
Последний день биржевых торгов:	последний рабочий день, предшествующий дню исполнения данного контракта.
Единица измерения цены:	казахстанский тенге за один доллар США с точностью до второго знака после запятой
Тик:	0,01.
Стоимостная оценка тика	10 тенге.
Уровень поддерживаемой маржи:	80 % от обязательства по начальной марже.
Срок исполнения нетто-обязательств перед Биржей:	до 10.00 рабочего дня, следующего за днем, по результатам которого возникли нетто-обязательства.