

# 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

---

---

г. Алматы

2016

## 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.

### 4. Изменение и дополнение № 4:

- утверждены решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 21 мая 2019 года № 61);
- введены в действие с 22 мая 2019 года.

### 5. Изменение № 5:

- утверждено решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 26 июня 2019 года № 73);
- введено в действие с 01 июля 2019 года.

### 6. Изменения и дополнение № 6:

- утверждено решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 07 июля 2020 года № 92);
- введено в действие с 08 июля 2020 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 <sup>1</sup> :	1) каждый понедельник – для недельного фьючерса; 2) 15-ое число определенного месяца исполнения <sup>2</sup> – 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 <sup>3</sup>	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 внутреннему документу Биржи "Методика определения риск-параметров финансовых инструментов" <i>(данный абзац изменен решением Правления Биржи от 07 июля 2020 года)</i>

---

<sup>1</sup> 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.

<sup>2</sup> Здесь и далее месяцем исполнения является: для трехмесячных и шестимесячных срочных контрактов – один из месяцев, приходящийся на конец квартала (март, июнь, сентябрь, декабрь); для месячного срочного контракта – месяц, в который начал обращение месячный контракт.

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

В день исполнения трехмесячного фьючерса шестимесячный фьючерс, открытый ранее, становится трехмесячным фьючерсом *(данный абзац изменен решениями Правления Биржи от 10 апреля 2019 года и от 21 мая 2019 года)*.

За один месяц до дня исполнения трехмесячного либо шестимесячного фьючерса, открытого ранее, торги месячным срочным контрактом не открываются *(данный абзац дополнен решением Правления Биржи от 21 мая 2019 года)*.

<sup>3</sup> 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.

*(данная строка изменена решением Правления Биржи от 10 апреля 2019 года)*

Окончательная расчетная цена: расчетный курс доллара США для даты, соответствующей дате исполнения фьючерса, рассчитанный в соответствии с внутренним документом Биржи "Методика определения риск-параметров финансовых инструментов" на момент окончания торгов финансовыми инструментами рынка деривативов *(данный абзац изменен решением Правления Биржи от 07 июля 2020 года)*.

*(данная строка изменена решением Правления Биржи от 12 сентября 2018 года и от 26 июня 2019 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.