

АО "КАЗАХСТАНСКАЯ ФОНДОВАЯ БИРЖА"

Утверждена
решением Правления
АО "Казахстанская фондовая биржа"
(протокол заседания
от 24 октября 2012 года № 210)

Введена в действие
с 25 октября 2012 года

СПЕЦИФИКАЦИЯ фьючерса на простые акции KAZ Minerals PLC

(Данный заголовок изменен решением Правления Биржи от 10 декабря 2014 года).

ЛИСТ ПОПРАВК

1. Изменение № 1:

- утверждено решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 19 марта 2013 года № 38);
- введено в действие с 15 апреля 2013 года.

2. Изменения № 2:

- утверждены решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 18 декабря 2013 года № 182);
- введены в действие с 01 января 2014 года.

3. Изменения № 3:

- утверждены решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 10 декабря 2014 года № 179);
- введены в действие с 10 декабря 2014 года.

4. Изменения № 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. Изменения и дополнение № 5:

- утверждены решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 10 декабря 2019 года № 151);
- введены в действие с 11 декабря 2019 года.

СПЕЦИФИКАЦИЯ ФЬЮЧЕРСА НА ПРОСТЫЕ АКЦИИ KAZ MINERALS PLC¹

(Данный заголовок изменен решениями Правления Биржи от 10 декабря 2014 года и от 10 декабря 2019 года)

Инструмент: срочный контракт
 Вид: Фьючерс
 Базовый актив: простые акции KAZ Minerals PLC

(Данная строка изменена решением Правления Биржи от 10 декабря 2014 года)

Количество базового актива в срочном контракте: 20 простых акций KAZ Minerals PLC

(Данная строка изменена решениями Правления Биржи от 18 декабря 2013 года и от 10 декабря 2014 года)

Цена: Тенге за одну простую акцию KAZ Minerals PLC

(Данная строка изменена решением Правления Биржи от 10 декабря 2014 года)

День исполнения: 15-ое число определенного месяца исполнения²

Срок исполнения³: 1) три месяца – для трехмесячного фьючерса;
 2) шесть месяцев – для шестимесячного фьючерса

Теоретическая цена:

$$F_{KZMS} = S_{KZMS} \times \left(1 + \frac{r_{kzt}}{100} \times \frac{T}{360}\right) - \sum_i \frac{DIV_i \times \left(1 + r_{kzt} \times \frac{N_i}{365}\right)}{\left(1 + r_{kzt} \times \frac{M_i}{365}\right)}, \text{ где:}$$

F_{KZMS} – теоретическая цена соответствующего фьючерса на простые акции KAZ Minerals PLC;

S_{KZMS} – средневзвешенная цена⁴ простой акции KAZ Minerals PLC, на дату расчета теоретической цены по состоянию на 15.30 алматинского времени (при отсутствии сделок, цена последней биржевой сделки с простыми акциями KAZ Minerals PLC по итогам

¹ Настоящая Спецификация применима при открытии торгов фьючерсами на простые акции KAZ Minerals PLC *(данная сноска включена решением Правления Биржи от 10 декабря 2019 года)*.

² Месяцем исполнения является один из месяцев, приходящийся на конец квартала: март, июнь, сентябрь, декабрь.

Если 15-ое число месяца исполнения приходится на праздничный или выходной день, то днем исполнения является ближайший после него рабочий день, в который проводятся биржевые торги срочными контрактами.

(Нумерация данной сноски изменена решением Правления Биржи от 10 декабря 2019 года)

³ Срок исполнения срочных контрактов составляет указанное в настоящей Спецификации число месяцев, за исключением первоначального периода биржевых торгов, во время которого допускается открытие срочных контрактов с более коротким сроком исполнения *(данный абзац изменен решением Правления Биржи от 21 мая 2019 года)*.

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

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

(Нумерация данной сноски изменена решением Правления Биржи от 10 декабря 2019 года)

⁴ При определении теоретической цены учитываются только параметры исполненных сделок, которые были заключены в торговой системе KASE с акциями KAZ Minerals PLC одним из методов открытых торгов *(данная сноска изменена решением Правления Биржи от 10 декабря 2014 года, нумерация данной сноски изменена решением Правления Биржи от 10 декабря 2019 года)*.

		предыдущей торговой сессии);
r_{kzt}	–	индикатор казахстанского межбанковского рынка депозитов KazPrime, сроком – 3 месяца, выраженный в процентах;
T	–	количество календарных дней с текущей даты до даты исполнения соответствующего фьючерса (по базе - actual/360);
DIV_i	–	i -ый размер дивиденда на одну простую акцию KAZ Minerals PLC, утвержденный общим собранием акционеров;
N_i	–	количество календарных дней с даты фиксации реестра акционеров по i -му дивиденду до даты исполнения соответствующего фьючерса (по базе - actual/360);
M_i	–	количество календарных дней с даты фиксации реестра акционеров по i -му дивиденду до даты выплаты i -го дивиденда (по базе - actual/360)"

(Данная строка изменена решениями Правления Биржи от 19 марта 2013 года и от 10 декабря 2014 года)

Окончательная расчетная цена – средневзвешенная цена⁵ за одну простую акцию KAZ Minerals PLC, рассчитываемая по следующей формуле:

$$SP_{KZMS} = \frac{\sum_{i=1}^n (V_i' \times KZMS_i)}{\sum_{i=1}^n V_i'}, \text{ где:}$$

SP_{KZMS}	–	окончательная расчетная цена по фьючерсу на простые акции KAZ Minerals PLC;
n	–	количество сделок;
V_i	–	ограниченный объем в тенге i -ой сделки ⁶ ;
$KZMS_i$	–	цена за одну простую акцию KAZ Minerals PLC, рассчитанная в результате заключения i -ой сделки

⁵ При определении окончательной расчетной цены срочного контракта учитываются только параметры исполненных сделок, которые были заключены в торговой системе KASE с акциями KAZ Minerals PLC одним из методов открытых торгов в последний день биржевых торгов для данного срочного контракта *(данная сноска изменена решением Правления Биржи от 10 декабря 2014 года, нумерация данной сноски изменена решением Правления Биржи от 10 декабря 2019 года)*.

⁶ Вычисляется по формуле:

$$V_i' = \min\{V_i; Ave + 1.65 * Stdev\}, \text{ где:}$$

V_i'	–	ограниченный объем в тенге i -ой сделки;
V_i	–	объем в тенге i -ой сделки, параметры которой учитываются в расчете;
Ave	–	средний объем в тенге по всем сделкам, параметры которых учитываются в расчете;
$Stdev$	–	стандартное отклонение по массиву объемов сделок, параметры которых учитываются в расчете;
1.65	–	квантиль нормального распределения, соответствующая уровню доверия 95%.

(Нумерация данной сноски изменена решением Правления Биржи от 10 декабря 2019 года)

(Данная строка изменена решением Правления Биржи от 10 декабря 2014 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
Тик ⁷ :	0,1
Стоимостная оценка тика ⁸ :	два тенге

(Данная строка изменена решением Правления Биржи от 18 декабря 2013 года)

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

⁷ Минимальное изменение цены *(нумерация данной сноски изменена решением Правления Биржи от 10 декабря 2019 года)*.

⁸ Произведение значения тика на количество базового актива в срочном контракте *(нумерация данной сноски изменена решением Правления Биржи от 10 декабря 2019 года)*.