АО "КАЗАХСТАНСКАЯ ФОНДОВАЯ БИРЖА"

У т в е р ж д е н а

решением Правления
АО "Казахстанская фондовая биржа"

(протокол заседания
от 17 ноября 2020 года № 151)

Введена в действие

с 30 ноября 2020 года

СПЕЦИФИКАЦИЯ

операций валютного свопа и операций с иностранной валютой

г. Алматы

2020

ЛИСТ ПОПРАВОК

1. **Изменения № 1:**
   - утверждены решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 27 мая 2024 года № 60);
   - введены в действие с 03 июня 2024 года.
2. **Изменения и дополнение № 2:**
   - утверждены решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 25 июля 2024 года № 85);
   - введены в действие с 09 сентября 2024 года.

Настоящая Спецификация разработана в соответствии с внутренними документами АО "Казахстанская фондовая биржа" (далее – Биржа) и содержит стандартные условия осуществления операций валютного свопа и операций с иностранной валютой (условно называемых "краткосрочный валютный своп"), а также расчет параметров таких операций.

Глава 1. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

1. В настоящей Спецификации использованы понятия, определенные внутренним документом Биржи, регламентирующим общие условия осуществления биржевой деятельности, и другими внутренними документами Биржи *(данный пункт изменен решением Правления Биржи от 27 мая 2024 года)*.

1-1. Для целей настоящей Спецификации под сопряженной валютой понимается валюта, за которую производится покупка или продажа иностранной валюты *(данный пункт включен решением Правления Биржи от 25 июля 2024 года)*.

2. Структуры кодов операции валютного свопа и операции с иностранной валютой приведены во внутреннем документе Биржи, регламентирующем порядок присвоения кодов членам Биржи и их счетам, пользователям торговых систем, эмитентам ценных бумаг и финансовым инструментам *(данный пункт изменен решением Правления Биржи от 27 мая 2024 года)*.

3. Операции валютного свопа осуществляются в отношении доллара США.

   Операции с иностранной валютой осуществляются в отношении доллара США, евро, российского рубля и юаня Китайской Народной Республики.

4. Стандартизированные сроки, на которые могут быть осуществлены операции валютного свопа, составляют семь дней, один месяц, три месяца, шесть месяцев и один год.

   Стандартизированные сроки, на которые могут быть осуществлены операции с иностранной валютой, составляют один день и два дня.

Глава 2. РАСЧЕТ ПАРАМЕТРОВ ОПЕРАЦИИ ВАЛЮТНОГО СВОПА И ОПЕРАЦИИ С ИНОСТРАННОЙ ВАЛЮТОЙ

5. Для расчета параметров операции валютного свопа и операции с иностранной валютой применяются следующие формулы:

   1) цена закрытия рассчитывается по формуле:

$$Price_{close} = Price_{open} + Price_{operation}, \text{ где:}$$

   $Price_{close}$ – цена сделки закрытия операции своп / операции с иностранной валютой (в случае если цена измеряется в тенге, то с точностью до пятого знака после запятой, либо если цена измеряется в долларах США, то с точностью до шестого знака после запятой);

   $Price_{open}$ – цена сделки открытия операции своп / операции с иностранной валютой;

   в операциях валютного свопа / операциях с иностранной валютой в отношении доллара США, осуществляемых на основной торговой сессии, в качестве такой цены используется средневзвешенная цена всех сделок по инструменту USDKZT_TOM, сложившаяся по состоянию на 11.00 времени города Алматы дня начала (открытия) данной операции, в котором этот инструмент торговался; в случае отсутствия таких сделок используется средневзвешенная цена всех сделок, заключенных в последний результативный день с данным инструментом; измеряется в тенге, с точностью до второго знака после запятой;

   в операциях с иностранной валютой в отношении доллара США, осуществляемых на дополнительной торговой сессии, в качестве такой цены используется средне-

взвешенная цена всех сделок по инструменту USDKZT_TOM, сложившаяся по состоянию на 15.30 времени города Алматы дня начала (открытия) данной операции, в котором данный инструмент торговался; в случае отсутствия таких сделок используется средневзвешенная цена всех сделок, заключенных в последний результативный день с данным инструментом; измеряется в тенге, с точностью до второго знака после запятой;

в операциях с иностранной валютой в отношении евро и рубля в качестве такой цены используется:

средневзвешенная цена всех сделок с этой иностранной валютой, расчеты по которым осуществляются на следующий рабочий день после дня проведения торгов, сложившаяся по состоянию на 11.00 времени города Алматы дня начала (открытия) данной операции, в котором эта иностранная валюта торговалась; в случае отсутствия таких сделок используется средневзвешенная цена всех сделок, заключенных в последний результативный день с этой иностранной валютой с расчетами на следующий рабочий день после дня проведения торгов с этой иностранной валютой; при этом:

– в операциях с иностранной валютой в отношении евро данная цена измеряется в тенге с точностью до второго знака после запятой либо в долларах США с точностью до шестого знака после запятой;

– в операциях с иностранной валютой в отношении рубля данная цена измеряется в тенге, с точностью до четвертого знака после запятой;

в операциях с иностранной валютой в отношении юаня в качестве такой цены используется средневзвешенная цена всех сделок, заключенных в последний результативный день с этой иностранной валютой, расчеты по которым осуществляются на следующий рабочий день после дня проведения торгов; измеряется в тенге, с точностью до четвертого знака после запятой;

(данный подпункт изменен решением Правления Биржи от 25 июля 2024 года)

2) доходность рассчитывается по формуле:

$$\text{Yield} = \frac{\text{Price}_{\text{operation}} \times \text{Tn}}{\text{Lenght} \times \text{Price}_{\text{open}}} \times 100, \text{ где:}$$

Yield – доходность операции своп / операции с иностранной валютой (измеряется в процентах, с точностью до пятого знака после запятой);

T_n – количество календарных дней в году;

Lenght – срок операции своп / операции с иностранной валютой в днях (количество календарных дней между датами расчетов сделок открытия и закрытия);

(данный подпункт изменен решением Правления Биржи от 25 июля 2024 года)

3) объем открытия рассчитывается по формуле:

$$\text{Volume}_{\text{open}} = \text{Price}_{\text{open}} \times \text{Quantity, где:}$$

$\text{Volume}_{\text{open}}$ – объем открытия операции своп / операции с иностранной валютой (измеряется в тенге, с точностью до второго знака после запятой);

Quantity – количество инструмента в операции своп / операции с иностранной валютой (измеряется в единицах инструмента);

4) объем закрытия рассчитывается по формуле:

$$\text{Volume}_{\text{close}} = \text{Price}_{\text{close}} \times \text{Quantity, где:}$$

$\text{Volume}_{\text{close}}$ – объем закрытия операции своп / операции с иностранной валютой (измеряется в тенге, с точностью до второго знака после запятой).

Глава 3. ОБЯЗАТЕЛЬСТВА ПО ОПЕРАЦИИ ВАЛЮТНОГО СВОПА

6. Стороны операции валютного свопа обязаны уплачивать друг другу сумму денег в валюте, являющейся сопряженной валютой (вариационную маржу), размер которой зависит от изменения цены предмета такой операции *(данный пункт изменен решением Правления Биржи от 25 июля 2024 года)*.

7. Вариационная маржа рассчитывается в день осуществления операции валютного свопа и уплачивается в период со дня, следующего за датой осуществления операции валютного свопа, до даты исполнения обеими сторонами обязательств по сделке закрытия включительно в соответствии с внутренними документами клиринговой организации *(данный пункт изменен решением Правления Биржи от 27 мая 2024 года)*.

Глава 4. ЗАКЛЮЧИТЕЛЬНЫЕ ПОЛОЖЕНИЯ

8. Ответственность за своевременное внесение изменений и/или дополнений (актуализация) в настоящую Спецификацию возлагается на подразделение торгов.

9. Настоящая Спецификация подлежит актуализации по мере необходимости.

   Настоящая Спецификация подлежит пересмотру на необходимость в актуализации не реже одного раза каждые три года, исчисляемых со дня введения в действие настоящей Спецификации, а в случае ее актуализации – со дня введения в действие последних изменений/дополнений.

(Данный пункт изменен решением Правления Биржи от 27 мая 2024 года)

Председатель Правления Алдамберген А. Ө.