

# АО "КАЗАХСТАНСКАЯ ФОНДОВАЯ БИРЖА"

---

---

**Утверждена**  
решением Правления  
АО "Казахстанская фондовая биржа"  
(протокол заседания  
от 23 августа 2018 года № 88)  
**Введена в действие**  
с 10 сентября 2018 года

## СПЕЦИФИКАЦИЯ операций валютного свопа

## ЛИСТ ПОПРАВК

### 1. Изменение № 1:

- утверждено решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 22 января 2019 года № 11);
- **введено** в действие с 18 февраля 2019 года.

### 2. Дополнение № 2:

- утверждено решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 28 марта 2019 года № 41);
- **введено** в действие с 01 апреля 2019 года.

### 2. Изменения № 3:

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

|                       |   |
|-----------------------|---|
| Предметы операций:    | доллары США, евро, российский рубль, юань Китайской Народной Республики.  |
| Сроки операций:       | <p>в отношении доллара США: один день, два дня, семь дней, один месяц, три месяца, шесть месяцев и один год;</p> <p>в отношении евро, рубля и юаня: один день и два дня.</p> <p><i>(данный абзац изменен решением Правления Биржи от 22 января 2019 года и дополнен решением Правления Биржи от 28 марта 2019 года).</i></p>  |
| Расчет цены закрытия: | $Price_{close} = Price_{open} + \frac{Price_{open} \times Price_{swap} \times swap_{length}}{365 \times 100}, \text{ где:}$ <p><math>Price_{close}</math> – цена сделки закрытия операции своп (измеряется в тенге, с точностью до шестого знака после запятой);</p> <p><math>Price_{open}</math> – цена сделки открытия операции своп (в тенге, с точностью до второго знака после запятой);</p> <p>в операциях валютного свопа в отношении доллара США, осуществляемых на:</p> <p>средневзвешенная цена всех сделок с этой иностранной валютой, расчеты по которым осуществляются на следующий рабочий день после дня торгов, сложившаяся по состоянию на 11.00 алматинского времени 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 торгов ;</p> <p>в операциях валютного свопа в отношении евро и рубля в качестве такой цены используется:</p> <p>средневзвешенная цена всех сделок с этой иностранной валютой, расчеты по которым осуществляются в день проведения торгов, сложившаяся по состоянию на 11.00 алматинского времени 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 в день проведения торгов с этой иностранной валютой;</p> <p>в операциях валютного свопа в отношении юаня в качестве такой цены используется средневзвешенная цена</p> |

всех сделок, заключенных в последний результативный день с этой иностранной валютой;

$Price_{\text{swap}}$  – цена операции своп (измеряется в процентах годовых, с точностью до четвертого знака после запятой);

$swap_{\text{length}}$  – срок операции своп в днях (количество календарных дней между датами расчетов сделок открытия и закрытия).

*(данный абзац изменен решением Правления Биржи от 26 июня 2019 года).*

Расчет объема открытия:

$Volume_{\text{open}} = Price_{\text{open}} \times Volume_{\text{swap}}$ , где:

$Volume_{\text{swap}}$  – объем операции своп (в единицах инструмента).

Расчет объема закрытия:

$Volume_{\text{close}} = Price_{\text{close}} \times Volume_{\text{swap}}$