

# 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

---

---

г. Алматы

2018

## **ЛИСТ ПОПРАВК**

### **1. Изменение № 1:**

- утверждено решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 22 января 2019 года № 11);
- будут введены в действие с 18 февраля 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 и три месяца;</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).</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 в качестве такой цены используется:</p> <p>средневзвешенная цена всех сделок с этой иностранной валютой, расчеты по которой осуществляются на следующий рабочий день после дня торгов, заключенных в день начала (открытия) данной операции на первой по очередности торговой сессии, на которой эта иностранная валюта торговалась, в случае отсутствия таких сделок используется средневзвешенная цена всех сделок, заключенных в последний результативный день с этой иностранной валютой;</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 с указанным сроком осуществления расчетов, заключенных в день начала (открытия) данной операции на первой по очередности торговой сессии, на которой эта иностранная валюта торговалась с указанным сроком осуществления расчетов, в случае отсутствия таких сделок используется средневзвешенная цена всех сделок, заключенных в последний результативный день с этой иностранной валютой;</p> <p>в операциях валютного свопа в отношении юаня в качестве такой цены используется средневзвешенная цена всех сделок, заключенных в последний результативный день с этой иностранной</p>

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).

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:

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