

"ҚАЗАҚСТАН ҚОР БИРЖАСЫ" АҚ

"Қазақстан қор биржасы" АҚ
Басқармасының шешімімен
(2020 жылдың 17 қарашасындағы
№ 151 отырыс хаттамасы)

б е к і т і л д і

2020 жылдың 30 қарашасынан бастап
қолданысқа енгізілді

Валюталық свопа операциялары мен
шетел валюталарымен операциялардың
МАМАНДАНЫМЫ

Алматы қ.

2020

ТҮЗЕТУЛЕР ПАРАҒЫ

1. №1 өзгертулер:

- "Қазақстан қор биржасы" АҚ Басқармасының шешімімен (2024 жылдың 27 мамырындағы № 60 отырыс хаттамасы) бекітілген;
- 2024 жылдың 03 маусымынан бастап қолданысқа енгізілді.

2. №2 өзгертулер мен толықтырулар:

- "Қазақстан қор биржасы" АҚ Басқармасының шешімімен (2024 жылдың 25 шілдесіндегі № 85 отырыс хаттамасы) бекітілген;
- 2024 жылдың 29 шілдесінен бастап қолданысқа енгізілді.

Осы Маманданым "Қазақстан қор биржасы" АҚ (бұдан әрі – Биржа) ішкі құжаттарына сәйкес әзірленді және валюталық своп операцияларын және шетел валютасымен операцияларды (шартты түрде "қысқа мерзімді валюталық своп" деп аталатын) жүзеге асырудың стандартты шарттарын, сондай-ақ осындай операциялардың параметрлерін есептеуді қамтиды.

1 тарау. ЖАЛПЫ ҚАҒИДАЛАР

1. Осы Маманданымда биржалық қызметті жүзеге асырудың жалпы шарттарын регламенттейтін Биржаның ішкі құжатында және Биржаның басқа да ішкі құжаттарында анықталған ұғымдар пайдаланылды (*осы тармақ Биржа Басқармасының 2024 жылдың 27 мамырындағы шешімімен өзгертілген*).
- 1-1. Осы Маманданымның мақсаттары үшін түйіндес валюта деп шетел валютасын сатып алу немесе сату жүргізілетін валюта түсініледі (*осы тармақ Биржа Басқармасының 2024 жылдың 25 шілдесіндегі шешімімен енгізілген*).
2. Валюталық своп операциялары және шетел валютасымен жасалатын операциялар кодтарының құрылымдары Биржа мүшелеріне және олардың шоттарына, сауда-саттық жүйелерін пайдаланушыларға, бағалы қағаздар эмитенттеріне және қаржы құралдарына кодтар беру тәртібін регламенттейтін Биржаның ішкі құжатында келтірілген (*осы тармақ Биржа Басқармасының 2024 жылдың 27 мамырындағы шешімімен өзгертілген*).
3. Валюталық своп операциялары АҚШ долларына қатысты жүзеге асырылады.
Шетел валютасымен операциялар АҚШ долларына, евроға, Ресей рубліне және Қытай Халық Республикасының юаніне қатысты жүзеге асырылады.
4. Валюталық своп операциялары жүзеге асырылуы мүмкін стандартталған мерзімдер жеті күнді, бір айды, үш айды, алты айды және бір жылды құрайды.
Шетел валютасымен операциялар жүзеге асырылуы мүмкін стандартталған мерзімдер бір күн және екі күнді құрайды.

2 тарау. ВАЛЮТАЛЫҚ СВОП ОПЕРАЦИЯЛАРЫ МЕН ШЕТЕЛ ВАЛЮТАСЫМЕН ОПЕРАЦИЯЛАР ПАРАМЕТРЛЕРІН ЕСЕПТЕУ

5. Валюталық своп операциясының және шетел валютасымен операцияның параметрлерін есептеу үшін мынадай формулалар қолданылады:
 - 1) жабылу бағасы мына формула бойынша есептеледі:

$$\text{Price}_{\text{close}} = \text{Price}_{\text{open}} + \text{Price}_{\text{operation}}, \text{ мұнда:}$$

$\text{Price}_{\text{close}}$ – своп операциясының жабылу /шетел валютасымен операцияның мәмілесінің бағасы (егер баға теңгемен өлшенетін болса, онда үтірден кейінгі бесінші таңбаға дейінгі дәлдікпен немесе егер баға АҚШ долларымен өлшенетін болса, онда үтірден кейінгі алтыншы таңбаға дейінгі дәлдікпен);

$\text{Price}_{\text{open}}$ – своп операциясының ашылу / шетел валютасымен операцияны мәмілесінің бағасы;

негізгі сауда-саттық сессиясында жүзеге асырылатын АҚШ долларына қатысты валюталық своп операцияларында / шетел валютасымен жасалатын операцияларда мұндай баға ретінде осы операция басталған (ашылған) күннің Алматы қаласы уақытының 11.00-дегі жағдай бойынша қалыптасқан USDKZT_TOM қаржы құралы бойынша барлық мәмілелердің орташа сараланған бағасы пайдаланылады; мұндай мәмілелер болмаған жағдайда осы құралмен соңғы нәтижелі күні жасалған барлық мәмілелердің орташа сараланған бағасы пайдаланылады; теңгемен, үтірден кейінгі екінші таңбаға дейінгі дәлдікпен өлшенеді;

қосымша сауда-саттық сессиясында жүзеге асырылатын АҚШ долларына қатысты шетел валютасымен жасалатын операцияларда мұндай баға ретінде осы операция басталған (ашылған) күннің Алматы қаласы уақытының 15.30-дағы жағдай бойынша қалыптасқан USDKZT_TOM қаржы құралы бойынша барлық мәмілелердің орташа сараланған бағасы пайдаланылады; мұндай мәмілелер болмаған жағдайда осы құралмен соңғы нәтижелі күні жасалған барлық мәмілелердің орташа сараланған бағасы пайдаланылады; теңгемен, үтірден кейінгі екінші таңбаға дейінгі дәлдікпен өлшенеді;

еуро мен рубльге қатысты шетел валютасымен операцияларда мұндай баға ретінде пайдаланылады:

осы шетел валютасымен жасалған барлық мәмілелердің орташа сараланған бағасы, олар бойынша есеп айырысулар сауда-саттық өткізілген күннен кейінгі келесі жұмыс күні жүзеге асырылады, осы операция басталған (ашылған) күннің Алматы қаласы уақытының 11.00-дегі жағдай бойынша қалыптасқан, мұндай мәмілелер болмаған жағдайда осы шетел валютасымен сауда-саттық өткізілген күннен кейінгі келесі жұмыс күніндегі есеп айырысулармен осы шетел валютасымен соңғы нәтижелі күні жасалған барлық мәмілелердің орташа сараланған бағасы пайдаланылады; бұл ретте; бұл ретте:

- еуроға қатысты шетел валютасымен жасалатын операцияларда бұл баға теңгемен үтірден кейінгі екінші таңбаға дейінгі дәлдікпен немесе үтірден кейінгі алтыншы таңбаға дейінгі дәлдікпен АҚШ долларымен өлшенеді;
- рубльге қатысты шетел валютасымен жасалған операцияларда бұл баға теңгемен, үтірден кейінгі төртінші таңбаға дейінгі дәлдікпен өлшенеді;

юаньға қатысты шетел валютасымен жасалатын операцияларда осындай баға ретінде осы шетел валютасымен соңғы нәтижелі күні жасалған барлық мәмілелердің орташа сараланған бағасы пайдаланылады, олар бойынша есеп айырысулар сауда-саттық өткізілген күннен кейінгі келесі жұмыс күні жүзеге асырылады; теңгемен, үтірден кейінгі төртінші таңбаға дейінгі дәлдікпен өлшенеді;

(осы тармақша Биржа Басқармасының 2024 жылдың 25 шілдесіндегі шешімімен өзгертілген)

- 2) кірістілік формула бойынша есептеледі:

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

Yield – своп / шетел валютасы операциясының кірістілігі (үтірден кейінгі бесінші таңбаға дейінгі дәлдікпен, пайызбен өлшенеді,);

T_n – жылдағы күнтізбелік күндер саны;

Lenght – своп / шетел валютасымен операция мерзімі күндермен (ашылу және жабылу мәмілелерін есептеу күндері арасындағы күнтізбелік күндер саны);

(осы тармақша Биржа Басқармасының 2024 жылдың 25 шілдесіндегі шешімімен өзгертілген)

- 3) ашылу көлемі мына формула бойынша есептеледі:

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

$\text{Volume}_{\text{open}}$ – своп операциясының / шетел валютасымен операцияның ашылу көлемі (теңгемен, үтірден кейін екінші таңбасына дейінгі дәлдікпен өлшенеді);

Quantity – своп операциясындағы / шетел валютасымен жасалатын операциядағы қаржы құралдың саны (қаржы құралының бірлігімен өлшенеді);

- 4) жабылу көлемі мына формула бойынша есептеледі:

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

$\text{Volume}_{\text{close}}$ – своп операциясын / шетел валютасымен операцияны жабылу көлемі (теңгемен, үтірден кейін екінші таңбасына дейінгі дәлдікпен өлшенеді).

3 тарау. ВАЛЮТАЛЫҚ СВОП ОПЕРАЦИЯЛАРЫ БОЙЫНША МІНДЕТТЕМЕЛЕР

6. Валюталық своп операциясының тараптары бір-біріне, мөлшері осындай операция затының бағасының өзгеруіне байланысты болатын, теңгедегі ақша сомасын (вариациялық маржаны) төлеуге міндетті.
7. Вариациялық маржа валюталық своп операциясы жүзеге асырылған күні есептеледі және клирингтік ұйымның ішкі құжаттарына сәйкес жабу мәмілесі бойынша міндеттемелерді қоса алғанда, екі тарап орындаған күнге дейін Валюталық своп операциясы жүзеге асырылған күннен кейінгі кезеңде төленеді *(осы тармақ Биржа Басқармасының 2024 жылдың 27 мамырындағы шешімімен өзгертілген)*.

4 тарау. ТҰЖЫРЫМДЫ ҚАҒИДАЛАР

8. Осы Маманданымға өзгертулерді және/немесе толықтыруларды (өзектілендіру) уақтылы енгізу үшін жауапкершілік сауда-саттық бөлімшесіне жүктеледі.
9. Осы Маманданым қажеттілігіне қарай өзектендіруге жатады.
Осы Маманданың бұл Маманданым қолданысқа енгізілген күннен бастап, ал ол өзектендірілген жағдайда – соңғы өзгертулер/толықтырулар қолданысқа енгізілген күннен бастап есептелетін әрбір үш жылда кемінде бір рет өзектендіру қажеттілігіне қайта қарауға жатады.

(Осы тармақ Биржа Басқармасының 2024 жылдың 27 мамырындағы шешімімен өзгертілген)

Басқарма Төрайымы

Алдамберген А. Ө.