

# 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

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 "Правила осуществления биржевой деятельности" и другими внутренними документами Биржи.
2. Структуры кодов операции валютного свопа и операции с иностранной валютой приведены во внутреннем документе Биржи "Инструкция о порядке присвоения кодов членам АО "Казахстанская фондовая биржа" и их счетам, пользователям торговых систем, эмитентам ценных бумаг и финансовым инструментам".
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:

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

$\text{Price}_{\text{close}}$  – цена сделки закрытия операции своп / операции с иностранной валютой (измеряется в тенге, с точностью до пятого знака после запятой);

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

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;

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

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 в день 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 в день проведения торгов с этой иностранной валютой;

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 в день проведения торгов;

$Price_{operation}$  – цена операции своп/операции с иностранной валютой (измеряется в тенге, с точностью до пятого знака после запятой);

2) доходность рассчитывается по формуле:

$$Yield = \frac{Price_{operation} \times 365}{Lenght \times Price_{open}} \times 100, \text{ где:}$$

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

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

3) объем открытия рассчитывается по формуле:

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

$Volume_{open}$  – 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:

$$Volume_{close} = Price_{close} \times Quantity, \text{ где:}$$

$Volume_{close}$  – 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 тенге (вариационную маржу), размер которой зависит от изменения цены предмета такой операции.
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 внутренним документом Биржи "Правила осуществления клиринговой деятельности по сделкам с финансовыми инструментами".

#### 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, но не реже одного раза каждые три года, исчисляемые с даты введения в действие настоящей Спецификации.

Председатель Правления

Алдамберген А. Ө.