

АО "КАЗАХСТАНСКАЯ ФОНДОВАЯ БИРЖА"

У т в е р ж д е н а

решением Правления
АО "Казахстанская фондовая биржа"
от 29 сентября 2009 года № 237

Введена в действие

с 07 октября 2009 года,

МЕТОДИКА расчета индикаторов рынка иностраннных валют

г. Алматы

2009

Настоящая Методика определяет перечень индикаторов рынка иностранных валют, рассчитываемых АО "Казахстанская фондовая биржа" (далее – Биржа), и порядок расчета этих индикаторов.

Статья 1. Общие положения

1. В настоящей Методике используются понятия, определенные другими внутренними документами Биржи, в частности документом "Регламент торгов и работы Системы подтверждения", утвержденным решением Правления Биржи от 05 августа 2004 года № 108/1.
2. Для целей настоящей Методики:
 - 1) под иностранными валютами понимаются иностранные валюты, торги которыми проводятся на Бирже в соответствии с ее внутренними документами;
 - 2) под сделками понимаются сделки, заключенные на проводимых Биржей торгах.
3. В качестве индикатора рынка иностранных валют Биржа рассчитывает средневзвешенный курс доллара США к казахстанскому тенге (USD/KZT).
4. Используемые в настоящей Методике термины могут также применяться в других внутренних документах Биржи, в служебной документации, переписке Биржи и в биржевой информации.
5. Изменения и/или дополнения в настоящую Методику подлежат размещению (опубликованию) на официальном Интернет-сайте Биржи не менее чем за 7 дней до даты ввода этих изменений и/или дополнений в действие.

Статья 2. Общие условия расчета индикатора

1. Расчет индикатора осуществляется ежедневно по рабочим дням¹ в соответствии со статьей 3 настоящей Методики.
2. При расчете индикатора:
 - 1) не используются параметры сделок, относящихся (по имеющейся у Биржи информации) к операциям валютного свопа;
 - 2) используются параметры только тех сделок, которые были заключены методами открытых торгов.
3. Значения индикатора публикуются Биржей с точностью до двух знаков после запятой.
4. При отсутствии в течение торгового дня по иностранным валютам сделок, параметры которых необходимы для осуществления расчета индикатора, данный индикатор в этот день не рассчитывается, а действующим является последнее рассчитанное значение индикатора.
5. В целях обеспечения адекватности значений индикатора объективным характеристикам рынка иностранных валют данные значения могут быть скорректированы Рисковым комитетом Биржи. Условия и порядок такой корректировки приведены в статье 4 настоящей Методики.

¹ Под рабочими днями понимаются рабочие дни в Республике Казахстан.

Статья 3. Расчет средневзвешенного курса доллара США к казахстанскому тенге (USD/KZT)

1. Расчет средневзвешенного курса доллара США к казахстанскому тенге осуществляется по окончании утренней торговой сессии вне зависимости от срока расчетов, с которым доллар США торговался на данной сессии. При расчете средневзвешенного курса доллара США к казахстанскому тенге используются параметры только тех сделок, которые были заключены с долларом США на данной сессии с учетом ограничений, указанных в пункте 2 статьи 2 настоящей Методики.
2. Средневзвешенный курс доллара США к казахстанскому тенге рассчитывается по формуле:

$$R_d = \sum_{i=1}^n (V_i \times R_i) / \sum_{i=1}^n V_i, \text{ где}$$

R_d – средневзвешенный курс доллара США к казахстанскому тенге в казахстанских тенге за один доллар США;

n – количество сделок купли-продажи доллара США, заключенных в рамках торговой сессии, по окончании которой производится расчет данного индикатора;

V_i – объем i -й сделки в долларах США;

R_i – цена i -й сделки в тенге за один доллар США.

Округление значения индикатора производится до двух знаков после запятой по правилам математического округления (цифры до пяти уменьшаются до нуля, а цифры от пяти и выше увеличиваются до десяти).

Статья 4. Особые полномочия Рискового комитета Биржи в отношении индикатора

1. Рисковый комитет Биржи вправе корректировать значения индикатора, исключая из их расчета параметры тех сделок, которые, по мнению Рискового комитета, неоправданно влияют (повлияли) на эти значения (например, неисполненных сделок; сделок, при заключении которых участниками торгов были допущены технические ошибки; сделок, цены которых явно диссонируют с рыночным состоянием и/или рыночной динамикой цен соответствующих иностранных валют, что позволяет предполагать их манипуляционную природу).

В случае принятия Рисковым комитетом решения об исключении из расчета индикатора параметров какой-либо сделки (каких-либо сделок) соответствующий перерасчет данного индикатора осуществляется незамедлительно.

2. При использовании Рисковым комитетом Биржи своих особых полномочий в соответствии с пунктом 1 настоящей статьи в протоколе его заседания должны быть отражены причины использования этих полномочий и действия, предпринятые им в соответствии с этими полномочиями.

Президент

Дамитов К.К.