

АО "КАЗАХСТАНСКАЯ ФОНДОВАЯ БИРЖА"

Утверждена

решением Правления
АО "Казахстанская фондовая биржа"

от 10 ноября 2010 года № 395

Введена в действие

с 11 ноября 2010 года

СПЕЦИФИКАЦИЯ ФЬЮЧЕРСА НА КУРС ДОЛЛАРА США К ТЕНГЕ

г. Алматы

2010

ЛИСТ ПОПРАВК

1. Дополнение и изменение № 1:

- утверждены решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 31 января 2012 года № 20);
- введены в действие с 01 февраля 2012 года.

СПЕЦИФИКАЦИЯ ФЬЮЧЕРСА НА КУРС ДОЛЛАРА США К ТЕНГЕ

Инструмент:	срочный контракт
Вид:	фьючерс
Базовый актив:	курс доллара США к тенге
Количество базового актива в срочном контракте:	1.000 (одна тысяча) долларов США
Цена	тенге за один доллар США
День исполнения:	15-ое число определенного месяца исполнения ¹
Срок исполнения ² :	1) три месяца – для трехмесячного фьючерса; 2) шесть месяцев – для шестимесячного фьючерса
Теоретическая цена <i>(данная строка включена решением Правления Биржи от 31 января 2012 года)</i>	$F_{usdkzt} = S_{usdkzt} \cdot \frac{(1 + \frac{r_{kzt}}{100} \cdot \frac{T}{360})}{(1 + \frac{r_{usd}}{100} \cdot \frac{T}{360})}$, где: <p>F_{usdkzt} - теоретическая цена соответствующего фьючерса на курс доллара США к тенге;</p> <p>S_{usdkzt} - средневзвешенный курс доллара США к тенге по итогам утренней торговой сессии (при отсутствии сделок, средневзвешенный курс по итогам предыдущей утренней торговой сессии);</p> <p>r_{kzt} - индикатор казахстанского межбанковского рынка депозитов KazPrime, сроком – 3 месяца, выраженный в процентах;</p> <p>r_{usd} - трехмесячная ставка предложения на лондонском межбанковском рынке депозитов по доллару США, выраженная в процентах;</p> <p>T - количество календарных дней с текущей даты до даты исполнения соответствующего фьючерса (по базе - actual/360).</p>
Окончательная расчетная цена	средневзвешенный курс доллара США по итогам утренней торговой сессии в день исполнения
Исполнение <i>(данная строка изменена решением Правления Биржи от 31 января 2012 года):</i>	без поставки базового актива с выплатой/получением эквивалента в тенге разницы между расчетной ценой, определенной при последней корректировке по рынку, и окончательной расчетной ценой

¹ Месяцем исполнения является один из месяцев, приходящийся на конец квартала: март, июнь, сентябрь, декабрь.

Если 15-ое число месяца исполнения приходится на праздничный или выходной день, то днем исполнения является ближайший после него рабочий день, в который проводятся биржевые торги срочными контрактами.

² Срок исполнения серии срочных контрактов составляет указанное в настоящей Спецификации число месяцев, за исключением первоначального периода биржевых торгов, во время которого допускается открытие срочных контрактов с более коротким сроком исполнения.

В день исполнения трехмесячной серии срочных контрактов шестимесячная серия срочных контрактов, открытая ранее, становится трехмесячной серией срочных контрактов.

В день исполнения срочных контрактов начинаются торги трехмесячными и шестимесячными срочными контрактами, по которым торги ранее не проводились.

Спецификация фьючерса на курс доллара США к тенге

Последний день биржевых торгов:	последний рабочий день, предшествующий дню исполнения данного контракта
Единица измерения цены:	казахстанский тенге за один доллар США с точностью до второго знака после запятой
Тик:	0,01
Стоимостная оценка тика	10 тенге
Уровень поддерживаемой маржи:	80 % от обязательства по начальной марже
Срок исполнения нетто-обязательств перед Биржей:	до 10.00 рабочего дня, следующего за днем, по результатам которого возникли нетто-обязательства