

# АО "КАЗАХСТАНСКАЯ ФОНДОВАЯ БИРЖА"

---

---

**У т в е р ж д е н а**

решением Правления  
АО "Казахстанская фондовая биржа"

(протокол заседания  
от 10 ноября 2015 года № 125)

**Введена в действие**

с 10 ноября 2015 года

## **МЕТОДИКА** расчета индикаторов рынка иностраннных валют

---

---

г. Алматы

2015

## **ЛИСТ ПОПРАВК**

### **1. Изменения и дополнение № 1:**

- утверждены решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 17 августа 2018 года № 86);
- введены в действие с 10 сентября 2018 года.

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

## ГЛАВА 1. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

1. В настоящей Методике используются понятия, определенные другими внутренними документами Биржи.
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. Биржа рассчитывает следующие индикаторы рынка иностранных валют:
  - 1) средневзвешенный курс доллара США к казахстанскому тенге по итогам утренней сессии;
  - 2) средневзвешенный курс доллара США к казахстанскому тенге по итогам утренней и дневной сессий.
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-ресурсе Биржи не менее чем за семь календарных дней до даты ввода в действие этих изменений и/или дополнений.

## ГЛАВА 2. ПОРЯДОК РАСЧЕТА ИНДИКАТОРОВ РЫНКА ИНОСТРАННЫХ ВАЛЮТ

6. Расчет индикаторов рынка иностранных валют осуществляется ежедневно по рабочим дням<sup>1</sup> в соответствии с пунктами 10–13 настоящей Методики.
7. При расчете индикаторов рынка иностранных валют:
  - 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.
8. *(Данный пункт исключен решением Правления Биржи от 17 августа 2018 года).*
9. В целях обеспечения адекватности значений индикаторов рынка иностранных валют объективным характеристикам соответствующего рынка данные значения могут быть скорректированы Комитетом по индексам и оценке ценных бумаг. Условия и порядок такой корректировки определены главой 3 настоящей Методики.
10. Расчет значений индикаторов рынка иностранных валют, указанных в пункте 3 настоящей Методики, осуществляется по окончании утренней и дневной торговых сессий соответственно.
11. При расчете средневзвешенного курса доллара США к казахстанскому тенге как индикатора рынка иностранных валют используются параметры только тех сделок, которые были заключены с долларом США на соответствующих торговых сессиях с исполнением на следующий рабочий день.

---

<sup>1</sup> Под рабочими днями понимаются рабочие дни в Республике Казахстан.

В случае если торги долларом США с исполнением сделок на следующий рабочий день не проводятся, то для расчета индикатора рынка иностранных валют используются параметры сделок, которые были заключены с долларом США на соответствующих торговых сессиях с исполнением на второй рабочий день после дня проведения торгов, с учетом ограничений, установленных пунктом 7 настоящей Методики.

*(Данный пункт изменен решением Правления Биржи от 17 августа 2018 года).*

12. Значение средневзвешенного курса доллара США к казахстанскому тенге как индикатора рынка иностранных валют 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 на утренней торговой сессии (для расчета средневзвешенного курса доллара США по итогам утренней сессии) или на утренней и дневной торговых сессиях (для расчета средневзвешенного курса доллара США по итогам утренней и дневной сессий);

$V_i$  – объем  $i$ -й сделки в долларах США;

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

13. Округление значений индикаторов для публикации 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).

### **ГЛАВА 3. ОСОБЫЕ ПОЛНОМОЧИЯ КОМИТЕТА ПО ИНДЕКСАМ И ОЦЕНКЕ ЦЕННЫХ БУМАГ В ОТНОШЕНИИ ИНДИКАТОРОВ РЫНКА ИНОСТРАННЫХ ВАЛЮТ**

14. Комитет по индексам и оценке ценных бумаг вправе корректировать значения индикаторов рынка иностранных валют, исключая из их расчета параметры тех сделок, которые, по мнению Комитета по индексам и оценке ценных бумаг, 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 Комитетом по индексам и оценке ценных бумаг решения об исключении из расчета того или иного индикатора рынка иностранных валют параметров какой-либо сделки (каких-либо сделок) соответствующий перерасчет данного индикатора осуществляется незамедлительно.

15. При использовании Комитетом по индексам и оценке ценных бумаг своих особых полномочий в соответствии с пунктом 14 настоящей Методики в протоколе его заседания должны быть отражены причины использования этих полномочий и действия, предпринятые Комитетом по индексам и оценке ценных бумаг в соответствии с этими полномочиями.

### **Глава 4. ЗАКЛЮЧИТЕЛЬНЫЕ ПОЛОЖЕНИЯ**

*(Данная глава включена решением Правления Биржи от 17 августа 2018 года)*

16. Ответственность за исполнение настоящей Методики и внесение в нее изменений и/или дополнений (актуализация) возлагается на Департамент информации и статистики.
17. Настоящая Методика подлежит актуализации по мере необходимости, но не реже одного раза в три года.

И.о. Председателя Правления

Хорошевская Н.Ю.