

АО "КАЗАХСТАНСКАЯ ФОНДОВАЯ БИРЖА"

Утверждена
решением Правления
АО "Казахстанская фондовая биржа"
(протокол заседания
от 25 июля 2016 года № 74)

Введена в действие
с 01 августа 2016 года

СПЕЦИФИКАЦИЯ фьючерса на курс доллара США к тенге

ЛИСТ ПОПРАВК

1. Изменения № 1:

- утверждены решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 12 сентября 2018 года № 97);
- введены в действие с 13 сентября 2018 года.

2. Дополнение № 2:

- утверждено решением Правления АО "Казахстанская фондовая биржа" (протокол заседания от 27 сентября 2018 года № 107);
- введено в действие с 28 сентября 2018 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 начала обращения ¹ :	1) каждый понедельник – для недельного фьючерса; 2) 15-ое число определенного месяца исполнения ² – для трехмесячного и шестимесячного фьючерсов.
Последний день обращения	рабочий день, предшествующий дню исполнения – для всех валютных фьючерсов.
День исполнения ³	1) каждый понедельник – для недельного фьючерса; 2) 15-ое число определенного месяца исполнения – для трехмесячного и шестимесячного фьючерсов.
Срок исполнения:	1) одна неделя – для недельного фьючерса; 2) три месяца – для трехмесячного фьючерса; 3) шесть месяцев – для шестимесячного фьючерса.

Теоретическая цена

$$F_{\text{usdkzt}} = S_{\text{usdkzt}} \cdot \frac{(1 + \frac{r_{\text{kzt}}}{100} \cdot \frac{T}{360})}{(1 + \frac{r_{\text{usd}}}{100} \cdot \frac{T}{360})}, \text{ где:}$$

F_{usdkzt} – теоретическая цена соответствующего фьючерса на курс доллара США к тенге;

S_{usdkzt} – средневзвешенный курс доллара США к тенге по итогам утренней (основной) торговой сессии (при отсутствии сделок, средневзвешенный курс по итогам предыдущей утренней (основной) торговой сессии) (*данный абзац дополнен решением Правления Биржи от 27 сентября 2018 года*);

r_{kzt} – индикатор казахстанского межбанковского рынка депозитов KazPrime, сроком – 3 месяца, выраженный в процентах – для трехмесячного и шестимесячного фьючерсов; или индикатор TWINA (Tenge Week Index Average),

¹ Если день начала обращения приходится на праздничный или выходной день, то днем начала обращения является ближайший после него рабочий день, в который проводятся биржевые торги срочными контрактами.

² Здесь и далее месяцем исполнения является один из месяцев, приходящийся на конец квартала: март, июнь, сентябрь, декабрь.

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

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

³ Если день исполнения приходится на праздничный или выходной день, то днем исполнения является ближайший после него рабочий день, в который проводятся биржевые торги срочными контрактами.

выраженный в процентах – для недельного фьючерса;

r_{usd} – трехмесячная ставка предложения на лондонском межбанковском рынке депозитов (LIBOR) по доллару США, выраженная в процентах – для трехмесячного и шестимесячного фьючерсов; или недельная ставка предложения на лондонском межбанковском рынке депозитов (LIBOR) по доллару США, выраженная в процентах – для недельного фьючерса;

T – количество календарных дней с текущей даты до даты исполнения соответствующего фьючерса (по базе - actual/360).

Окончательная расчетная цена: установленный в день исполнения средневзвешенный курс доллара США по итогам утренней и дневной торговых сессий, с расчетами на следующий рабочий день; если по каким-либо причинам торги данным инструментом не проводятся, то применяется средневзвешенный курс доллара США по итогам утренней и дневной торговых сессий, с расчетами T+n.

(данная строка изменена решением Правления Биржи от 12 сентября 2018 года)

Исполнение: без поставки базового актива с выплатой/получением эквивалента в тенге разницы между расчетной ценой, определенной при последней корректировке по рынку, и окончательной расчетной ценой.

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.