

АО "КАЗАХСТАНСКАЯ ФОНДОВАЯ БИРЖА"

У т в е р ж д е н а

решением Правления
АО "Казахстанская фондовая биржа"

(протокол заседания
от 23 августа 2018 года № 88)

Вводится в действие

с 10 сентября 2018 года

СПЕЦИФИКАЦИЯ операций валютного свопа

г. Алматы

2018

Предметы операций: доллары США, евро, российский рубль, юань Китайской Народной Республики.

Сроки операций: один день и два дня.

Расчет цены закрытия:
$$Price_{close} = Price_{open} + \frac{Price_{open} \times Price_{swap} \times swap_{length}}{365 \times 100}$$
, где:

$Price_{close}$ – цена сделки закрытия операции своп (измеряется в тенге, с точностью до шестого знака после запятой);

$Price_{open}$ – цена сделки открытия операции своп (в тенге, с точностью до второго знака после запятой);

в операциях валютного свопа в отношении доллара США в качестве такой цены используется:

средневзвешенная цена всех сделок с этой иностранной валютой, расчеты по которой осуществляются на следующий рабочий день после дня торгов, заключенных в день начала (открытия) данной операции на первой по очередности торговой сессии, на которой эта иностранная валюта торговалась, в случае отсутствия таких сделок используется средневзвешенная цена всех сделок, заключенных в последний результативный день с этой иностранной валютой;

в операциях валютного свопа в отношении евро и рубля в качестве такой цены используется:

средневзвешенная цена всех сделок с этой иностранной валютой с указанным сроком осуществления расчетов, заключенных в день начала (открытия) данной операции на первой по очередности торговой сессии, на которой эта иностранная валюта торговалась с указанным сроком осуществления расчетов, в случае отсутствия таких сделок используется средневзвешенная цена всех сделок, заключенных в последний результативный день с этой иностранной валютой;

в операциях валютного свопа в отношении юаня в качестве такой цены используется средневзвешенная цена всех сделок, заключенных в последний результативный день с этой иностранной валютой;

$Price_{swap}$ – цена операции своп (измеряется в процентах годовых, с точностью до четвертого знака после запятой);

$swap_{length}$ – срок операции своп в днях (количество календарных дней между датами расчетов сделок открытия и закрытия).

Расчет объема открытия:

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

$Volume_{swap}$ – объем операции своп (в единицах инструмента).

Расчет объема закрытия:

$Volume_{close} = Price_{close} \times Volume_{swap}$