

АО "КАЗАХСТАНСКАЯ ФОНДОВАЯ БИРЖА"

ПРЕСС-РЕЛИЗ

г. Алматы

29 декабря 2008 года

На Казахстанской фондовой бирже запущен рынок операций валютного свопа

29 декабря 2008 года Казахстанская фондовая биржа (KASE) запустила для участников биржевых торгов иностранными валютами рынок операций валютного свопа. Предметом данных операций является доллар США как наиболее ликвидная иностранная валюта на казахстанском рынке.

В открытии первых операций валютного свопа приняли участие четыре члена KASE категории "B", которые в ходе торгов подали 33 заявки. Результатом торговли стала одна операция типа USD_TOD_TOM на сумму 5,0 млн долларов США по цене +0,02 тенге за единицу валюты при торговом обороте (денежном эквиваленте суммарного объема сделок, входящих в операцию валютного свопа) 1.207,6 млн тенге.

Запуск рынка операций валютного свопа осуществлен в рамках реализации Стратегии развития KASE на 2007–2010 годы в целях расширения перечня финансовых инструментов, доступных членам KASE.

Операция валютного свопа представляет собой совокупность двух одновременно заключаемых между двумя одними и теми же участниками торгов и противоположных по направлению друг к другу сделок с одним и тем же количеством одной и той же иностранной валюты, различающихся между собой сроками осуществления расчетов. Сделка с более ранним сроком осуществления расчетов является сделкой открытия операции валютного свопа, а вторая сделка – сделкой ее закрытия.

В качестве цены операции валютного свопа используется разница между ценами доллара США согласно сделкам ее открытия и закрытия. При этом в качестве цены сделки открытия операции валютного свопа используется средневзвешенная цена всех сделок с USD_TOD или USD_TOM, заключенных на утренней торговой сессии, а цена сделки закрытия данной операции (USD_TOM или USD_SPT) определяется торговой системой KASE автоматически как сумма цены сделки открытия операции валютного свопа и самой цены данной операции. Сделки с USD_TOM могут использоваться для открытия операций валютного свопа только в случае, если в день такого открытия USD_TOM торгуется на утренней торговой сессии.

Справочно: USD_TOD – сокращенное обозначение (торговый код) доллара США, торгуемого с расчетами T+0 (с исполнением сделок в день торгов), USD_TOM – торговый код доллара США, торгуемого с расчетами T+1 (с исполнением сделок на следующий рабочий день после дня торгов), USD_SPT – торговый код доллара США, торгуемого с расчетами T+2 (с исполнением сделок на второй рабочий день после дня торгов).

Утренняя торговая сессия (с 10.15 до 11.00 алматинского времени) является основной для USD_TOD. USD_TOM торгуется на данной сессии в случае, если банки – корреспонденты KASE по доллару США не осуществляют расчеты в этой валюте в день торгов.

USD_TOD_TOM – сокращенное обозначение (торговый код) операции валютного свопа, сделкой открытия которого является сделка с USD_TOD, а сделкой закрытия – сделка с USD_TOM.

USD_TOD_SPT – торговый код операции валютного свопа, сделкой открытия которого является сделка с USD_TOD, а сделкой закрытия – сделка с USD_SPT.

Цена операции валютного свопа измеряется в казахстанских тенге с точностью до второго знака после запятой, то есть так же, как цена торгуемого на KASE доллара США.

Операции валютного свопа открываются в торговой системе KASE в рамках дневной торговой сессии по иностранным валютам с 11.30 до 15.30 алматинского времени. Размер лота при осуществлении операций валютного свопа составляет 50.000 долларов США. Этой величине должен быть равен или кратен размер заявки на заключение сделки открытия операции валютного свопа.

Основным методом торгов при осуществлении операций валютного свопа является метод непрерывного встречного аукциона.

Участниками операций валютного свопа являются члены KASE категории "B", то есть обладающие правом участия в биржевых торгах иностранными валютами. Членами KASE по указанной категории являются в основном банки.

На начальном этапе работы данного рыночного сегмента результаты операций валютного свопа будут публиковаться в новостях KASE. После появления регулярной активности по этим операциям их результаты будут отражаться на Интернет-сайте KASE в разделе, посвященном рынку иностранных валют, по адресу <http://www.kase.kz/ru/cur>.

Новый биржевой сервис предоставляет широкие возможности по его использованию, что дает KASE основания рассчитывать на значительный интерес к нововведению со стороны участников биржевого валютного рынка. KASE рассматривает в качестве дополнительных стимулов отсутствие специального налогообложения операций валютного свопа, а также нулевой тариф KASE в отношении данных операций, который в соответствии с решением Биржевого совета от 25 декабря 2008 года будет применяться минимум до июня 2009 года.

Опрос членов KASE показал существенный потенциал рынка операций валютного свопа. Кроме того, на популярность нового биржевого сервиса позволяет рассчитывать успешный опыт ЗАО "Московская межбанковская валютная биржа", где также функционирует аналогичный сегмент валютного рынка.