

Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің туынды қаржы құралдарымен операциялар жүргізуі қағидаларын бекіту туралы

Күшін жойған

Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі Басқармасының 2016 жылғы 28 қаңтардағы № 16 қаулысы. Қазақстан Республикасының Әділет министрлігінде 2016 жылы 25 ақпанда № 13226 болып тіркелді. Күші жойылды - Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі Басқармасының 2019 жылғы 19 қарашадағы № 196 қаулысымен

Ескерту. Қаулының күші жойылды – ҚР Ұлттық Банкі Басқармасының 19.11.2019 № 196 (01.01.2020 бастап қолданысқа енгізіледі) қаулысымен.

"Қазақстан Республикасының кейбір заңнамалық актілеріне екінші деңгейдегі банктердің жұмыс істемейтін кредиттері мен активтері, қаржылық қызметтер көрсету және қаржы ұйымдары мен Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің қызметі мәселелері бойынша өзгерістер мен толықтырулар енгізу туралы" 2015 жылғы 24 қарашадағы Қазақстан Республикасының Заңын іске асыру мақсатында Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің Басқармасы **ҚАУЛЫ ЕТЕДІ:**

1. Қоса беріліп отырған Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің туынды қаржы құралдарымен операциялар жүргізуі қағидалары бекітілсін.

2. Монетарлық операциялар және активтерді басқару департаменті (Молдабекова Ә.М.) заңнамада белгіленген тәртіппен:

1) Құқықтық қамтамасыз ету департаментімен (Сәрсенова Н.В.) бірлесіп осы қаулыны Қазақстан Республикасының Әділет министрлігінде мемлекеттік тіркеуді;

2) осы қаулыны "Қазақстан Республикасы Әділет министрлігінің Республикалық құқықтық ақпарат орталығы" шаруашылық жүргізу құқығындағы республикалық мемлекеттік кәсіпорнына:

Қазақстан Республикасының Әділет министрлігінде мемлекеттік тіркелгенінен кейін күнтізбелік он күн ішінде "Әділет" ақпараттық-құқықтық жүйесінде ресми жариялауға;

Қазақстан Республикасының Әділет министрлігінде мемлекеттік тіркелгеннен кейін оны Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкі алған күннен бастап күнтізбелік он күн ішінде Қазақстан Республикасы нормативтік құқықтық актілерінің мемлекеттік тізіліміне, Қазақстан Республикасы нормативтік құқықтық актілерінің эталондық бақылау банкіне енгізуге жіберуді;

3) осы қаулы ресми жарияланғаннан кейін оны Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің ресми интернет-ресурсына орналастыруды қамтамасыз етсін.

3. Халықаралық қатынастар және жұртшылықпен байланыс департаменті (Қазыбаев А.Қ.) осы қаулыны Қазақстан Республикасының Әділет министрлігінде мемлекеттік тіркелгеннен кейін күнтізбелік он күн ішінде мерзімді баспасөз басылымдарында ресми жариялауға жіберуді қамтамасыз етсін.

4. Осы қаулының орындалуын бақылау Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкі Төрағасының орынбасары Ғ.О. Пірматовқа жүктелсін.

5. Осы қаулы алғашқы ресми жарияланған күнінен кейін күнтізбелік он күн өткеннен соң қолданысқа енгізіледі және 2016 жылғы 1 ақпаннан бастап туындаған қатынастарға қолданылады.

Ұлттық Банк

Төрағасы

Д. Ақышев

Қазақстан Республикасы
Ұлттық Банкі Басқармасының
2016 жылғы 28 қаңтардағы
№ 16 қаулысымен бекітілді

Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің туынды қаржы құралдарымен операциялар жүргізуі қағидалары

1. Осы Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің туынды қаржы құралдарымен операциялар жүргізуі қағидалары (бұдан әрі – Қағидалар) 1994 жылғы 27 желтоқсандағы Қазақстан Республикасының Азаматтық кодексіне (Жалпы бөлім) (бұдан әрі – Азаматтық кодекс), 1995 жылғы 30 наурыздағы "Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкі туралы" (бұдан әрі – Ұлттық Банк туралы заң), 2003 жылғы 2 шілдедегі "Бағалы қағаздар рыногы туралы" (бұдан әрі – Бағалы қағаздар нарығы туралы заң) Қазақстан Республикасының Заңдарына сәйкес әзірленді және Қазақстан Республикасының қаржы жүйесінің тұрақтылығын қамтамасыз етуге, Қазақстан Республикасының мемлекеттік ақша-кредит саясатын (бұдан әрі – ақша-кредит саясаты) жүргізуге, нарық конъюктурасының өзгеруінен болатын әлеуетті шығындар тәуекелін барынша азайтуға бағытталған шараларды әзірлеу және жүзеге асыру үшін және Ұлттық Банктің алтын-валюта активтері (бұдан әрі – алтын-валюта активтері) және Ұлттық қордың (бұдан әрі – Ұлттық қор) активтері портфельдерінің кірістілігін арттыру мақсатында Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің (бұдан әрі – Ұлттық Банк) туынды қаржы құралдарымен операциялар жүргізуі тәртібін айқындайды.

1. Негізгі ережелер

2. Қағидаларда Азаматтық кодексте, Бағалы қағаздар нарығы туралы заңда көзделген, сондай-ақ мынадай ұғымдар пайдаланылады:

1) алтын-валюта активтері портфелі – Ұлттық Банк туралы заңға сәйкес алтын-валюта резервтерінен және өзге де активтерден тұратын портфель;

2) аутрайт мәмілесі – бір валютаны валюталау күні мәмілені жасау күнінен бөлек болатын басқа валютаға қарсы сатып алу туралы тараптар арасындағы келісім;

3) банкаралық нарық – ұйымдастырылмаған нарықта шетел валютасын және қаржы құралдарын сатып алу немесе/және сату операцияларын жүргізген кезде туындайтын қатынастар жиынтығы;

4) биржа нарығы – сауда-саттықтарды ұйымдастырушылық және техникалық қамтамасыз етуді, оларды тікелей өткізу арқылы жүзеге асыратын сауда-саттықты ұйымдастырушының сауда жүйелері пайдаланылатын қатынастар жиынтығы;

5) биржадан тыс банкаралық нарық – биржадан тыс нарықта шетел валютасын, және қаржы құралдарын сатып алу немесе/және сату операцияларын жүргізген кезде туындайтын қатынастар жиынтығы;

6) биржадан тыс нарық – бағалы қағаздар нарығына кәсіби қатысушылардың сауда-саттықты ұйымдастырушысының сауда жүйелері пайдаланылмайтын қатынастарының жиынтығы;

7) жинақтау портфелі – мақсаты ұзақмерзімді перспективада активтердің кірістілігін арттыру болып табылатын Ұлттық қор активтерінің портфелі;

8) кредиттік-дефолттық своп – туынды қаржы құралы, оған сәйкес кредиттік қорғауды сатушы белгілі кредиттік оқиға басталған жағдайда қарсы әріптестен базалық актив бойынша міндеттемелерді олардың номиналдық құны бойынша сатып алуға міндеттенеді, ал сатып алушы оның орнына кредиттік қорғауды сатушыға сыйлықақы төлейді;

9) кредиттік қорғау – эмитенттің кредиттік рейтингісінің ықтимал төмендеуінен немесе эмитенттің ықтимал дефолтынан сақтандыру;

10) кредиттік оқиға – қарыз алушының кредит қабілеттілігінің немесе қаржы құралының кредиттік сапасының өзгеруі;

11) кредиттік рейтинг – эмитенттің шамамен алғандағы кредит қабілеттілігін немесе оның бағалы қағаздарының сапасы мен сенімділігін белгілейтін бағаның жеке сандық және әріппен белгіленген көрсеткіші;

12) қарсы әріптес – Ұлттық Банк тиісті келісімдердің/шарттардың негізінде туынды қаржы құралдарымен операциялар жүргізетін/ мәмілелер жасайтын заңды тұлға;

13) мидл-офис – Ұлттық Банктің Монетарлық операциялар және активтерді басқару департаментінің қаржы нарықтарын және алтын-валюта активтерінің және Ұлттық қор портфельдерін талдауды жүзеге асыруға уәкілетті бөлімшесі;

14) опцион колл – опционның түрі, оған сәйкес бір тарап (опцион коллды сатушы) келешекте базалық активті басқа тараптан (опцион коллды сатушыдан) опцион коллдың (страйк) орындалу бағасы бойынша сатып алу құқығын басқа тарапқа (опцион коллды сатып алушыға) сатады;

15) опцион пут – опционның түрі, оған сәйкес бір тарап (опцион путты сатушы) келешекте базалық активті басқа тарапқа (опцион путты сатушыға) опцион путты (страйк) орындау бағасы бойынша сату құқығын басқа тарапқа (опцион путты сатып алушыға) сатады;

16) пайыздық мөлшерлеме – туынды қаржы құралын сатып алушы мәміледе айқындалған уақыт ішінде оны пайдаланғаны үшін төлейтін, пайызбен көрсетілген сома;

17) пайыздық своп – туынды қаржы құралы, оған сәйкес бір тарап басқа тарапқа белгіленген күні белгілі сомаға пайызды төлейді және басқа тараптан келісілген мөлшерлеме бойынша пайыз сомасына төлем алады;

18) портфель – қаржы құралдарының жиынтығы, оның ішінде қолма-қол валюта;

19) принципал – мәміле жасалатын номиналды сома, оның негізінде пайыздық мөлшерлеме бойынша төлемдер есептеледі;

20) свопцион – бір тарап (свопционды сатушы) басқа тарапқа (свопционды сатып алушыға) келешекте белгілі күні пайыздық своппен операция жасау құқығын сататын туынды қаржы құралы;

21) сыртқы қаржы нарығы – Қазақстан Республикасының резиденттері және Қазақстан Республикасының бейрезиденттері арасында шет мемлекетінің заңнамасына сәйкес мәмілелер жасау барысында қалыптасатын қатынастар жиынтығы;

22) тараптар – Ұлттық Банк және қарсы әріптес;

23) тұрақтандыру портфелі – мақсаты активтердің өтімділігін арттыру және қысқамерзімді перспективада кірістілікті ұлғайту болып табылатын Ұлттық қор активтерінің портфелі;

24) Ұлттық қордың портфелі – жинақтау және тұрақтандыру портфельдерінен тұратын портфель;

25) форвардтық пайыздық мөлшерлеме – тараптар келешекте құбылмалы және белгіленген пайыздық мөлшерлемелер негізінде төлемдермен алмасу туралы уағдаласатын мөлшерлеме;

26) форвардтық пайыздық мөлшерлемесі бар шарт – туынды қаржы құралы, оған сәйкес бір тарап (форвардтық пайыздық мөлшерлесі бар шартты сатушы)

басқа тарапқа (форвардтық пайыздық мөлшерлесі бар шартты сатып алушыға) базалық активті форвардтық пайыздық мөлшерлеме бойынша сатып алу немесе сату құқығын сатады;

27) фронт-офис – Ұлттық Банктің Монетарлық операциялар және активтерді басқару департаментінің туынды қаржы құралдарымен операциялар жүргізуге уәкілетті бөлімшесі;

28) ішкі қаржы нарығы – Қазақстан Республикасы резиденттерінің арасында Қазақстан Республикасының заңнамасына сәйкес мәмілелер жасау барысында қалыптасатын қатынастар жиынтығы;

29) "Reuters Dealing", "Bloomberg", "Barra" жүйелері – мәмілелер жасау мақсатында пайдаланушыларының арасында байланыс жүзеге асырылатын мамандандырылған бағдарламалық қамтамасыз етулер мен жабдықтар кешендері ;

30) GOFO (Gold Forward Offered Rate) – қарсы әріптестер американдық доллардың орнына алтын беруге дайын болатын алтынмен мәмілелер бойынша форвардтық пайыздық мөлшерлеме;

31) LIBOR (London Interbank Offered Rate) – лондондық банкаралық нарықта әртүрлі валюталармен және әртүрлі мерзімдерге қаражат беруді ұсынатын банктер беретін банкаралық кредиттер бойынша орташа алынған пайыздық мөлшерлеме.

3. Ұлттық Банк туынды қаржы құралдарымен операцияларды ұлттық валютада да, шетел валютасында да жүргізеді.

4. Ұлттық Банк туынды қаржы құралдарымен операцияларды нарық конъюктурасының өзгеруінен болған әлеуетті зиян тәуекелін азайту мақсатында, сондай-ақ алтын-валюта активтері және Ұлттық қор активтері портфельдерінің кірістілігін арттыру мақсатында жүргізеді.

Ұлттық Банк своппен операцияларды валюталық, пайыздық және кредиттік тәуекелдерді төмендету, аутрайт мәмілелерін жүргізген кезде базалық активте өтімділікті ұстап тұру, сондай-ақ олар бойынша ашық позицияларды ұзарту үшін жүргізеді.

Форвардпен және опционмен операциялар нарықтағы бағаның жағымсыз өзгеруі салдарынан ықтимал жоғалтулардан хеджирлеу мақсатында жүргізіледі.

Пайыздық своппен және форвардтық пайыздық мөлшерлемесі бар шарт бойынша операциялар пайыздық мөлшерлемелердің жағымсыз өзгеруінен хеджирлеу және депозиттерді орналастырумен байланысты кредиттік тәуекелді барынша азайта отырып, ұзақмерзімді кезеңде неғұрлым жоғары кірістілік алу мақсатында жүргізіледі. Сондай-ақ, пайыздық своппен операциялар бағалы қағаздармен, валютамен және алтынмен активтердің кірістілігін арттыру не ақша-кредит саясатын іске асыру шеңберінде пайдаланылады.

Фьючерспен операциялар алтын-валюта активтері мен Ұлттық қордың активтері портфельдерін бағалы қағаздардағы, валютадағы және алтындағы пайыздық тәуекелден хеджирлеу, сондай-ақ бағалы қағаздармен, валютамен және алтынмен активтердің кірістілігін арттыру мақсатында жүргізіледі.

Свопционмен операциялар пайыздық своптар бойынша ашық позицияларды хеджирлеу және бағалы қағаздармен, валютамен және алтынмен активтердің кірістілігін арттыру мақсатында жүргізіледі.

5. Ұлттық Банк туынды қаржы құралдарымен операцияларды шетел валютасындағы және бағалы металдардағы активтермен операциялар шеңберінде сыртқы қаржы нарығында жүргізеді.

6. Ішкі қаржы нарығында туынды қаржы құралдарымен операциялар мәмілелер жасау туралы келісімдердің негізінде Ұлттық Банк пен қарсы әріптестің арасында жүргізіледі.

7. Тараптар мәмілелерді биржадан тыс банкаралық нарықта телефон байланысы, "Reuters Dealing", "Bloomberg", "Barra" жүйесі арқылы, биржа нарығында биржаның сауда жүйесі немесе қарсы әріптес банк арқылы жасайды.

8. Қарсы әріптестерден келіп түскен ұсыныстарды және баға белгілеулерді салыстырып талдауды, деректердің (валюта бағамдары, пайыздық мөлшерлемелер) болжамдық мәндерін айқындауды, туынды қаржы құралдарымен операцияларды фронт-офис жүргізеді.

9. Ұлттық Банк сатып алған туынды қаржы құралдарын бағалауды мидл-офис "Reuters Dealing", "Bloomberg", "Barra" жүйелерінің, сондай-ақ кастодиандар мен қарсы әріптестердің деректері негізінде жүзеге асырады.

2. Своппен және форвардпен операциялар жүргізу тәртібі

10. Своппен немесе форвардпен операциялар жүргізген кезде тарап басқа тараптан мәміленің негізгі талаптарын (мәміленің валютасын және қарсы валютасын, спот бағамын, форвард бағасын, форвард бағам-аутрайтты, мәміле мерзімін, мәміле бойынша валюталандыру күнін) көрсете отырып, бағалы қағаздармен операциялар бойынша валютамен мәмілелер бойынша форвард (своп) тармақтарын немесе форвард бағаларын белгілеуді сұратады.

11. Қағидалардың 10-тармағында көзделген форвард операциялары бойынша жасалатын мәмілелердің негізгі талаптары тараптар арасында келіссөздер жүргізу барысында келісіледі.

12. Форвард операциялары бойынша жасалатын мәмілелер жасалғаннан кейін дилер Қағидалардың 10-тармағында көзделген мәмілелердің негізгі талаптары көрсетілетін мәміле паспортын дайындайды.

3. Форвардтық пайыздық мөлшерлемесі бар шарт бойынша операциялар жүргізу тәртібі

13. Форвардтық пайыздық мөлшерлемесі бар шарт бойынша операциялар бойынша белгіленген пайыздық мөлшерleme мәміле жасалған сәтте, ал өзгермелі пайыздық мөлшерleme болашақта айқындалады.

14. Сыртқы қаржы нарығында форвардтық пайыздық мөлшерлемесі бар шарт бойынша операциялар жүргізген кезде тарап басқа тараптан белгіленген пайыздық мөлшерлемені белгілеуді сұратады және мәміленің негізгі шарттарын (мәміле түрін (сатып алу/сату), мәміле валютасын, белгіленген пайыздық мөлшерлемені, форвардтық кезеңін (мәміле жасалған күннен бастап фиксинг күніне дейінгі уақыт кезеңі) және депозиттік кезең (фиксинг күнінен бастап мәміленің аяқталған күніне дейінгі уақыт кезеңі), мәміленің жасалған күнін, фиксинг күнін (ағымдағы нарықтық спот мөлшерлемесі анықталған күнді) мәміле бойынша валюталандыру күнін (мәміле бойынша есеп айырысуды жүргізу күнін), мәміленің аяқталған күнін, есеп айырысу үшін базаны) айқындайды.

15. Қағидалардың 14-тармағында көзделген форвардтық пайыздық мөлшерлемесі бар шарт бойынша мәмілелердің негізгі талаптары тараптар арасында келіссөздер жүргізу барысында келісіледі.

16. Форвардтық пайыздық мөлшерлемесі бар шарт бойынша операциялар бойынша пайыздық мөлшерleme уақыт кезеңі арқылы пайыздық кезеңге белгіленетін форвард мөлшерлемесін білдіреді. Форвардтық пайыздық мөлшерлемесі бар шарт бойынша операциялар бойынша пайыздық мөлшерleme банкаралық нарықта айқындалады.

17. Форвардтық пайыздық мөлшерлемесі бар шарт бойынша операциялар бойынша есеп айырысулар белгіленген пайыздық мөлшерleme мен нарықта ағымдағы пайыздық мөлшерleme бойынша дисконтталған, базалық актив сомасы (принципал) бойынша есептелетін ағымдағы пайыздық мәміле арасындағы айырманы төлеу арқылы депозиттік кезеңнің басында (бағалы қағаздар үшін LIBOR мөлшерleme бойынша, алтын үшін (LIBOR, GOFO) мөлшерleme бойынша) форвард кезеңі аяқталған сәтке (дисконттау кезеңі депозит мерзіміне тең) жүзеге асырылады.

18. Жасалған мәміле бойынша өтемақы төлемдерінің сомасы мына формула бойынша есептеледі:

$$\frac{\text{Принципал} \times (R_s - R_f) \times T / D}{1 + R_s \times T / D}$$

мұнда, Принципал – форвардтық пайыздық мөлшерлемесі бар шарт бойынша операциялар бойынша номиналдық сомасы;

R_s – ағымдағы өзгермелі мөлшерлеме;

R_f – форвардтық пайыздық мөлшерлемесі бар шарт бойынша операциялар бойынша белгіленген мөлшерлеме;

D – бір жылдағы күн саны (фунт стерлингті қоспағанда барлық валюта үшін 360 күн, фунт стерлинг үшін – 365 күн);

T – депозиттік кезең - форвардтық пайыздық мөлшерлемесі бар шарт бойынша операциялар шеңберінде форвард мөлшерлемесі есептелген уақыт.

19. Форвардтық пайыздық мөлшерлемесі бар шарт бойынша операциялар жүргізілгеннен кейін дилер Қағидалардың 14-тармағында көзделген мәмілелердің негізгі талаптары көрсетілетін мәміле паспортын дайындайды.

4. Пайыздық своппен операциялар жүргізу тәртібі

20. Пайыздық своппен операциялар жүргізген кезде тарап басқа тараптан базалық актив бойынша белгіленген пайыздық мөлшерлемені белгілеуді сұратады, мәміленің негізгі талаптарын (мәміле валютасын, мәміле кезеңін, пайыздық кезеңдерді, мәміле жасалған және аяқталған күнді, белгіленген мөлшерлемені және LIBOR, GOFO мөлшерлемені (алтынмен пайыздық своп бойынша мәмілелер үшін), есеп айырысу үшін базаны) айқындайды.

21. Қағидалардың 20-тармағында көзделген пайыздық своппен мәмілелердің негізгі талаптары тараптар арасында келіссөздер жүргізу барысында келісіледі.

22. Пайыздық своппен операцияларды жүргізген кезде, тараптар өзгермелі және белгіленген мөлшерлемелер негізінде төлемдермен алмасады. Төлемдер сомасы принципал негізінде есептеледі.

23. Пайыздық своппен операциялар жүргізілгеннен кейін дилер Қағидалардың 20-тармағында көзделген мәмілелердің негізгі талаптары көрсетілетін мәміле паспортын дайындайды.

5. Кредиттік-дефолттық своппен операциялар жүргізу тәртібі

24. Кредиттік-дефолттық своппен операциялар жүргізген кезде тарап сатып алушыдан (сатушыдан) баға, сыйлықақы туралы мәліметтерді кредиттік қорғауды сұратады және мәміленің негізгі талаптарын (мәміле валютасын, мәміле кезеңін, базалық активтің атауын, сыйлықақы мөлшерін, сыйлықақы төлеу кезеңдерін, мәміле жасалған және аяқталған күндерді, кредиттік ахуал туындаған жағдайда кредиттік қорғауды сатушы сатып алатын активтердің сипатын) айқындайды. Сыйлықақы мәміле сомасынан пайыздық арақатынаста көрсетіледі.

25. Қағидалардың 24-тармағында көзделген кредиттік-дефолттық своппен операциялардың негізгі талаптары тараптар арасында келіссөздер жүргізу барысында келісіледі.

26. Кредиттік-дефолттық своппен операциялар жүргізілгеннен кейін дилер Қағидалардың 24-тармағында көзделген мәмілелердің негізгі талаптары көрсетілетін мәміле паспортын дайындайды.

6. Опционмен операциялар жүргізу тәртібі

27. Тарап биржадан тыс нарықта опционмен операциялар жүргізген кезде басқа тараптан опцион бағасын (сыйлықақысын) көрсетуді сұратады, мәміленің негізгі талаптарын (опционның түрін, опционның типін (колл, пут немесе олардың комбинациясын), базалық актив және мәміле валютасын, мәміленің негізгі сомасын, орындау бағасын (страйк), сыйлықақы мөлшерін, орындау күнін , валюталандыру күнін) айқындайды.

28. Биржалық нарықта опционмен операциялар жүргізген кезде тараптар сыйлықақы мөлшерін, валюталандыру күнін, сондай-ақ опционның осы түрі үшін өзге де стандартты талаптарды келіседі.

29. Сыйлықақы мәміленің базалық активі номиналынан базистік тармақтармен немесе базалық актив бағасына пайызбен (орындау бағасы) көрсетіледі және мәміле талаптарына сәйкес мәміле жасау күні төленеді.

30. Қағидалардың 27-тармағында көзделген биржадан тыс нарықта опционмен операциялардың негізгі талаптары тараптар арасында жүргізілген келіссөздер барысында келісіледі.

31. Опцион путтың және опцион коллдың комбинациясы осы мәмілелердің нетто-позициясы бойынша бағаланады.

32. Опционды орындау кезінде сатып алушы сатушыға опционның орындалғаны туралы хабарламаны "Reuters Dealing", "Bloomberg", "Barra" жүйесі және байланыстың басқа да құралдары арқылы ұсынады.

33. Опционмен операциялар жүргізілгеннен кейін дилер Қағидалардың 27-тармағында көзделген мәмілелердің негізгі талаптары көрсетілетін мәміле паспортын дайындайды.

7. Свопционмен операциялар жүргізу тәртібі

34. Свопционмен операциялар жүргізген кезде тарап басқа тараптан Қағидалардың 27-тармақтарына сәйкес мәміленің негізгі талаптарын сұратады және келіседі, ал мәміле орындалған жағдайда сатушыға Қағидалардың 32-тармағына сәйкес хабарлама ұсынады.

35. Свопционмен операциялар бойынша жасалатын мәмілелер орындалған жағдайда свопцион пайыздық свопка айырбасталады, ал свопционды орындау бағасы - бұл пайыздық своп бойынша белгіленген мөлшерлеме.

36. Свопционмен операциялар жүргізілгеннен кейін дилер Қағидалардың 27-тармағында көзделген мәміленің негізгі талаптары көрсетілетін мәміле паспортын дайындайды.

8. Фьючерспен операциялар жүргізу тәртібі

37. Сыртқы қаржы нарығында фьючерспен операциялар жүргізілген кезде тарап басқа тараптан баға белгілеуді сұратады не фьючерспен операциялар бойынша жасалатын мәмілені орындауға өтінім береді және мәміленің негізгі талаптарын (фьючерстің түрін (мәміленің базалық активін), мәміле типін (сатып алу/сату), фьючерс валютасын, мәміле санын, мәміле сомасын, сатып алу/сату бағасын, мәмілені валюталандыру күнін, фьючерсті өтеу күнін) айқындайды.

38. Фьючерсті сатып алу бойынша операциялар жүргізген кезде бір тарап операциялар бойынша мәмілелерді орындау мерзімі болған кезде басқа тараптан базалық активті сатып алуға және осы фьючерспен операциялар үшін белгіленген тәртіпке сәйкес сатып алу бағасына сай ақша төлеуге міндеттеме қабылдайды.

39. Фьючерсті сату бойынша операциялар жүргізген кезде бір тарап операциялар бойынша мәмілелерді орындау мерзімі болған кезде басқа тарапқа базалық активті сатуға және келісілген сату бағасы бойынша ақша алуға міндеттеме қабылдайды.

40. Фьючерспен операциялар бойынша жеткізу үшін бағалы қағаздардың көлемін анықтау мақсатында осы бағалы қағазды жеткізу бағасы айқындалатын айырбастау коэффициенті қолданылады:

$$K = PV / P$$

K – Айырбастау коэффициенті

PV – Бағалы қағаздардың болашақ ақша ағындарының ағымдағы құны

P – Паритет бойынша құны

$$DP = K \times FP$$

DP – Жеткізу бағасы

FP – Фьючерс бағасы.

41. Фьючерспен операциялар жүргізілгеннен кейін дилер Қағидалардың 37-тармағында көзделген мәмілелердің негізгі талаптары көрсетілетін мәміле паспортын дайындайды.

