

«ЗАТВЕРДЖЕНО»

Біржовою Радою ПрАТ «ФБ «ПЕРСПЕКТИВА»

Протокол № 24/06/20-01 від 20.06.2024 р.

ФОРМУЛИ РОЗРАХУНКУ ПАРАМЕТРІВ ВАЛЮТНОГО СВОПУ

Оприлюднено відповідно до вимог Правил БТМ деривативних контрактів ПРИВАТНОГО АКЦІОНЕРНОГО ТОВАРИСТВА «ФОНДОВА БІРЖА «ПЕРСПЕКТИВА» з метою визначення кількості розрахункового базового активу за другою частиною Свопу, дати розрахунків за другою частиною Свопу, а також інших параметрів Свопу, що здійснюється на підставі умов (даних), які містяться в Заявці на укладання Свопу.

Терміни, що вживаються нижче, використовуються відповідно до законодавства України, Правил БТМ, Специфікації Контракту та Правил клірингу.

1. ТЕРМІНИ ТА ПОЗНАЧЕННЯ.

Своп (Контракт)	поставний деривативний контракт грошового ринку, базовими активами якого є іноземна валюта та гривня, умови якого визначаються Специфікацією, законодавством України, Правилами БТМ та Правилами клірингу, та який складається з двох взаємопов'язаних частин (першої частини та другої частини): <ul style="list-style-type: none">• за першою частиною, у день укладення Контракту, одна сторона зобов'язана передати другій стороні визначену Контрактом кількість основного базового активу, а друга сторона - у день укладення Контракту передати першій стороні визначену першою частиною Контракту кількість розрахункового базового активу;• за другою частиною, у визначений Контрактом день, друга сторона зобов'язана передати першій стороні ту саму кількість основного базового активу, яка була передана за першою частиною, а перша сторона зобов'язана передати другій стороні визначену другою частиною Контракту кількість розрахункового базового активу. Контракт - Своп, що укладається на Торгах з використанням Торговельної системи у вигляді електронного документа
Заявка	заявка, подана для на укладання Свопу
Код	параметр першої частини Контракту, що вказаний в Заявці та визначає термін
розрахунків	та умови (спосіб) виконання розрахунків за першою частиною Контракту
СУМ	сума першої частини Контракту, що вказана у Заявці та виражена у валюті розрахунків з точністю до двох знаків після коми
СУМ ₁	кількість розрахункового базового активу в першій частині Контракту (сума першої частини Контракту), виражена у валюті розрахунків (гривні) з точністю до 2 знаків після коми
СУМ ₂	кількість розрахункового базового активу в другій частині Контракту (сума другої частини Контракту), виражена у валюті розрахунків (гривні) з точністю до 2 знаків після коми
Д	сума процентного доходу (витрат) за Контрактом, яка виражається у валюті розрахунків з точністю до 2 знаків після коми
К	вказана у Заявці кількість основного базового активу в першій та другій частині Контракту
Ц ₁ , Ц ₂	ціни за одиницю основного базового активу в першій та другій частинах Контракту, виражені у валюті розрахунків
С _%	ставка Свопу у відсотках річних, вказана у Заявці; використовується для розрахунку кількості розрахункового базового активу за другою частиною Свопу
СТ	Строк Свопу, вказаний у Заявці та виражений в календарних днях (проміжок часу між датами виконання першої та другої частин Свопу)
T ₁ , T ₂	дати виконання першої та другої частини Контракту (дати розрахунків за першою та другою частинами Контракту)
T ₃₆₅ , T ₃₆₆	кількість днів між виконанням першої та другої частинами Контракту, що припадають на календарні роки, які складаються з 365 та 366 днів. У випадку, якщо дати виконання першої та другої частин Контракту співпадають, дорівнюють 1 (одиниці). Визначаються, виходячи із вказаного в Заявці строку Свопу: $T_{365} + T_{366} = СТ$

2. ФОРМУЛИ ДЛЯ РОЗРАХУНКІВ.

Ціна для першої частини Контракту розраховується відповідно до інформації, зазначеної в Заявці Учасником торгів:

$$Ц_1 = \frac{СУМ}{К}$$

Кількість розрахункового базового активу в першій частині Контракту (сума першої частини Контракту):

$$СУМ_1 = Ц_1 \cdot К$$

Дата розрахунків за першою частиною Контракту (дата виконання другої частини Контракту) T_1 визначається відповідно до дати проведення торгів (дати укладання Контракту).

Дата розрахунків за другою частиною Контракту (дата виконання другої частини Контракту) T_2 визначається строком Свопу, зазначеним учасником торгів в Заявці, на підставі якої укладається Контракт, шляхом додавання строку Свопу до дати виконання першої частини Контракту:

$$T_2 = T_1 + СТ$$

Ціна для другої частини Контракту:

$$Ц_2 = Ц_1 + \left(Ц_1 \cdot \frac{C\%}{100\%} \right) \cdot \left(\frac{T_{365}}{365} + \frac{T_{366}}{366} \right)$$

Кількість розрахункового базового активу в другій частині Контракту (сума другої частини Контракту):

$$СУМ_2 = Ц_2 \cdot К$$

Сума процентного доходу (витрат) за Контрактом:

$$Д = СУМ_2 - СУМ_1$$

.