

"БАНК ЦЕНТРКРЕДИТ" АКЦИОНЕРЛІК ҚОҒАМЫ

Қазақстан Республикасы, 050059, Алматы, әл-Фараби даңғ., 38
Телефондар: 8 (727) 244 30 00,
8 8000 8000 88
Факс: 8 (727) 259 86 22
Email: info@bcc.kz
SWIFT: KCJBKZKX
Web: www.bcc.kz
Бланк банк кепілдігін беруге арналмаған

АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО "БАНК ЦЕНТРКРЕДИТ"

Республика Казахстан, 050059, Алматы, пр. Аль-Фараби, 38
Телефоны: 8 (727) 244 30 00,
8 8000 8000 88
Факс: 8 (727) 259 86 22
Email: info@bcc.kz
SWIFT: KCJBKZKX
Web: www.bcc.kz
Бланк не предназначен для выдачи банковской гарантии

*N 54-3/65
от 06.12.2013 г.*

АО «Казахстанская фондовая биржа»

“АО «Банк ЦентрКредит» и ЕБРР заключили первую в истории казахстанского рынка KZT Overnight Indexed Swap (OIS).

На рынке производных финансовых инструментов казахстанского тенге (ПФИ деривативы) была заключена сделка OIS (Overnight Indexed Swap) между European Bank for Reconstruction and Development (ЕБРР) и АО «Банк ЦентрКредит». В качестве ставки индекса овернайт был использован бенчмарк денежного рынка TONIA, а для целей расчета ежедневной капитализации (начисления) овернайт ставки был использован индикатор TCI (TONIA Compounded Index), который публикуется биржей каждый рабочий день.

Overnight Indexed Swap (OIS) - это своп, при котором ставка овернайт обменивается на фиксированную процентную ставку. Индекс ставки овернайт используется в договорах хеджирования, в котором одна сторона обменивается с другой заранее определенным активом в указанную дату.”

“Bank CenterCredit JSC and the EBRD concluded the first KZT Overnight Indexed Swap (OIS) in the history of the Kazakhstan market.

On the Kazakh Tenge derivatives market (Financial Derivative Instruments, derivatives), an OIS (Overnight Indexed Swap) transaction was concluded between the European Bank for Reconstruction and Development (EBRD) and Bank CenterCredit JSC. The TONIA rate was used for overnight index rate, and the TCI (TONIA Compounded Index), a money market indicator which is published by the Kazakhstan Stock Exchange every business day, was used for calculating the compounding of this overnight rate.

Overnight Index Swap (OIS) is a swap in which the overnight rate is exchanged for a fixed interest rate. The overnight rate index is used in hedging contracts in which one party exchanges a predetermined asset with another on a specified date.”

С уважением,

Управляющий директор
Центра казначейства



Т.Р. Габасов