



МОНГОЛБАНКНЫ ЕРӨНХИЙЛӨГЧИЙН ТУШААЛ

2022 оны 11 сарын 03 өдөр

Дугаар А-304

Улаанбаатар хот

Журам шинэчлэн батлах тухай

Төв банк (Монголбанк)-ны тухай хуулийн 4 дүгээр зүйлийн 2 дахь хэсэг, 21 дүгээр зүйлийн 4 дэх хэсэг, 28 дугаар зүйлийн 1 дэх хэсгийн 1,2 дахь заалт, Валютын зохицуулалтын тухай хуулийн 8 дугаар зүйлийн 1 дэх хэсэг, 10 дугаар зүйлийг тус тус үндэслэн ТУШААХ нь:

1.“Валютын своп, форвард хэлцлийн журам”-ыг нэгдүгээр хавсралтаар, “Валютын своп, форвард хэлцлийн заавар”-ыг хоёрдугаар хавсралтаар тус тус баталсугай.

2.Энэ тушаалыг батлагдсан өдрөөс эхлэн үйл ажиллагаандаа мөрдөж ажиллахыг Нөөцийн удирдлага, санхүүгийн зах зээлийн газар (А.Энхжин), Санхүү, бүртгэлийн газар (Ц.Гарьд), бүх банкны гүйцэтгэх захирал нарт тус тус үүрэг болгосугай.

3.Энэ тушаалын биелэлтэд хяналт тавьж ажиллахыг Дотоод аудитын газар (А.Шижирмаа) даалгасугай.

4.Энэ тушаал батлагдсантай холбогдуулан Монголбанкны Ерөнхийлөгчийн 2008 оны 05 дугаар сарын 05-ны өдрийн 197 дугаар тушаал, 2010 оны 12 дугаар сарын 24-ний өдрийн 730 дугаар тушаалын нэгдүгээр хавсралт, 2016 оны 12 дугаар сарын 14-ний өдрийн А-341 дүгээр тушаалын хоёрдугаар хавсралтыг хүчингүй болсонд тооцсугай.

ЕРӨНХИЙЛӨГЧ



Б.ЛХАГВАСҮРЭН

1522012099

Монголбанкны Ерөнхийлөгчийн 2022 оны
11. дүгээр сарын 03-ны өдрийн А.304
дугаар тушаалын нэгдүгээр хавсралт



ВАЛЮТЫН СВОП, ФОРВАРД ХЭЛЦЛИЙН ЖУРАМ

НЭГ. Нийтлэг үндэслэл

- 1.1 Энэ журмын зорилго нь арилжааны банкуудын богино хугацааны төлбөр түргэн гүйцэтгэх чадварыг хангахад дэмжлэг үзүүлэх зорилгоор Монголбанк, төгрөг, ам.долларын своп, форвард хэлцлийг банк / цаашид Банк гэх/-тай байгуулж, төгрөг болон ам.долларын богино хугацаат эх үүсвэр нийлүүлэх, татах үйл ажиллагаатай холбогдон үүсэх Талуудын эрх, үүрэг, бусад харилцааг зохицуулахад оршино.
- 1.2 Своп, форвард хэлцэл нь Банкны төгрөг, валютын богино хугацааны төлбөр түргэн гүйцэтгэх чадварыг хангахад дэмжлэг үзүүлэх зорилготой Төв банкны мөнгөний бодлогын байнгын бус хэрэгсэл байна.
- 1.3 Монголбанк своп, форвард хэлцлийг зөвхөн банкны үйл ажиллагаа эрхлэх зөвшөөрөлтэй, Монгол Улсын нутаг дэвсгэр дээр үйл ажиллагаа явуулж буй банктай хийнэ.
- 1.4 Урт хугацаат буюу 1 жилээс дээш хугацаатай, бага хүүтэй, бодит эдийн засгийг дэмжихэд чиглэсэн гадны эх үүсвэрүүдэд үндэслэн дотоодын захад ханшийн эрсдэлийг хамгаалах тогтолцоог бүрдүүлэх зорилго бүхий хэлцлийг Урт хугацаат своп хэлцлийн журмаар зохицуулна.

ХОЁР. Нэр томъёоны тодорхойлолт

- 2.1 Энэ гэрээнд хэрэглэсэн дараах нэр томъёог дор дурдсан утгаар ойлгоно.
 - 2.1.1 “Төгрөгийн своп хэлцэл” гэж хэлцэл хийгдэх үед Монголбанк спот ханшаар төгрөг татаж, ам.доллар нийлүүлж хугацааны эцэст Монголбанк ам.доллар татаж, форвард ханшаар төгрөг нийлүүлэх хэлцлийг,
 - 2.1.2 “Ам.долларын своп хэлцэл” гэж хэлцэл хийгдэх үед Монголбанк ам.доллар татаж, спот ханшаар төгрөг нийлүүлж хугацааны эцэст Монголбанк форвард ханшаар төгрөг татаж, ам.доллар нийлүүлэх хэлцлийг,
 - 2.1.3 “Төгрөгийн форвард хэлцэл” гэж тодорхой хугацааны дараа форвард ханшаар Монголбанк төгрөг худалдан авч, ам.доллар худалдах хэлцлийг,
 - 2.1.4 “Ам.долларын форвард хэлцэл” гэж тодорхой хугацааны дараа форвард ханшаар Монголбанк төгрөг худалдаж, ам.доллар худалдан авах хэлцлийг,
 - 2.1.5 “Спот ханш” гэж тухай өдөр мөрдөгдөж буй Монголбанкнаас зарласан албан ханшийг,
 - 2.1.6 “Форвард ханш” гэж спот ханш дээр суурилан тооцсон ирээдүйд төлбөр тооцоо хийгдэх үед ашиглагдах ханшийг.

ГУРАВ. Своп, форвард хэлцлийн зарчим

- 3.1 Монголбанкны Ерөнхийлөгчийн тушаалаар своп, форвард хэлцлийн хуваарьт өдөр, хугацаа, хүүний нөхцөл, валют, нэгж саналын дээд, доод валютын хэмжээг батална.
- 3.2 Своп, форвард хэлцлийн хуваарьт өдөр олон нийтээр амрах өдөр тохиолдвол өмнөх ажлын өдөр зохион байгуулна.
- 3.3 Банкны своп, форвард хэлцэл хийх саналыг энэ журмын нэг болон хоёрдугаар хавсралтын дагуу 09.30-10.00 цагийн хооронд “Валютын арилжааны систем”-ээр дамжуулан, Монголбанк хүлээн авна.
- 3.4 Шаардлагатай тохиолдолд банкны своп, форвард хэлцлийн санал хүлээн авахгүй байх, энэ журмын 3.1-д зааснаас өөр өдөр зохион байгуулж болно. Энэ тохиолдолд банкуудад цахим шуудангаар эсвэл утсаар шуурхай мэдэгдэнэ.
- 3.5 Мөнгөний захын үйл ажиллагаа хариуцсан газарт банкнаас энэ журмын нэг болон хоёрдугаар хавсралтын дагуу ирүүлсэн своп, форвард хэлцлийн саналыг судалж, биелсэн хэлцлийг 15:00 цагаас өмнө Монголбанкны Санхүү бүртгэл хариуцсан газарт хүргүүлнэ.
- 3.6 Монголбанкны Санхүү бүртгэл хариуцсан газар нь своп, форвард хэлцлийн дагуу хэлцэл хийсэн өдөр бүртгэж, төлбөр тооцоог гүйцэтгэнэ.
- 3.7 Монголбанк хугацааны эцэст банкнаас төлбөрийн даалгавар ирсэн эсэхээс үл хамаарч ам.доллар, төгрөгийн буцах гүйлгээг хийнэ.
- 3.8 Давагдашгүй хүчин зүйлийн болон цахим арилжааны сүлжээнд эвдрэл гарсны улмаас валютын своп, форвард хэлцэл хийх үйл ажиллагаа тухайн өдрийн 09:30 цагт эхлэх боломжгүй бол дараах үйл ажиллагаа явагдана. Үүнд:
 - 3.8.1. Монголбанк банкуудад цахим шуудан, цахим талбараар зурвас илгээх эсвэл утсаар мэдэгдсэний үндсэн дээр хэлцэл хийх хугацааг сунгаж болно.
 - 3.8.2. Цахим арилжааны сүлжээнд гарсан эвдрэлийг засах боломжгүй тохиолдолд “Валютын своп, форвард хэлцлийн журам”-ын нэг болон хоёрдугаар хавсралтын дагуу арилжааны банкуудаас своп, форвард хэлцэл хийх саналыг баталгаат гарын үсэг, тамга тэмдгийг шалган, бичгээр авна.
 - 3.8.3. Монголбанкны Мөнгөний захын үйл ажиллагаа хариуцсан газрын эдийн засагч нь банкны саналын битүүмж, лацыг шалган, баримт үйлдэж эсвэл факс, цахим шуудангаар хүлээн авна.

ДӨРӨВ. Своп, форвард хэлцлийн нөхцөл

- 4.1 Монголбанк банктай энэ журмын гуравдугаар хавсралтад заасны дагуу своп, форвард хэлцлийн форвард ханшийг тооцож, холбогдох гүйлгээг хийнэ.
- 4.2 “Урт хугацаат своп хэлцлийн журам”-ын хоёрдугаар хавсралтын дагуу Z спрэдийг тооцно.
- 4.3 Форвард ханшийг нэгжийн орны таслалаас хойш 4 оронтойгоор тооцно.
- 4.4 Своп, форвард хэлцлийн хэлцлийн төгрөгийн эх үүсвэрт АСТ/365, ам.долларын эх үүсвэрт АСТ/360 хоногийн суурь ашиглана.
- 4.5 Төгрөгөөр илэрхийлэгдсэн мөнгөн дүн нь төгрөг, мөнгө гэсэн бүтэцтэй байна.

- 4.6 Хугацааны эцэст нийтээр тэмдэглэх баярын болон долоо хоногийн амралтын өдөр тохиохоор бол уг өдрийн дараагийн ажлын өдөр төлбөр тооцоо хийгдэхээр банк своп, форвард хэлцлийн саналаа өгнө.
- 4.7 Своп хэлцлийн эхний гүйлгээнд ам.долларыг төгрөгт хөрвүүлэхдээ тухайн өдөр мөрдөгдөж буй Монголбанкны зарласан ханшийг ашиглана.
- 4.8 Тухайн форвард хэлцлийг хийснээр банкны гадаад валютын эрсдэлийн зохистой харьцааны шалгуур үзүүлэлт хангагдаж байхаар хэлцлийн хэмжээг хязгаарлана.
- 4.9 Банкны Монголбанкттай хийсэн своп хэлцлийн нийт хэмжээ нь тухайн банкны өөрийн хөрөнгийн хэмжээнээс хэтрэхгүй байна.
- 4.10 Банкнаас Монголбанкттай байгуулсан форвард хэлцлийн дагуу хугацааны эцэст төлбөр хийх валютын мөнгөн дүнгийн 5 хувьтай тэнцүү хэмжээгээр тухайн банкны Монголбанкна дахь харилцах дансны үлдэгдлийг царцаана.
- 4.11 Монголбанк форвард хэлцлийн хугацаанд спот ханш энэ журмын 4.10-т заасан хувиас илүүгээр суларсан тохиолдолд Монголбанкна дахь харилцах дансны үлдэгдлийг царцаах хувийг дахин 5 хувиар нэмэгдүүлнэ.
- 4.12 Монголбанкны своп хэлцлийн нөхцөлтэй холбогдуулан дараах үйл ажиллагаа явуулна:
 - 4.12.1. Своп, форвард хэлцэл хийх шийдвэр гаргахад шаардагдах санхүүгийн тайлан, мэдээ, мэдээллийг банкнаас гаргуулан авах;
 - 4.12.2. Төгрөг, гадаад валютын захын тухайн үеийн болон хүлээгдэж буй нөхцөл байдал, банкны ам.доллар болон төгрөгөө буцаан төлөх чадвар, бусад хүчин зүйлсийг харгалзан үзээд своп, форвард хэлцэл хийх банкны саналыг хэсэгчлэн буюу бүрэн хэмжээгээр биелүүлэхээс татгалзах, татгалзсан шалтгаанаа тайлбарлахгүй байх;
 - 4.12.3. Монголбанк нь энэ гэрээний 4.12.1-д заасны дагуу гаргуулан авсан болон своп, форвард хэлцлийн талаарх мэдээллийн нууцлалыг хангах;
 - 4.12.4. Журамд нэмэлт, өөрчлөлт орсон тохиолдолд ажлын 2 өдрийн дотор банкуудад мэдэгдэх;
 - 4.12.5. Своп, форвард хэлцлийн төлбөр тооцоог саадгүй гүйцэтгэх.
- 4.13 Монголбанк нь энэ журам болон дор дурдсан нөхцөлийг хүлээн зөвшөөрч, үүрэг хүлээсэн банкттай төгрөг, ам.долларын своп, форвард хэлцлийг байгуулж болно:
 - 4.13.1. Своп, форвард хэлцэл байгуулах саналыг Мөнгөний захын үйл ажиллагаа хариуцсан газарт ирүүлсэн;
 - 4.13.2. Своп хэлцлийн саналын дүн нь тухайн өдөр хугацаа нь дуусаж буй Монголбанкттай байгуулсан тухайн валютаарх своп хэлцлийн үлдэгдэл, Монголбанк дахь харилцах данс дахь үлдэгдлийн нийлбэрээс ихгүй байхаар саналаа ирүүлсэн;
 - 4.13.3. Своп, форвард хэлцлийн хугацааны эцэст Банк нь хүрэлцэхүйц хэмжээний үлдэгдлийг Монголбанк дахь харилцах дансанд байршуулсан байх;
 - 4.13.4. Банк своп, форвард хэлцлийн саналыг “Валютын арилжааны систем”-д оруулан баталгаажуулсан;
 - 4.13.5. Своп, форвард хэлцлээр худалдан авсан төгрөг, ам.долларын эх үүсвэрийг богино хугацааны төлбөр түргэн гүйцэтгэх чадварыг хангах, валютын ханшийн эрсдэлээс хамгаалахад ашиглах зорилготой байх;

4.13.6. Монголбанкнаас шийдвэр гаргахад шаардагдах санхүүгийн тайлан, мэдээ, мэдээллийг Мөнгөний захын үйл ажиллагаа хариуцсан газарт заасан хугацааны дотор үнэн, зөв ирүүлсэн;

4.13.7. Своп, форвард хэлцлийн саналыг бичгээр ирүүлэх тохиолдолд банкны зөвхөн эрх бүхий албан тушаалтны гарын үсэг, банкны тамга тэмдгээр баталгаажуулж, Мөнгөний захын үйл ажиллагаа хариуцсан газарт ирүүлсэн;

4.13.8. Банкны эрх бүхий ажилтны гарын үсгийн баталгаанд өөрчлөлт орсон бол энэ талаар дараагийн хэлцлээс ажлын 2 өдрийн өмнө Монголбанканд бичгээр мэдэгдсэн.

ТАВ. Хариуцлага

5.1. Банк нь энэ журмын 4.13.2 дахь заалтыг зөрчсөн тохиолдолд тус саналыг Монголбанк цуцална. Энэ үйлдэл хоёр удаа давтагдсан тохиолдолд банканд сануулга хүргүүлнэ.

5.2. Банкны ам.долларын своп, төгрөгийн форвард хэлцлийн хугацааны эцэст төлбөр тооцоог гүйцэтгэхэд Монголбанк дахь төгрөгийн харилцах дансны үлдэгдэл хүрэлцэхгүй тохиолдолд Монголбанк дараах байдлаар төлүүлнэ:

5.2.1. Монголбанк дахь ам.долларын харилцах данснаас тухайн өдөр мөрдөгдөж буй Монголбанкны зарласан албан ханшаар төгрөгт хөрвүүлж төлүүлнэ.

5.2.2. Монголбанк дахь ам.долларын харилцах дансны үлдэгдэл Банкны төлөх төгрөгийн дүнд хүрэлцэхгүй бол бусад гадаад валютын харилцах дансны үлдэгдэл, төгрөг, валютын хадгаламжийн үлдэгдэл, эзэмшиж буй ТБҮЦ, ЗГҮЦ-наас суутгаж, төлүүлнэ.

5.2.3. Энэ журмын 5.2.1, 5.2.2-т заасан арга хэмжээг авсны дараа төлбөр барагдаагүй тохиолдолд Банкныг хүрэлцэхүйц төгрөг харилцахдаа байршуулах хүртэл хугацаанд алдангийг Монголбанкны овернайт репо санхүүжилтийн хүүг 2 нэгж хувиар нэмэгдүүлж тооцно.

5.3. Банк нь төгрөгийн своп, ам.долларын форвард хэлцлийн хугацааны эцэст төлбөр тооцоог гүйцэтгэхэд Монголбанк дахь ам.долларын харилцах дансны үлдэгдэл хүрэлцэхгүй тохиолдолд Монголбанк дараах байдлаар төлүүлнэ. Үүнд:

5.3.1. Монголбанк дахь бусад валютын харилцах данснаас тухайн өдөр мөрдөгдөж буй Монголбанкны зарласан албан ханшаар ам.долларт хөрвүүлж, төлүүлнэ.

5.3.2. Монголбанк дахь бусад валютын харилцах дансны үлдэгдэл Банкны төлөх төгрөгийн дүнд хүрэлцэхгүй бол бусад гадаад валютын харилцах дансны үлдэгдэл, төгрөг, валютын хадгаламжийн үлдэгдэл, эзэмшиж буй ТБҮЦ, ЗГҮЦ-наас суутгаж, төлүүлнэ.

5.3.3. Энэ журмын 5.3.1, 5.3.2-т заасан арга хэмжээг авсны дараа төлбөр барагдаагүй тохиолдолд Банкныг хүрэлцэхүйц төгрөг харилцахдаа байршуулах хүртэл хугацаанд алдангийг Монголбанкны овернайт репо санхүүжилтийн хүүг 2 нэгж хувиар нэмэгдүүлж тооцно.

5.4. Банк төлбөрийг ЗГҮЦ болон ТБҮЦ-аар барагдуулах бол зах зээлийн үнийг Монголбанкны холбогдох эрх зүйн актад заасны дагуу хямдруулж тооцно.

- 5.5. Энэ журмын 5.2.3, 5.3.3-т заасны дагуу алданги тооцож эхэлснээс хойш Банк ажлын 5 хоногт төлбөрийг барагдуулаагүй тохиолдолд Монголбанк хэлцлийн форвард гүйлгээг цуцалж, 5.2, 5.3-т заасан алдангиас бусад эх үүсвэрийг Банкны төгрөгийн харилцах дансанд буцаах бөгөөд хэлцлийн төгрөгийн дүнгийн 0.5 хувьтай тэнцүү мөнгөн торгуулийг ногдуулна.
- 5.6. Банк нь давтагдашгүй хүчин зүйл болон банкны төлбөрийн системд эвдрэл гарсны улмаас хугацааны эцэст своп, форвард хэлцлийн төлбөр тооцоог гүйцэтгэж чадахгүй болсон тохиолдолд банк хоорондын их дүнтэй төлбөрийн системийн шимтгэлийг төлж, цагийг сунгаж төлбөр тооцоог гүйцэтгэнэ.
- 5.7. Хэрэв банк нь 5.6-д заасны дагуу банк хоорондын их дүнтэй төлбөрийн системийн цагийг сунгаагүй тохиолдолд Монголбанкнаас банктай байгуулсан форвард хэлцлийг хүчингүй болгоно.
- 5.8. Энэ журмын 5.2, 5.3-т заасан арга хэмжээ тус тус давтагдсан тохиолдолд Монголбанкнаас Банкны своп, форвард хэлцэл байгуулах зөвшөөрлийг хүчингүй болгоно.

“Валютын своп, форвард хэлцлийн журам”-ын
нэгдүгээр хавсралт

СВОП ХЭЛЦЭЛ

Хэлцэл хийсэн огноо: ... оны ... сарын ... өдөр

1. Банкны нэр :
2. Хугацаа : хоног
3. Эхний гүйлгээ : банкны
 - 3.1 Худалдан авах валют
3.2 Хэмжээ тоогоор (үсгээр)
 - 3.3 Ханш Өмнөх өдрийн Монголбанкны зарласан ханш
 - 3.4 Огноо ... оны ... сарын ... өдөр
4. Форвард гүйлгээ : банкны
 - 4.1 Худалдах валют:
 - 4.2 Хэмжээ тоогоор (үсгээр)
 - 4.3 Ханш
 - 4.4 Огноо ... оны ... сарын ... өдөр
5. Төгрөгийн эх үүсвэрийн хүү
6. Ам.долларын эх үүсвэрийн хүү

МОНГОЛБАНКИЙГ ТӨЛӨӨЛЖ:

..... БАНКИЙГ ТӨЛӨӨЛЖ:

ТАМГА:

ТАМГА:

ЦАХИМ ШУУДАНГИЙН ХАЯГ:

ФОРВАРД ХЭЛЦЭЛ

Хэлцэл хийсэн огноо: ... оны ... сарын ... өдөр

..... банкны

1. Худалдан авах валютын төрөл:
2. Хэмжээ: тоогоор (үсгээр)
3. Худалдах валютын төрөл:
4. Хэмжээ: тоогоор (үсгээр)
5. Валютын хөрвүүлэгт ашигласан валютын ханш: Өмнөх өдрийн Монголбанкны зарласан ханш

6. Форвард ханш
7. Төгрөгийн эх үүсвэрийн хүү хувь
8. Ам.долларын эх үүсвэрийн хүү хувь
9. Хугацаа: хоног
10. Төлбөр хийх огноо: ... оны ... сарын ... өдөр

МОНГОЛБАНКИЙГ ТӨЛӨӨЛЖ:

..... БАНКИЙГ ТӨЛӨӨЛЖ:

ТАМГА:

ТАМГА:

ЦАХИМ ШУУДАНГИЙН
ХАЯГ:

“Валютын своп, форвард хэлцлийн журам”-ын
гуравдугаар хавсралт

СВОП, ФОРВАРД ХЭЛЦЛИЙН ТООЦООЛОЛ

№	Үзүүлэлт	Нөхцөл
1	Эхний гүйлгээ	Своп хэлцэл: Тухайн өдөр мөрдөгдөж буй Монголбанкнаас зарласан албан ханшаар хөрвүүлж, эх үүсвэр солилцоно. Форвард хэлцэл: Байхгүй
2	Форвард гүйлгээ	Своп, Форвард хэлцэл: Эхний гүйлгээгээр солилцсон эх үүсвэрийг форвард ханшаар төгрөгт хөрвүүлж, буцаан солилцоно.

Форвард ханшийг доорх томъёогоор тооцно.

$$F_{bid} = S_{rate} * \frac{1 + I_{mnt_bid} * t/365}{1 + I_{usd_ask} * t/360}$$

$$F_{ask} = S_{rate} * \frac{1 + I_{mnt_ask} * t/365}{1 + I_{usd_bid} * t/360}$$

Үзүүлэлт	Тайлбар
I_x	Эх үүсвэрт харгалзах хүү (100-д хувааснаар)
I_{mnt_bid}	Монголбанкны своп хэлцлийн эхний гүйлгээгээр төгрөгийн эх үүсвэр худалдан авах, форвард хэлцлээр төгрөг худалдах хүү
I_{mnt_ask}	Монголбанкны своп хэлцлийн эхний гүйлгээгээр төгрөгийн эх үүсвэр худалдах, форвард хэлцлээр төгрөг худалдан авах хүү
I_{usd_bid}	Монголбанкны своп хэлцлийн эхний гүйлгээгээр ам.долларын эх үүсвэр худалдан авах, форвард хэлцлээр ам.доллар худалдах хүү
I_{usd_ask}	Монголбанкны своп хэлцлийн эхний гүйлгээгээр ам.долларын эх үүсвэр худалдах, форвард хэлцлээр ам.доллар худалдан авах хүү
t	Хэлцлийн хугацаа өдрөөр
F_{bid}	Монголбанкны форвард гүйлгээгээр валют худалдаж авах форвард ханш (төгрөгийн своп, ам.долларын форвард)
F_{ask}	Монголбанкны форвард гүйлгээгээр валют худалдах форвард ханш (ам.долларын своп, төгрөгийн форвард)
S_{rate}	Тухайн өдөр мөрдөгдөж буй Монголбанкнаас зарласан төгрөгийн ам.доллартай харьцах ханш

Монголбанкны Ерөнхийлөгчийн 2022 оны
...11... дүгээр сарын .03...-ны өдрийн 1-304 дугаар
тушаалын хоёрдугаар хавсралт



ВАЛЮТЫН СВОП, ФОРВАРД ХЭЛЦЛИЙН ЗААВАР

НЭГ. НИЙТЛЭГ ҮНДЭСЛЭЛ

- 1.1. Энэ зааврын зорилго нь Төв банк /Монголбанк/-аас дотоодын банктай /цаашид банк гэх/ своп, форвард хэлцэл байгуулах үйл ажиллагааг зохион байгуулахад баримтлах зарчим, шийдвэр гаргах үйл явц, нэгж тус бүрт тавигдах шаардлага, тэдгээрийн чиг үүрэг, үйл ажиллагааны дарааллыг тодорхойлох, түүнд хяналт тавих нөхцөлийг бүрдүүлэхэд оршино.
- 1.2. Монголбанкны гадаад валютын спот арилжаа хийгдэх эрх зүйн үндэс нь Төв банк (Монголбанк)-ны тухай хуулийн 4 дүгээр зүйлийн 2 дахь хэсэг, Валютын зохицуулалтын тухай хуулийн 8 дугаар зүйлийн 1 дэх хэсэг, Монголбанкны Ерөнхийлөгчийн 2022 оны 11 дүгээр сарын 3-ны өдрийн 304 дугаар тушаалаар батлагдсан "Валютын своп, форвард хэлцлийн журам" болон холбогдох бусад эрх зүйн акт болон энэхүү заавар байна.
- 1.3. Своп, форвард хэлцэл нь банкны төгрөг, валютын хөрвөх чадварыг хангах, валютын ханшийн эрсдэлээс хамгаалах зорилготой Төв банкны мөнгөний бодлогын байнгын бус хэрэгсэл юм.

ХОЁР. ҮЙЛ АЖИЛЛАГААНЫ ЗОХИОН БАЙГУУЛАЛТ

- 2.1. Монголбанк банктай богино своп, форвард хэлцэл байгуулахыг Мөнгөний захын үйл ажиллагаа хариуцсан газар зохион байгуулж, энэ зааврын нэг болон хоёрдугаар хавсралтын дагуу тэмдэглэл хөтөлнө.
- 2.2. Валют арилжааны шуурхай зөвлөл (цаашид Шуурхай зөвлөл гэх)-ийн гишүүн бүр нэг саналын эрхтэйгээр тухайн өдрийн 10:45 цагаас биечлэн, эсвэл цахим хэлбэрээр хуралд оролцож, своп, форвард хэлцлийг Шуурхай зөвлөлийн гишүүдийн олонхын саналаар шийдвэрлэн энэ зааврын нэг болон хоёрдугаар хавсралтын дагуу Монголбанкны Ерөнхийлөгчид танилцуулна.
- 2.3. Монголбанкны Ерөнхийлөгч Шуурхай зөвлөлийн хурлын шийдвэрийг батлах бөгөөд уг шийдвэрээс өөр шийдвэр гарсан тохиолдолд энэ зааврын нэг болон хоёрдугаар хавсралтад тэмдэглэж баталгаажуулна.
- 2.4. Монголбанкны Ерөнхийлөгч баталгаажуулах боломжгүй тохиолдолд Шуурхай зөвлөлийн хурлын шийдвэрийг эцсийн шийдвэрт тооцно.
- 2.5. Шуурхай зөвлөлийн гишүүн нь хуралд биечлэн оролцох боломжгүй тохиолдолд саналаа цахим хэлбэрээр эсвэл орлон ажиллах албан тушаалтныг урьдчилан томилж, Мөнгөний захын үйл ажиллагаа хариуцсан газарт энэ зааврын 2.2-т заасан цагт багтаан саналаа ирүүлнэ.

- 2.6. Шаардлагатай гэж үзвэл Мөнгөний захын үйл ажиллагаа хариуцсан газрын саналыг харгалзан Шуурхай зөвлөлийн ахлах албан тушаалтны шийдвэрээр хурлыг энэ зааврын 2.2-т зааснаас өөр цагт зохион байгуулж болно.
- 2.7. Энэ зааврын 2.2-т заасны дагуу саналаа ирүүлээгүй, Шуурхай зөвлөлийн хурлаар олонхын шийдвэрт хүрээгүй тохиолдолд Шуурхай зөвлөлийн ахлах албан тушаалтан нь саналыг таслах эрхтэй байна.
- 2.8. Мөнгөний захын үйл ажиллагаа хариуцсан газар, хэлтсийн захирал Шуурхай зөвлөлийн хуралд гадаад валютын дотоодын захын нөхцөл байдал, гадаад валютын нөөцийн талаарх мэдээллийг танилцуулна.
- 2.9. Мөнгөний бодлого хариуцсан газрын захирал Шуурхай зөвлөлийн хуралд мөнгө, валютын ханшийн бодлого, тэнцвэрт ханшийн түвшин, төлбөрийн тэнцлийн төсөөллийн талаарх мэдээллийг танилцуулна.
- 2.10. Судалгаа, статистик хариуцсан газрын захирал Шуурхай зөвлөлийн хуралд холбогдох судалгаа, статистикийн үр дүн, төлөгдөх гадаад өр төлбөрийн талаарх мэдээллийг танилцуулна.
- 2.11. Санхүү бүртгэлийн үйл ажиллагаа хариуцсан газар нь Монголбанкны Ерөнхийлөгчийн холбогдох тушаалын дагуу төлбөр тооцооны өдөр гүйлгээг дамжуулж, төлбөр тооцоог гүйцэтгэнэ.

ГУРАВ. ҮЙЛ АЖИЛЛАГААНЫ ШААРДЛАГА

- 3.1. Энэ зааврын 2.6, 2.7, 2.8-д заасан мэдээллийг Шуурхай зөвлөлийн гишүүдэд цахим хэлбэрээр танилцуулж болно.
- 3.2. Шуурхай зөвлөлийн хурлын шийдвэрийн дагуу арилжааг 14:30 цагаас өмнө Мөнгөний захын үйл ажиллагаа хариуцсан газрын эдийн засагч гүйцэтгэнэ.

ДӨРӨВ. ХЭРЭГЖИЛТ, ХЯНАЛТ

- 4.1. Шуурхай зөвлөлийн шийдвэр холбогдох хууль, журам, зааварт нийцсэн, ашиг сонирхлын зөрчилгүй байна.
- 4.2. Шуурхай зөвлөл шийдвэрийн дагуу хийгдэж буй арилжаа нь тэгш байдлын зарчимд суурилж явагдана.
- 4.3. Энэхүү зааврыг зөрчсөн албан тушаалтанд холбогдох хууль тогтоомжийн дагуу хариуцлага хүлээлгэнэ.

БАТЛАВ:

МОНГОЛБАНКНЫ ЕРӨНХИЙЛӨГЧ

ШУУРХАЙ ЗӨВЛӨГӨӨНД ТАНИЛЦУУЛАХ СВОП ХЭЛЦЛИЙН НЭГТГЭЛ

Огноо: Он/сар/өдөр
Бодлогын хүү:

Монголбанкны зарласан ханш:
Репо санхүүжилтийн хүү:
Овернайт арилжааны хүү:

Харгалзах хугацааны SOFR хүү:
Z спрэд:

MNT своп

..... хоног

Банк	Дуусах огноо	Форвард ханш	USD хэмжээ	MNT эхний	MNT 2дахь	USD биелсэн
Нийт						

..... хоног

Банк	Дуусах огноо	Форвард ханш	USD хэмжээ	MNT эхний	MNT 2дахь	USD биелсэн
Нийт						

Тэмдэглэл:.....
.....

Дэд Ерөнхийлөгч //
Мөнгөний захын үйл ажиллагаа хариуцсан газрын захирал //
Мөнгөний бодлогын үйл ажиллагаа хариуцсан газрын захирал //
Судалгаа статистикийн үйл ажиллагаа хариуцсан газрын захирал //
Мөнгөний захын үйл ажиллагаа хариуцсан газрын эдийн засагч /

БАТЛАВ:

МОНГОЛБАНКНЫ ЕРӨНХИЙЛӨГЧ

ШУУРХАЙ ЗӨВЛӨГӨӨНД ТАНИЛЦУУЛАХ ФОРВАРД ХЭЛЦЛИЙН НЭГТГЭЛ

Огноо: Ов/сар/өдөр
Бодлогын хүү:

Монголбанкны зарласан ханш:
Репо санхүүжилтийн хүү:
Овернайт арилжааны хүү:

Харгалзах хугацааны SOFR хүү:
Z сүрэд:

MNT форвард

..... хоног

Банк	Хэлцэл биелэх огноо	USD санал	USD биелсэн	Форвард ханш	MNT хэмжээ
Нийт					

USD форвард

..... хоног

Банк	Хэлцэл биелэх огноо	USD санал	USD биелсэн	Форвард ханш	MNT хэмжээ
Нийт					

Тэмдэглэл:.....

Дэд Ерөнхийлөгч / /
 Мөнгөний захын үйл ажиллагаа хариуцсан газрын захирал / /
 Мөнгөний бодлогын үйл ажиллагаа хариуцсан газрын захирал / /
 Судалгаа статистикийн үйл ажиллагаа хариуцсан газрын захирал / /
 Мөнгөний захын үйл ажиллагаа хариуцсан газрын эдийн засагч / /