



МОНГОЛБАНКНЫ ЕРӨНХИЙЛӨГЧИЙН ТУШААЛ

2021 оны 06 сарын 30 өдөр

Дугаар А-162

Улаанбаатар хот

Урт хугацаат своп хэлцлийн журмыг шинэчлэн батлах тухай

Төв банк /Монголбанк/-ны тухай хуулийн 4 дүгээр зүйлийн 2 дахь хэсэг, 28 дугаар зүйлийн 1 дэх хэсгийн 1, 2 дахь заалт, Валютын зохицуулалтын тухай хуулийн 8 дугаар зүйлийн 1, 2 дахь хэсэг, 10 дугаар зүйлийн 1, 2 дахь хэсгийг тус тус үндэслэн ТУШААХ НЬ:

- 1.“Урт хугацаат своп хэлцлийн журам”-ыг хавсралт ёсоор шинэчлэн баталсугай.
- 2.Батлагдсан журмыг үйл ажиллагаандаа хэрэгжүүлж ажиллахыг бүх банкны гүйцэтгэх захирал нарт тус тус үүрэг болгосугай.
- 3.Энэ тушаалыг батлагдсан өдрөөс эхлэн үйл ажиллагаандаа мөрдөж ажиллахыг Нөөцийн удирдлага, санхүүгийн зах зээлийн газар (А.Энхжин), Санхүү бүртгэлийн газар (Ц.Гарьд), Эрсдэлийн удирдлагын алба (Д.Баянзул)-нд тус тус үүрэг болгосугай.
- 4.Энэ тушаал гарсантай холбогдуулан Монголбанкны Ерөнхийлөгчийн 2016 оны 12 дугаар сарын 14-ний өдрийн А-341 дүгээр тушаалын 1 дэх заалтыг хүчингүй болсонд тооцсугай.
- 5.Энэхүү тушаалын биелэлтэд хяналт тавьж ажиллахыг Дотоод аудитын газар (Т.Амарсайхан)-т даалгасугай.

ЕРӨНХИЙЛӨГЧ



Б.ЛХАГВАСҮРЭН

14 0955

УРТ ХУГАЦААТ СВОП ХЭЛЦЛИЙН ЖУРАМ

НЭГ. Нийтлэг үндэслэл

- 1.1. Энэ журмын зорилго нь гадаад валютын урсгалыг нэмэгдүүлэх, зээлийн хүү, гадаад валютын зээлийн өсөлтийг бууруулах, гадаад валютын ханшийн эрсдэлээс хамгаалах тогтолцоог бий болгохын тулд банкууд урт хугацаат гадны эх үүсвэрээр Монголбанкттай своп хэлцэл байгуулах үйл ажиллагаанд баримтлах зарчим, талуудын эрх, үүрэг, бусад харилцааг зохицуулахад оршино.
- 1.2. Монголбанк нь урт хугацаат своп хэлцлийг банкнаас гадна Монгол Улсын Засгийн Газар, олон улсын санхүүгийн байгууллагатай байгуулж болно. Монголбанкнаас тусгайлан заагаагүй бол уг хэлцлийн нөхцөл, зарчим нь Банктай байгуулж буй урт хугацаат своп хэлцэлтэй ижил байна.
- 1.3 Монголбанк нь дараах шаардлагыг хангасан урт хугацаат гадаад эх үүсвэрээр хэлцэл байгуулах саналыг хүлээн авна:
- 1.3.1. Бага хүүтэй, бодит эдийн засгийг дэмжихэд чиглэсэн байх,
 - 1.3.2. Банкны активыг барьцаалаагүй байх,
 - 1.3.3. Банкны гадаад валютын нээлттэй позицийн тайланд тусгагдсан байх,
 - 1.3.4. Банкны гадаад гүйлгээний өдрийн мэдээнд тусгагдсан байх,
 - 1.3.5. Банк, аж ахуйн нэгж, байгууллага, иргэдийн гадаад зээлийг бүртгэх журмын дагуу эх үүсвэрийг банкны гадаад зээлийг бүртгэх маягтад бүртгүүлсэн байх.
- 1.4 Энэ журам нь Монголбанкны банктай хийх своп хэлцэл/гэрээний нөхцөл болох бөгөөд банк энэ журмын 4 дэх хэсэгт заасны дагуу саналаа ирүүлснээр своп хэлцлийн нөхцөлийг хүлээн зөвшөөрсөнд тооцно.

ХОЁР. Нэр томъёоны тодорхойлолт

- 2.1 Энэ журамд хэрэглэсэн дараах нэр томъёог дор дурдсан утгаар ойлгоно.
- 2.1.1. **“Урт хугацаат ам.долларын своп хэлцэл”** /цаашид своп хэлцэл гэх/ гэж хэлцэл хийгдэх үед Монголбанк ам.долларын эх үүсвэр татаж, төгрөг нийлүүлж, хугацааны дундуур болон эцэст талууд хүүний төлбөрийг солилцож, зөвхөн эх үүсвэрийн ханшийн зөрүүг төлөх мөнгөн урсгал бүхий 360 хоног буюу түүнээс дээш хугацаатай хэлцлийг;
- 2.1.2. **“Z-спрейд”** гэж АНУ-ын Засгийн газрын үнэт цаастай харьцуулсан Монгол Улсын Засгийн газрын үнэт цаасны эрсдэлийн урамшууллыг;
/Энэ заалтыг Монголбанкны Ерөнхийлөгчийн 2024 оны 10 дугаар сарын 09-ний өдрийн А-236 дугаар тушаалаар хүчингүй болсонд тооцсон./
- 2.1.3. **“Гадаад зээл, өрийн хэрэгсэл”**, гэж Монгол Улсад бүртгэлгүй, байнгын бус оршин суугч этгээдээс олгосон өр үүсгэх хөрөнгийн эх үүсвэрийг;
- 2.1.4. **“Бонд”** гэж гадаад зах зээл дээр гаргасан дунд болон урт хугацааны үнэт цаасыг.

ГУРАВ. Своп хэлцлийн үндсэн нөхцөл

3.1. Энэ журмын нэгдүгээр хавсралтад заасны дагуу своп хэлцлийн нөхцөлийг тодорхойлно.

3.2. Энэ журмын хоёрдугаар хавсралтад заасан аргачлалын дагуу Z-спрэдийг тооцно.

/Энэ хэсгийг Монголбанкны Ерөнхийлөгчийн 2024 оны 10 дугаар сарын 09-ний өдрийн А-236 дугаар тушаалаар хүчингүй болсонд тооцсон./

3.3. Своп хэлцлийн хүүг хэлцэл байгуулсан өдрөөс хойш 3 сар тутам шинэчлэх бөгөөд Монголбанк шинэчилсэн хүүг цахим арилжааны системээр эсвэл энэ журмын гуравдугаар хавсралтын дагуу банканд хүргүүлнэ.

3.4. Хүү тооцох, төлбөр тооцоо хийгдэх өдөр амралтын өдөр, нийтээр амрах баярын өдөр тохиовол дараагийн ажлын өдөр төлбөр тооцоог гүйцэтгэнэ.

3.5. Банк нь Монгол Улсад гадаад эх үүсвэрийг оруулж ирсэн өдрөөс хойш 3 сарын дотор Монголбанкттай шинээр хэлцэл байгуулах хүсэлтийг ирүүлж болно.

3.6. Своп хэлцлийн төгрөгийн эх үүсвэрт АСТ/365, ам.долларын эх үүсвэрт АСТ/360 хоногийн суурийг тус тус ашиглана.

3.7. Төгрөгөөр илэрхийлэгдсэн мөнгөн дүн нь төгрөг, мөнгө гэсэн бүтэцтэй байна.

3.8. Бонд, гадаад зээл, өрийн хэрэгслийн ам.доллароос бусад валютаарх эх үүсвэрийг ам.долларт хөрвүүлж, тус эх үүсвэрээр своп хэлцэл хийх хүсэлтийг Монголбанканд ирүүлж болно.

~~3.9. Банк нь зээлийн гэрээний хугацааг сунгасан, бондыг дахин санхүүжүүлсэн өдрөөс хойш 3 сарын дотор своп хэлцлийн хугацааг сунгах хүсэлтийг Монголбанканд ирүүлж болно. Оролцогч талууд своп хэлцлийг хугацаанаас нь өмнө дуусгавар болгохгүй бөгөөд үргэлжлүүлэн сунгахгүй.~~

/Энэ хэсгийг Монголбанкны Ерөнхийлөгчийн 2024 оны 10 дугаар сарын 09-ний өдрийн А-236 дугаар тушаалаар өөрчлөн найруулсан./

3.10. Банк своп хэлцлийн үүргийг биелүүлээгүй тохиолдолд энэ журмын 7-д заасан арга хэмжээ авна.

3.11. Монголбанкнаас зөвшөөрснөөс бусад тохиолдолд своп хэлцэл байгуулах эх үүсвэр нь энэ журмын 1.2-т заасан байгууллагуудын татан төвлөрүүлсэн эх үүсвэр байна.

/Энэ хэсгийг Монголбанкны Ерөнхийлөгчийн 2024 оны 10 дугаар сарын 09-ний өдрийн А-236 дугаар тушаалаар нэмсэн./

ДӨРӨВ. Своп хэлцлийн зарчим

4.1. Банк нь своп хэлцэл байгуулах үндэслэлээ эх үүсвэрийн эргэн төлөлтийн хуваарьт нийцүүлэн энэ журмын дөрөвдүгээр хавсралтын дагуу гарын үсэг, тамга тэмдгээр баталгаажуулан Монголбанканд урьдчилан ирүүлэх бөгөөд дараах баримтыг хавсаргасан байна.

/Энэ хэсэгт Монголбанкны Ерөнхийлөгчийн 2024 оны 10 дугаар сарын 09-ний өдрийн А-236 дугаар тушаалаар нэмэлт оруулсан./

- 4.1.1. Гадаад зээлийн санхүүжилтын гэрээний баталгаажуулсан хувь
- 4.1.2. Бондын арилжааны баримт
- 4.2. Энэ журмын 4.1.1-д заасан баримтад дараах мэдээлэл тусгагдсан байна.
 - 4.2.1. Санхүүжилтийн дүн
 - 4.2.2. Санхүүжилтийн хугацаа
 - 4.2.3. Хүү
 - 4.2.4. Эргэн төлөлтийн хуваарь
 - 4.2.5. Бусад нөхцөл
- 4.3. Энэ журмын 4.1.2-т заасан баримтад дараах мэдээлэл тусгагдсан байна.
 - 4.3.1. Бондын арилжааны дүн
 - 4.3.2. Өгөөж, купоны хувь хэмжээ
 - 4.3.3. Купоны төлөлтийн хуваарь
 - 4.3.4. Бусад нөхцөл
- 4.4. Банк нь своп хэлцлийг энэ журмын тавдугаар хавсралтын дагуу хэлцэл байгуулах ажлын өдөр 11:00 цагаас өмнө гарын үсэг, тамга тэмдгээр баталгаажуулан Монголбанканд хүргүүлнэ.
- 4.5. Мөнгөний захын үйл ажиллагаа хариуцсан газар нь банкнаас энэ журмын дөрөв, тавдугаар хавсралтын дагуу ирүүлсэн своп хэлцэл байгуулах санал болон бусад баримтыг судалж, биелсэн хэлцлийг цахим арилжааны системд оруулна.
- 4.6. Энэ журмын 4.5-д заасан хэлцлийн төлбөр тооцоо нь цахим арилжааны системээр дамжин автоматаар хийгдэнэ.
- 4.7. Монголбанк банкнаас төлбөрийн даалгавар ирсэн эсэхээс үл хамаарч хүүний болон үндсэн төлбөрийн гүйлгээг хийнэ.
- ~~4.8 Энэ журмын 3.9 д заасан своп хэлцэл сунгах хүсэлт нь дараах шаардлагыг хангасан байна:~~
 - ~~4.8.1 Байгуулаан своп хэлцлийн ханшийн зөрүүг солилцож, хэлцлийг тухайн үеийн журмын нөхцөлийн дагуу шинэчлэн байгуулна.~~
 - ~~4.8.2 Хэлцлийн үндсэн дүнг нэмж сунгах тохиолдолд нэмэгдсэн эх үүсвэр нь энэ журмын 1.3.3-1.3.5 д заасан шаардлагыг хангасан байна.~~
 - ~~4.8.3 Хэлцлийн үндсэн дүнг бууруулж сунгах тохиолдолд буурсан эх үүсвэрт 1.3.3-1.3.5 дахь заалтууд хамаарахгүй болно.~~

/Энэ хэсгийг Монголбанкны Ерөнхийлөгчийн 2024 оны 10 дугаар сарын 09-ний өдрийн А-236 дугаар тушаалаар хүчингүй болсонд тооцсон./

- 4.9. Ногоон таксономигийн (цаашид “ногоон санхүүжилт” гэх) ангилалд багтсан зээлийн эх үүсвэрт ам.долларын хүүнд 0.5%-ийг нэмж тооцож болно.
/Энэ хэсэгт Монголбанкны Ерөнхийлөгчийн 2022 оны 01 дүгээр сарын 13-ны өдрийн А-7 дугаар тушаалаар нэмэлт оруулсан/
- 4.10. Энэ журмын 4.9 дэх заалтын дагуу ногоон санхүүжилтийн ангилалд багтсан зээлийн эх үүсвэрт ам.долларын хүүнд 0.5% нэмж олгосон тохиолдолд Мөнгөний

захын үйл ажиллагаа хариуцсан газар нь холбогдох бусад газар, нэгжтэй хамтрандараах арга хэмжээг авч хэрэгжүүлнэ

/Энэ хэсэгт Монголбанкны Ерөнхийлөгчийн 2022 оны 01 дүгээр сарын 13-ны өдрийн А-7 дугаар тушаалаар нэмэлт оруулсан./

/Энэ хэсэгт Монголбанкны Ерөнхийлөгчийн 2023 оны 09 дүгээр сарын 12-ны өдрийн А-168 дугаар тушаалаар нэмэлт оруулсан /

- 4.10.1 Банк нь урт хугацаат своп хэлцлийн эх үүсвэрээс олгосон ногоон зээлийн тайланг хэлцэл тус бүрээр улирал болгоны эхний долоо хоногт болон хэлцлийн хугацаа дуусах өдрөөс ажлын 5 хоногийн өмнө цахимаар Монголбанканд ирүүлж, албан бичгээр баталгаажуулна.
- 4.10.2 Монголбанк нь банкнаас ирүүлсэн тайланг хянаж, урт хугацаат своп хэлцлийн эх үүсвэрээс ногоон зээлд олгоогүй дүнд нэмж олгосон 0.5%-ийн хүүний төлбөрийг тухайн банкны данснаас үл маргах журмаар суутгана.
- 4.10.3 Банк нь урт хугацаат своп хэлцлийн эх үүсвэрээс олгосон ногоон зээлийн тайланг хэлцлийн хугацаа дуусахаас ажлын 5 хоногийн өмнө Монголбанканд ирүүлээгүй тохиолдолд өмнөх улирлын тайлангийн гүйцэтгэлийг үндэслэл болгоно.
- 4.10.4 Банк нь урт хугацаат своп хэлцлийн эх үүсвэрээс олгосон ногоон зээлийн тайланг Монголбанканд ирүүлээгүй тохиолдолд нэмж олгосон 0.5%-ийн хүүний бүх төлбөрийг банкны данснаас үл маргах журмаар суутгана.
- 4.11 Энэ журмын 4.10-т заасан арга хэмжээнд холбогдох төлбөр тооцоог гүйлгээний шийдвэрт үндэслэн Монголбанкны Санхүү, бүртгэл хариуцсан газар хийж гүйцэтгэнэ.

/ Энэ заалтыг Монголбанкны Ерөнхийлөгчийн 2023 оны 09 дүгээр сарын 12-ны өдрийн А-168 дугаар тушаалаар нэмсэн./

ТАВ. Талуудын эрх

5.1. Монголбанк дор дурдсан эрхтэй:

5.1.1. Своп хэлцэлтэй холбоотой тайлан, мэдээ, мэдээлэл, баримтыг банкнаас гаргуулан авах;

5.1.2. Мөнгөний бодлого, валютын захын тухайн үеийн болон хүлээгдэж буй нөхцөл байдал, банкны өр төлбөрөө төлөх чадвар, бусад хүчин зүйлсийг харгалзан үзэж своп хэлцэл хийх, банкны саналыг хэсэгчлэн, эсвэл бүрэн хэмжээгээр биелүүлэхээс татгалзах, татгалзсан шалтгаанаа тайлбарлахгүй байх.

5.2. Банк дор дурдсан эрхтэй:

5.2.1. Энэ журмын 6.2.1-д заасан гадаад зах зээлээс татсан эх үүсвэрийн 100 хүртэлх хувиар своп хэлцэл байгуулах саналыг Монголбанканд ирүүлэх;

5.2.2. Энэ журмын шаардлагыг хангасан своп хэлцэл байгуулах хүсэлтийг Монголбанканд ирүүлэх.

5.2.3. Банк своп хэлцлийн саналын материалыг бүрэн гүйцэд ирүүлснээс хойш ажлын 5 хоногийн дотор саналаа буцааж, цуцлах.

/Энэ заалтыг Монголбанкны Ерөнхийлөгчийн 2024 оны 10 дугаар сарын 09-ний өдрийн А-236 дугаар тушаалаар нэмсэн./

ЗУРГАА. Талуудын үүрэг

- 6.1. Монголбанк дор дурдсан үүрэгтэй:
- 6.1.1. Монголбанк нь банк тус бүртэй байгуулсан своп хэлцэл, энэ журмын 5.1.1-д заасан мэдээллийн нууцлалыг хангах;
 - 6.1.2. Энэ журамд нэмэлт, өөрчлөлт орсон тохиолдолд ажлын 2 өдрийн дотор банканд мэдэгдэх;
 - 6.1.3. Своп хэлцлийн төлбөр тооцоог саадгүй гүйцэтгэх.
- 6.2. Банк дор дурдсан үүрэгтэй:
- 6.2.1 Своп хэлцлийн ам.долларын эх үүсвэрийг гадаад зээл, өрийн хэрэгсэл, бонд хэлбэрээр гадаад зах зээлээс татан төвлөрүүлэх;
 - 6.2.2 Банк нь хэлцэл хийх үед шаардлагатай ам.долларыг Гадаадын банк дахь харилцах данснаас татаж Монголбанк дахь харилцах дансанд хүрэлцэхүйц хэмжээгээр байршуулах;
 - 6.2.3 Хүү, үндсэн төлбөр төлөгдөх үед Монголбанк дахь төгрөгийн харилцах дансанд хүрэлцэхүйц хэмжээгээр байршуулах;
 - 6.2.4 Монголбанкнаас шийдвэр гаргахад шаардагдах санхүүгийн тайлан, мэдээ, мэдээллийг Монголбанканд заасан хугацааны дотор үнэн, зөв ирүүлэх;
 - 6.2.5 Банкны эрх бүхий ажилтны гарын үсгийн баталгааны өөрчлөлтийн талаар Монголбанканд ажлын 2 өдрийн дотор бичгээр мэдэгдэх;

ДОЛОО. Хэлцлийн үүргийг биелүүлээгүй тохиолдолд авах арга хэмжээ

- 7.1. Банк нь энэ журмын 6.2.2 дахь заалтыг зөрчсөн тохиолдолд тус саналыг Монголбанк цуцалж, сануулга хүргүүлнэ.
- 7.2. Энэ журмын 6.2.3-г заасан төлбөр тооцоог гүйцэтгэхэд банкны Монголбанк дахь төгрөгийн харилцах дансны үлдэгдэл хүрэлцэхгүй тохиолдолд Монголбанк төлбөрийн үлдэгдлийг дараах байдлаар төлүүлнэ:
- 7.2.1. Монголбанк дахь ам.долларын харилцах данснаас тухайн өдөр мөрдөгдөж буй Монголбанкны зарласан албан ханшаар төгрөгт хөрвүүлж, төлүүлнэ.
 - 7.2.2. Монголбанк дахь ам.долларын харилцах дансны үлдэгдэл банкны төлөх төгрөгийн дүнд хүрэлцэхгүй гэж үзсэн бол Банкнаас бусад гадаад валютын харилцах дансны үлдэгдэл, төгрөг, валютын хадгаламжийн үлдэгдэл, эзэмшиж буй ТБҮЦ, ЗГҮЦ-наас суутгаж, төлүүлэхийг баталгаажуулсан энгийн векселийг ажлын 3 хоногийн дотор бичиж ирүүлэхийг шаардана. Уг векселийг үндэслэн Монголбанк холбогдох төлбөрийг төлүүлнэ.
 - 7.2.3. Энэ журмын 7.2.1, 7.2.2-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.
- 7.3. Банк төлбөрийг ЗГҮЦ болон ТБҮЦ-аар барагдуулах тохиолдолд Монголбанкны Эрсдэлийн удирдлага хариуцсан нэгж холбогдох журам, зааварт заасны дагуу уг үнэт цаасны зах зээлийн үнэлгээг хийж, Монголбанкны мөнгөний зах зээлийн үйл ажиллагаа хариуцсан газар уг дүнгээр төлүүлнэ.
- 7.4. Энэ журмын 7.2.3-г заасны дагуу алданги тооцож эхэлснээс хойш банк ажлын 5 хоногт төлбөрийг барагдуулаагүй тохиолдолд Монголбанк хэлцлийн форвард

гүйлгээг цуцалж, 7.2.3-т заасан алдангиас бусад эх үүсвэрийг банкны төгрөгийн харилцах дансанд буцаах бөгөөд хэлцлийн төгрөгийн дүнгийн 0.5 хувьтай тэнцүү мөнгөн торгуулийг ногдуулна.

- 7.5. Энэ журмын 7.1-д заасан сануулга, 7.2, 7.4-т заасан арга хэмжээ тус тус давтагдсан тохиолдолд Монголбанк уг банктай хийсэн своп хэлцлийг нэг талын санаачилгаар цуцалж, банкны саналыг цаашид хүлээн авахаас татгалзаж болно.
- 7.6. Свop хэлцлийн хугацаа дуусахаас өмнө шүүх банкны дампуурлыг зарласан тохиолдолд хэлцлийн хүүгийн төлбөр, сүүлийн гүйлгээг цуцална.
- 7.7. Хэлцлийн үүргийг биелүүлээгүй тохиолдолд авах арга хэмжээг Монголбанкны Мөнгөний бодлогын үйл ажиллагаа хариуцсан газар Монголбанкны холбогдох бусад газар, нэгжтэй хамтран энэ журмын дагуу авч хэрэгжүүлэх бөгөөд холбогдох гүйлгээний шийдвэрийн дагуу төлбөр тооцоог Монголбанкны Санхүү, бүртгэл хариуцсан газар хийж гүйцэтгэнэ.

/Энэ хэсгийг Монголбанкны Ерөнхийлөгчийн 2023 оны 09 дүгээр сарын 12-ны өдрийн А-168 дугаар тушаалаар нэмсэн./

_____оОо_____

“Урт хугацаат своп хэлцлийн журам”-ын
 нэгдүгээр хавсралт
*/Энэ хавсралтыг Монголбанкны Ерөнхийлөгчийн 2024 оны 10 дугаар сарын 09-ний
 өдрийн А-236 дугаар тушаалаар шинэчлэн баталсан./*

СВОП ХЭЛЦЛИЙН ҮНДСЭН НӨХЦӨЛ

д.д	Үзүүлэлтүүд	Нөхцөлүүд
1	Төгрөгийн эх үүсвэрийн хүү	Бодлогын хүү
2	Ам.долларын эх үүсвэрийн хүү	$R_{\text{usd}} = \text{SOFR 3M}$ <i>/Энэ хэсэгт байх LIBOR хүүг SOFR хүү рүү Монголбанкны Ерөнхийлөгчийн 2022 оны 5 дугаар сарын 27-ны өдрийн А-164 тушаалаар шилжүүлсэн./</i>
3	Үндсэн төлбөр солилцох	Хугацааны эцэст: <ul style="list-style-type: none"> Үндсэн төлбөрийн гүйлгээ хийгдэхгүй. Зөвхөн тухайн өдөр мөрдөгдөж буй Монголбанкнаас зарласан албан ханш, эхний гүйлгээний ханшийн зөрүүг ам.долларын эх үүсвэрийн дүнгээр үржүүлэн, төгрөгөөр төлнө.
4	Хүү төлөх хэлбэр	Хүүний төлбөрийг тухайн өдөр мөрдөгдөж буй Монголбанкнаас зарласан албан ханшаар төгрөгт хөрвүүлж, зөрүүг төлнө.
5	Хүүний төлбөр хийгдэх хугацаа, давтамж	3 сар тутам
6	Эхний гүйлгээний ханш	Хэлцэл байгуулах өдөр мөрдөгдөж буй Монголбанкнаас зарласан албан ханш
7	Сүүлийн гүйлгээний ханш	Эхний гүйлгээний ханштай тэнцүү ханш
8	Эх үүсвэрийн хэмжээ <i>/Энэ хэсгийг Монголбанкны Ерөнхийлөгчийн 2024 оны 10 дугаар сарын 09-ний өдрийн А-236 дугаар тушаалаар нэмсэн./</i>	5 (таван) сая ам.доллар болон түүнээс дээш
9	Хугацаа <i>/Энэ хэсгийг Монголбанкны Ерөнхийлөгчийн 2024 оны 10 дугаар сарын 09-ний өдрийн А-236 дугаар тушаалаар нэмсэн./</i>	<ul style="list-style-type: none"> Гадаад зээл, өрийн хэрэгслийн эх үүсвэр: 3(гурван) жил хүртэл Бондын эх үүсвэр: 5(таван) жил хүртэл

Z СПРЕЙД ТООЦОХ АРГАЧЛАЛ

Монгол Улсын Засгийн газрын олон улсын зах зээл дээр хамгийн сүүлд гаргасан ам.долларын бондын зах зээлийн хаалтын үнэд үндэслэн дараах тэнцэтгэлээр Z спрейдийг тооцоолно.

$$P = \frac{R}{\left(1 + \frac{y_N + ZS}{freq}\right)^{\left(N - 1 + \frac{DSC}{E}\right)}} + \sum_{k=1}^N \frac{C/freq}{\left(1 + \frac{y_k + ZS}{freq}\right)^{\left(k - 1 + \frac{DSC}{E}\right)}}$$

Хэлцэл байгуулах өдөр дээрх бондын өнөөгийн үнэ цэнийн томъёонд Z-спрэдээ бусад үзүүлэлтүүд өмнөх өдрийн байдлаар мэдэгдэж байгаа бөгөөд Z-спрэдийг Excel програмын Solver ашиглан тооцно. Z-спрэд нь хүү шинэчлэх тутам шинэчлэгдэх болно.

Үзүүлэлт	Тайлбар
P	Монгол Улсын Засгийн газрын олон улсын зах зээл дээр хамгийн сүүлд гаргасан ам.долларын бондын өмнөх өдрийн хаалтын үнэ (Last Price)
y_k, y_N	Өмнөх өдрийн байдлаарх АНУ-ын Засгийн газрын үнэт цаасны харгалзах хугацааны өгөөж
ZS	Z-спрейд
C	Монгол Улсын Засгийн газрын бондын купон
R	Бондын үндсэн төлбөр
k	Купон төлөгдөх үе
E	Купон төлөгдөх үе хоорондын хугацаа (хөногөөр)
DSC	Тухайн бондын үнийг татсан өдрөөс дараагийн купон төлөгдөх хүртэлх хугацаа (хөногөөр)
$freq$	Жилд купон төлөгдөх давтамж
N	Купоны тоо

Эх сурвалж: Блүүмберг

/Энэ хавсралтыг Монголбанкны Ерөнхийлөгчийн 2024 оны 10 дугаар сарын 09-ний өдрийн А-236 дугаар тушаалаар хүчингүй болсонд тооцсон./

**УРТ ХУГАЦААТ СВОП ХЭЛЦЛИЙН
ХҮҮНИЙ НӨХЦӨЛ**

Танай банктай оны сарын ний/ны өдөр байгуулсан дүнтэй урт хугацаат ам.долларын своп хэлцлийн хүүний төлбөр төлөх нөхцөлийг хүргүүлж байна.

1. Хэлцлийн дугаар
2. Банкны нэр
3. Хүүний төлбөр төлөх огноо
4. Хүү тооцох хоног
5. Ам.долларын эх үүсвэрийн хүү*
6. Төгрөгийн эх үүсвэрийн хүү

* “Урт хугацаат своп хэлцлийн журам”-ын нэг, хоёрдугаар хавсралтын дагуу Блүүмберг терминал дахь эх сурвалжид үндэслэн тооцно.

_____оОо_____

“Урт хугацаат своп хэлцлийн журам”-ын
дөрөвдүгээр хавсралт
*/Энэ хавсралтыг Монголбанкны Ерөнхийлөгчийн 2024 оны 10 дугаар сарын 09-ний
өдрийн А-236 дугаар тушаалаар шинэчлэн баталсан./*

УРТ ХУГАЦААТ СВОП ХЭЛЦЭЛ БАЙГУУЛАХ ҮНДЭСЛЭЛ

БАНКНЫ НЭР: _____ **ОГНОО:** _____

Д/д	Үзүүлэлтүүд	Тайлбар	Мэдээлэл тусгагдсан баримтын нэр	Гэрээний хуудасны дугаар
1	Санхүүжилтийн төрөл:			
2	Зээлдэгчийн нэр:			
3	Зээлдүүлэгчийн нэр:			
4	Зээлийн зориулалт:			
5	Зээлийн гэрээ байгуулсан огноо:			
6	Санхүүжилт авсан огноо:			
7	Зээлийн төлөгдөх огноо:			
8	Зээлийн хэмжээ:			
9	Тайлант онд татсан хэмжээ:			
10	Зээлийн хүү:			
11	Хүү тооцох давтамж:			
12	Үндсэн төлбөр төлөх давтамж:			

УРТ ХУГАЦААТ СВОП ХЭЛЦЭЛ БАЙГУУЛАХ САНАЛ

Үзүүлэлтүүд	
13	Хэлцлийн хэмжээ:
14	Хэлцлийн дуусах огноо:

- Монголбанкны урт хугацаат своп хэлцлийн журамд заасан нөхцөлийг хангаж, үүргийг гүйцэтгэхийг үүгээр хүлээн зөвшөөрч байна.

БАТАЛГААЖУУЛСАН:

(Албан тушаал, Овог, нэр)

(Гарын үсэг) (ТАМГА) Бэлтгэсэн:(Мэдээлэл бэлтгэсэн ажилтны овог, нэр, албан тушаал)

Утас: (Мэдээлэл бэлтгэсэн ажилтантай холбоо барих утасны дугаар)

УРТ ХУГАЦААТ СВОП ХЭЛЦЭЛ

Хэлцэл байгуулсан огноо: оны сарын өдөр
1. Банкны нэр :
2. Хугацаа : хоног
3. Эхний гүйлгээ:	
3.1 Худалдах валют	Ам.доллар
3.2 Хэмжээтоогоор (үсгээр)
3.3 Монголбанкнаас зарласан албан ханш
4. Хүүний төлбөр:	
4.1. Төгрөгийн эх үүсвэрийн хүү	/Энэ журмын нэгдүгээр хавсралтад заасны дагуу/
4.2. Ам.долларын эх үүсвэрийн хүү	/Энэ журмын нэгдүгээр хавсралтад заасны дагуу/
4.3. Хүү тооцох давтамж	3 сар тутам
4.4. Хүү хөрвүүлэх ханш	Тухайн өдөр мөрдөгдөж буй МБ-наас зарласан ханш
4.5. Хүү төлөх хэлбэр	Нэттинг гүйлгээ
5. Буцах гүйлгээ	
5.1. Огноо оны сарын өдөр

МОНГОЛБАНКИЙГ ТӨЛӨӨЛЖ:

БАНКИЙГ ТӨЛӨӨЛЖ:

САНХҮҮГИЙН ЗАХ ЗЭЭЛИЙН
ГАЗРЫН ЗАХИРАЛ

ЭРХ БҮХИЙ ЗАХИРАЛ

ЦАХИМ ШУУДАНГИЙН ХАЯГ