

(სსმ III, 14.05.2009 N 59 მუხ. 668)

რეგისტრირებულია
საქართველოს იუსტიციის
სამინისტროში
სარეგისტრაციო კოდი
220.010.050.18.011.013.107

**საქართველოს ეროვნული ბანკის პრეზიდენტის
ბრძანება N 127/01
2009 წლის 11 მაისი ქ. თბილისი**

**„საქართველოს ეროვნული ბანკის მიერ შიდა ბაზარზე
სავალუტო სვოპ ოპერაციების განხორციელების შესახებ“
დებულების დამტკიცების თაობაზე**

„საქართველოს ეროვნული ბანკის შესახებ“ საქართველოს ორგანული კანონის მე-2 მუხლის მე-3 პუნქტის „ა“ ქვეპუნქტის, მე-10 მუხლის მე-3 პუნქტის „ა“ და „ბ“ ქვეპუნქტების და 67-ე მუხლის მე-4 პუნქტის შესაბამისად, ფულად-საკრედიტო და სავალუტო პოლიტიკის განხორციელების ხელშეწყობის მიზნით, **ვბრძანებ:**

1. დამტკიცდეს „საქართველოს ეროვნული ბანკის მიერ შიდა ბაზარზე სავალუტო სვოპ ოპერაციების განხორციელების შესახებ“ თანდართული დებულება.

2. ძალადაკარგულად გამოცხადდეს „საქართველოს ეროვნული ბანკის მიერ შიდა ბაზარზე სავალუტო სვოპ ოპერაციების განხორციელების შესახებ დებულების დამტკიცების თაობაზე“ საქართველოს ეროვნული ბანკის პრეზიდენტის 2005 წლის 22 თებერვლის N 40 ბრძანება,

3. ბრძანების დაუყოვნებლივ ამოქმედება განპირობებულია ქვეყანაში მონეტარული პოლიტიკის ეფექტურობის ამაღლების, ფინანსური და ფასების სტაბილურობის შენარჩუნების მიზნით.

4. ეს ბრძანება ამოქმედდეს ხელმოწერისთანავე.

გ. ქადაგიძე

დებულება

საქართველოს ეროვნული ბანკის მიერ შიდა ბაზარზე სავალუტო სვოპ ოპერაციების განხორციელების შესახებ

მუხლი 1. ზოგადი დებულებები

1. წინამდებარე დებულება განსაზღვრავს საქართველოს ეროვნული ბანკის (შემდგომში „ეროვნული ბანკი“) მიერ შიდა სავალუტო ბაზარზე სვოპ ოპერაციების (შემდგომში „სვოპ ოპერაცია“) ჩატარების წესს და პირობებს.

2. სვოპ ოპერაცია წარმოადგენს ფულად-საკრედიტო პოლიტიკის ინსტრუმენტს, რომლის მეშვეობითაც ეროვნული ბანკი წინასწარ განსაზღვრული ვადით, აუქციონის წესით ყიდულობს უცხოურ ვალუტას სპოტ კურსით, მისი ფორვარდული კურსით უკან გაყიდვის პირობით.

3. ეროვნული ბანკი სვოპ ოპერაციებს გამოიყენებს საბანკო სისტემისათვის ეროვნული ვალუტით ფულადი რესურსების მისაწოდებლად, ქვეყანაში ფულადი მასის რეგულირებისა და ეროვნული ვალუტით საბანკო შუამავლობის ხელშეწყობის მიზნით.

4. აუქციონში მონაწილეობა შეიძლება მიიღოს იმ რეზიდენტმა კომერციულმა ბანკებმა და არარეზიდენტი ბანკების ფილიალებმა (შემდგომში „ბანკი“), რომელთაც ეროვნულ ბანკში გახსნილი აქვთ სვოპ ოპერაციაში გამოყენებული უცხოური ვალუტის შესაბამისი საკორესპოდენტო ანგარიშები (შემდგომში „უცხოური ვალუტის ანგარიში“).

მუხლი 2. ტერმინთა განმარტება

ამ დებულებაში გამოყენებულ ტერმინებს აქვთ შემდეგი მნიშვნელობა:

ა) სპოტ კურსი – კურსი, რომლითაც მოხდება ანგარიშსწორება გარიგების ვალუტირების დღეს.

ბ) ფორვარდული კურსი – კურსი, რომლითაც მოხდება ანგარიშსწორება გარიგების ვადის გასვლის დღეს;

გ) მრავალი ფასის მეთოდი – აუქციონის ტიპი, როდესაც ყველა წარმატებული განაცხადი კმაყოფილდება წარმოდგენილი ფასით;

დ) ბლუმბერგის სისტემა – სავაჭრო ელექტრონული სისტემა, რომლის საშუალებითაც ხდება გარიგებების დადება;

ე) სპოტ და ფორვარდული ანგარიშსწორების თარიღები – გარიგების ვალუტირების დღე და გარიგების ვადის გასვლის დღე;

მუხლი 2. აუქციონის პირობები

1. ეროვნული ბანკი სვოპ ოპერაციის აუქციონს (შემდგომში აუქციონი) ატარებს მრავალი ფასის მეთოდით.

2. აუქციონის ვალუტას, გასაყიდი ვალუტის ოდენობას, სპოტ და ფორვარდული ანგარიშსწორების თარიღებს, სპოტ კურსს, განაცხადების მიღების დროს, ასევე საჭიროების შემთხვევაში უცხოური ვალუტის საპროცენტო განაკვეთს

და ფორვარდული კურსის ან ეროვნული ვალუტის საპროცენტო განაკვეთის მინიმალურ ან/და მაქსიმალურ მნიშვნელობას, ადგენს ეროვნული ბანკი.

3. სვოპ ოპერაციის ვადიანობა შეიძლება განისაზღვროს 6 თვიდან 1 წლამდე.

4. კომერციულ ბანკს შეუძლია სვოპ გარიგების ვადაზე ადრე შეწყვეტა, რის შესახებაც მინიმუმ 1 თვით ადრე წერილობით უნდა შეატყობინოს ეროვნულ ბანკს.

5. აუქციონის ჩატარების შესახებ შეტყობინებას ეროვნული ბანკი კომერციულ ბანკებს გაუგზავნის აუქციონის ჩატარებამდე არაუგვიანეს ერთი დღით ადრე ბლუმბერგის სისტემის მეშვეობით.

6. ეროვნულ ბანკს შეუძლია დაადგინოს სვოპ ოპერაციების მთლიანი პორტფელის ლიმიტები ან ინდივიდუალური ლიმიტები კომერციული ბანკებისათვის.

მუხლი 3. განაცხადის წარდგენის წესი

1. აუქციონში მონაწილეობის მისაღებად, კომერციული ბანკი ეროვნულ ბანკში განაცხადს აგზავნის საინფორმაციო სისტემა ბლუმბერგის მეშვეობით. განაცხადში მითითებული უნდა იყოს შემდეგი აუცილებელი ინფორმაცია:

ა) სპოტ კურსი (იმ ფორმატით, რა ფორმატითაც არის გამოსახული ოფიციალური გაცვლითი კურსი ამ ვალუტის მიმართ).

ბ) ფორვარდული კურსი ან ეროვნული ვალუტის საპროცენტო განაკვეთი.

გ) ეროვნული და უცხოური ვალუტის მოცულობა.

დ) სპოტ და ფორვარდული ანგარიშსწორების თარიღები.

2. თითო ბანკიდან დასაშვებია მაქსიმუმ 1 განაცხადის მიღება.

3. განაცხადის გამოგზავნით ბანკი ადასტურებს აუქციონში მონაწილეობის სურვილს და ამ დებულებით დადგენილი წესების შესრულების ვალდებულებას.

4. ტექნიკური პრობლემების წარმოშობის შემთხვევაში დასაშვებია აუქციონზე განაცხადების მიღების დროის შეცვლა.

5. თუ ტექნიკური პრობლემები საფრთხეს უქმნის გამოცხადებული აუქციონის გამართულად ჩატარებას, ეროვნულ ბანკს შეუძლია მოახდინოს გამოცხადებული აუქციონის გაუქმება.

6. ეროვნული ბანკი არ მიიღებს განაცხადს, რომელიც ვადაზე ადრე ან დაგვიანებით არის წარმოდგენილი, ან არ შეიცავს ყველა აუცილებელ ინფორმაციას, ან შეიცავს მონაცემებს რომლებიც შეუსაბამოა გამოცხადებული აუქციონის პარამეტრებთან.

მუხლი 4. აუქციონის ჩატარების წესი

1. აუქციონზე წარმოდგენილი განაცხადები დაკმაყოფილდება ფორვარდ კურსის (ან ლარებში საპროცენტო განაკვეთის) კლების მიხედვით და აუქციონი დამთავრდება მაშინ, როდესაც დალაგებული განაცხადების საერთო თანხა გაუთანაბრდება აუქციონზე გასაყიდად გატანილი ვალუტის საერთო თანხას ან განაცხადების ფორვარდ კურსი (ან ლარებში საპროცენტო განაკვეთი) გაუთანაბრდება აუქციონის მინიმალურ ფორვარდულ კურსს (ან ლარებში

საპროცენტო განაკვეთს). იმ შემთხვევაში, თუ აუქციონის დასრულებისას ყველაზე დაბალი ერთი და იგივე ფორვარდ კურსის (ან ლარებში საპროცენტო განაკვეთის) მქონე რამდენიმე განაცხადის თანხა აღემატება ჯერ კიდევ განუთავსებელი თანხის ოდენობას, ეს განაცხადები დაკმაყოფილდება პროპორციული განაწილების პრინციპით, მძიმის შემდეგ რიცხვის მე-100-მდე დამრგვალებით.

2. კომერციულ ბანკებს აუქციონში მათი მონაწილეობის შედეგები ეგზავნებათ ბლუმბერგის სისტემის მეშვეობით.

მუხლი 5. ანგარიშსწორება

1. სპოტ ანგარიშსწორების დღეს, დაკმაყოფილებული განაცხადის შესაბამისად, ეროვნული ბანკი, კომერციული ბანკის უცხოური ვალუტის ანგარიშიდან ახდენს ვალუტის ჩამოწერას და ეროვნული ვალუტის საკორესპოდენტო ანგარიშზე შესაბამისი თანხის ჩარიცხვას. ფორვარდ ანგარიშსწორების დღეს, გარიგების პირობების შესაბამისად, ეროვნულ ბანკი, კომერციული ბანკის ეროვნული ვალუტის საკორესპოდენტო ანგარიშიდან ახდენს თანხის ჩამოწერას და უცხოური ვალუტის საკორესპოდენტო ანგარიშზე შესაბამისი თანხის ჩარიცხვას.

2. თუ კომერციულმა ბანკმა შესაბამის სავალუტო ანგარიშზე, სპოტ ანგარიშსწორების დღის 15:30 საათამდე ვერ უზრუნველყო ანგარიშსწორებისათვის საკმარისი თანხის ჩარიცხვა, გარიგება უქმდება და ბანკს მომდევნო ერთი წლის განმავლობაში ეკრძალება სვოპ აუქციონებში მონაწილეობის მიღება.

3. თუ ბანკის საკორესპოდენტო ანგარიშზე ფორვარდ ანგარიშსწორების დღის 15:30 საათამდე არ აღმოჩნდა საკმარისი თანხა, ანგარიშსწორება განხორციელდება მომდევნო საბანკო დღეს. თუ ფორვარდ ანგარიშსწორების დღეს, სამუშაო დღის ბოლომდე არ მოხდება თანხების ჩარიცხვა, ბანკს დაეკისრება ჯარიმა მთლიანად დასაბრუნებელი თანხის 2 პროცენტის ოდენობით. თუ ბანკის საკორესპოდენტო ანგარიშზე, ფორვარდ ანგარიშსწორების დღის შემდეგი საბანკო დღის 15:30 საათამდეც არ აღმოჩნდა საკმარისი თანხა, ეროვნული ბანკი უფლებამოსილია დაიკმაყოფილოს თავისი მოთხოვნა მოქმედი კანონმდებლობით დადგენილი წესით. ამასთან დარჩენილ დავალიანების თანხას ყოველდღიურად, ჯარიმის სახით დაერიცხება ერთდღიან სესხზე დადგენილი საპროცენტო განაკვეთის ორმაგი ოდენობა.

4. ჯარიმის ჩამოწერა განხორციელდება ეროვნული ვალუტის ანგარიშიდან, თანხის უკმარისობის შემთხვევაში, აშშ დოლარის საკორესპოდენტო ანგარიშიდან და სხვა უცხოური ვალუტის საკორესპოდენტო ანგარიშებიდან. ჯარიმის თანხის გაანგარიშებისას და გადახდისას გამოყენებული იქნება იმ დღის ოფიციალური კურსები. თუ ბანკის საკორესპოდენტო ანგარიშ(ებ)იდან ჩამოჭრილი თანხა არასაკმარისი აღმოჩნდა ჯარიმის დასაფარად, ეროვნული ბანკი უფლებამოსილია დაიკმაყოფილოს თავისი მოთხოვნა მოქმედი კანონმდებლობით დადგენილი წესით.

5. სვოპ გარიგების ვადაზე ადრე შეწყვეტის შემთხვევაში ფორვარდულ ანგარიშსწორების თარიღად ჩაითვლება ბანკის მიერ მითითებული ოპერაციის შეწყვეტის თარიღი. ახალი ფორვარდ კურსი გამოითვლება დანართი 1-ში მოცემული

ფორმულის შესაბამისად, სვოპის მოქმედების ფაქტიური ვადის გათვალისწინებით, ისე რომ ეროვნული და უცხოური ვალუტის საპროცენტო განაკვეთები რჩება უცვლელი.

დანართი 1

შემდეგი ფორმულა განსაზღვრავს გარიგების ფორვარდულ კურსს

$$F = S \frac{1 + R_D \frac{T}{365}}{1 + R_F \frac{T}{365}}$$

სადაც:

FF არის ეროვნული ვალუტის ფორვარდული კურსი.

SS არის ეროვნული ვალუტის სპოტ კურსი.

$R_F R_F$ არის უცხოური ვალუტის საპროცენტო განაკვეთი.

$R_D R_D$ არის ეროვნული ვალუტის საპროცენტო განაკვეთი.

TT არის გარიგების ვადა: ფორვარდული და სპოტ ანგარიშსწორების თარიღებს შორის დღეების რაოდენობა.