नेपाल राष्ट्र बैंक
केन्द्रीय कार्यालय
विदेशी विनिमय व्यवस्थापन विभाग

इ.प्रा.परिपत्र संख्याः- ६०५ मिति :- २०७०/८/६

नेपाल राष्ट्र बैंक, बैकिङ्ग कार्यालय लगायत अन्य कार्यालय र इजाजतपत्रप्राप्त “क” वर्ग बैंकहरु ।

विषय :- <u>Forward कारोवार सम्वन्धमा ।</u>

महाशय,

यस बैंकवाट इजाजतपत्रप्राप्त "क" वर्गका बैंकहरुले आफूसंग मौज्दात रहेको परिवर्त्य विदेशी मुद्राको लगानी व्यबस्थापन तथा विनिमय दरमा हुने उतार चढावको कारणले हुन सक्ने जोखिम व्यबस्थापनको लागि प्रचलित व्यबस्था बमोजिम डेरीभेटिभ्स (Derivatives) सम्वन्धी कारोवार अन्तर्गत फरवार्ड (Forward) को कारोवार गर्दा आसन्न जोखिमलाई पूर्णतया ध्यानमा राख्ने तथा सट्टेवाजी (Speculative) कारोवार नहुने गरी देहाय बमोजिमको शर्तहरुको अधिनमा रही कारोवार गर्नुपर्ने व्यबस्था गरिएको हुंदा सोही बमोजिम गर्नु गराउनु हुन विदेशी विनिमय (नियमित गर्ने) ऐन, २०१९ को दफा १२ ले दिएको अधिकार प्रयोग गरी यो परिपत्र जारी गरिएको छ ।

(१) Forward कारोवारमा Open Position राख्न नपाइने अर्थात उक्त कारोवार Completely Square Up Position हुनु पर्ने ।

(२) Forward कारोवारको Exposure परिवर्त्य विदेशी मुद्रामा देखाउनु पर्ने ।

(३) Proprietary Forward कारोवारको बक्यौता (Outstanding) खरिद र विक्री (Buy/Sale दुवै जोडेर) प्राथमिक पूंजीको २० प्रतिशत भन्दा बढी हुन नहुने ।

(४) Proprietary कारोवार ३ महिनाभन्दा बढी अवधिको गर्न नपाईने ।

(५) Forward कारोवारको खुद हिसाव मिलान (Net Settlement) गर्दा विदेशी विनिमय वर्हिगमन हुने अवस्थामा विद्यमान व्यवस्था बमोजिम यस बैंकको पूर्व स्वीकृति लिनु पर्ने ।

(६) Forward कारोवारको साप्ताहिक विवरण यसैसाथ संलग्न फाराम अनुसार भरी हरेक आइतवार विदेशी विनिमय व्यबस्थापन विभागमा पठाउनु पर्ने ।

भवदीय,

(भिष्मराज ढुंगाना)
का.मु.कार्यकारी निर्देशक

<u>बोधार्थ:</u>

१. श्री गभर्नरको कार्यालय ।
२. श्री डेपुटी गभर्नरको कार्यालय ।
३. श्री नेपाल सरकार, अर्थ मन्त्रालय, वित्तीय क्षेत्र व्यबस्थापन महाशाखा, सिंहदरवार, काठमाण्डौ ।
४ श्री बैंक तथा वित्तीय संस्था नियमन विभाग ।
५. श्री बैंक सुपरिवेक्षण विभाग ।
६. श्री वित्तीय संस्था सुपरिवेक्षण विभाग ।
७. श्री आन्तरिक लेखा परीक्षण विभाग ।
८. श्री सूचना प्रविधि विभाग ।
९. श्री नेपाल बैंकर्स संघ, हेरिटेज प्लाजा, काठमाण्डौ ।
१०. श्री डेभलपमेन्ट बैकर्स एशोसिएशन, पो.व.नं. २१०२६, अनामनगर, काठमाण्डौ ।

नेपाल राष्ट्र बैंक
विदेशी विनिमय व्यवस्थापन विभाग
इ.प्रा. परिपत्रसंख्या ६०५ को प्रयोजनका लागि

… … … … … … … … … … … … … … … BANK LIMITED
OUTSTANDING OF FORWARD TRANSACTIONS
As on … … … … … … …
Weekly Reporting Format (Sunday - Friday)

A. Proprietary Transactions

Deal Date	Forward Amount (in US$)	Forward Rate	Value Date	Direction of Transactions (Buy/Sale)	Counterparty	Remarks
Total in USD						
Exchange rate						
Total in NPR						

Core Capital (Rs. in million)	
Total Proprietary Forward (Rs. in million) % of Core Capital	
Net Settlement During the Week (Rs. in Million)	

B. Non-Proprietary Transactions

Deal Date	Forward Amount (in US$)	Forward Rate	Value Date	Direction of Transactions (Buy/Sale)	Requesting Customers	Counterparty	Remarks
Total in USD							