

ЗАТВЕРДЖЕНО  
Наказ  
Національного банку України  
23 червня 2020 року № 425-но

Порядок про розрахунок та оприлюднення довідкового індексу  
міжбанківських ставок за угодами своп

1. Розрахунок та оприлюднення довідкового індексу міжбанківських ставок за угодами своп (далі – довідковий своп-індекс) здійснюються з метою надання учасникам ринку інформації щодо індикаторів вартості ресурсів на міжбанківському ринку України, які залучаються шляхом проведення операцій своп на строк овернайт.

2. Розрахунок довідкового своп-індексу здійснюється за підсумками кожного робочого дня на підставі інформації про угоди, визначені в пункті 3 цього Порядку, інформація про які доступна для використання під час розрахунку довідкового своп-індексу за станом на 08.00 за київським часом наступного робочого дня після укладання угод.

Якщо після часу, визначеного в абзаці першому цього пункту, Національному банку України (далі – Національний банк) засобами відповідних каналів обміну інформацією торговельно-інформаційних систем (далі – ТІС) надаватиметься додаткова/відкоригована інформація за угодами попереднього робочого дня, то значення довідкового своп-індексу перерахуванню не підлягає.

3. Довідковий своп-індекс розраховується на підставі інформації про усі укладені за допомогою функціоналів ТІС операції з купівлі доларів США за гривні на умовах своп на строк овернайт.

4. Під угодами на строк овернайт для цілей пункту 3 цього Порядку маються на увазі угоди із завершенням розрахунків наступного робочого дня після дати укладання. Якщо наступний робочий день після дня укладання угоди своп є неробочим днем у США, то для цілей розрахунку довідкового своп-індексу на строк овернайт за цей день беруться угоди із терміном завершення розрахунків не пізніше наступних двох робочих днів після дня укладання угоди.

Джерелом інформації про такі угоди є дані, які отримуються Національним банком засобами каналів обміну інформацією з ТІС.

5. Розрахунок довідкового своп-індексу за певну дату здійснюється, якщо станом на 08.00 наступного робочого дня Національному банку засобами

відповідних каналів обміну інформацією ГІС надана інформація стосовно не менше п'яти угод, контрагентами за якими виступили не менше трьох різних банків.

Якщо зазначені умови не виконуються, то розрахунок довідкового своп-індексу не здійснюється, а в інформації, яка підлягає оприлюдненню, у відповідній позиції зазначається символ “-”.

6. Для розрахунку довідкового своп-індексу використовуються розрахункові значення відсоткових ставок, які обраховуються за формулою, наведеною в додатку до цього Порядку.

7. Розрахунок довідкового своп-індексу здійснюється у відсотках річних з точністю до чотирьох знаків після коми відповідно до додатка до цього Порядку.

8. Оприлюднення довідкового своп-індексу за відповідний робочий день здійснюється до 10.00 наступного робочого дня на сторінці офіційного Інтернет-представництва Національного банку.

9. Зміни до порядку розрахунку довідкового своп-індексу за угодами своп набирають чинності не раніше ніж через тиждень після їх затвердження.

10. Національний банк публікує на сторінці офіційного Інтернет-представництва Національного банку повний архів значень довідкового своп-індексу, починаючи з часу започаткування його розрахунку, а також усі варіанти (уключаючи чинний) порядку розрахунку довідкового своп-індексу із зазначенням часового проміжку, упродовж якого вони діяли.

Директор Департаменту  
відкритих ринків

Сергій ПОНОМАРЕНКО

Додаток  
до Порядку про розрахунок та  
оприлюднення довідкового індексу  
міжбанківських ставок за угодами  
своп  
(пункти 6, 7)

## Розрахунок довідкового індексу міжбанківських ставок за угодами своп

1. З угод, відібраних відповідно до пунктів 2, 3 Порядку про розрахунок та оприлюднення довідкового індексу міжбанківських ставок за угодами своп, формується первісна вибірка угод для розрахунку довідкового своп-індексу.

2. Для розрахунку довідкового своп-індексу використовуються розрахункові значення відсоткових ставок за визначеними в пунктах 2, 3 Порядку про розрахунок та оприлюднення довідкового індексу міжбанківських ставок за угодами своп угодами, які обраховуються за такою формулою:

$$\text{Ставка\_своп} = [(\text{FX rate 2} - \text{FX rate 1}) \cdot 365 \cdot 100\% ] : [\text{FX rate 1} \cdot (\text{Date 2} - \text{Date 1})],$$
де: Ставка\_своп – ставка за операціями з купівлі іноземної валюти на умовах своп;

FX rate 1 – курс угоди за першою частиною операції своп;

FX rate 2 – курс угоди за другою частиною операції своп;

Date 1 – дата валютування по гривні за першою операцією своп;

Date 2 – дата валютування по гривні за другою операцією своп;

365 – розрахункова кількість календарних днів у році.

3. Отриманий у результаті виконання пункту 1 цього додатка ряд угод ранжується від найменшого до найбільшого значення відсоткової ставки.

З отриманого ранжованого ряду відсікаються 5% угод від загальної їх кількості зверху ряду та 5% угод від загальної їх кількості знизу ряду.

Якщо 5% угод від загальної кількості угод не є цілим числом, то відповідна величина округлюється до цілого числа.

4. Із ряду угод, отриманих після виконання пункту 3 цього додатка, розраховується стандартне відхилення відсоткової ставки за такою формулою:

$$\sigma_r = \sqrt{\frac{\sum_{i=1}^n (X_{ri} - \bar{X}_r)^2}{n}},$$

де  $\sigma_r$  – стандарте відхилення відсоткової ставки;

$X_{ri}$  – відсоткова ставка  $i$ -ї угоди;

$\bar{X}_r$  – середньоарифметичне значення ряду відсоткових ставок;  
 $n$  – кількість угод.

5. Із ряду угод, отриманого після виконання пункту 3 цього додатка, відсікаються угоди, відсоткова ставка за якими відхиляється від середньоарифметичного значення відсоткової ставки  $\bar{X}_r$  більше ніж на два стандартні відхилення відсоткової ставки  $\sigma_r$ .

6. Отриманий після виконання пункту 5 цього додатка ряд угод вважається базовим рядом для розрахунку довідкового своп-індексу.

7. Значення довідкового своп-індексу розраховується як звичайне середнє арифметичне значення базового ряду.