

ЗАТВЕРДЖЕНО
Постанова Правління
Національного банку України
від 03 грудня 2015 року № 860
(зі змінами внесеними
Рішенням Правління
Національного банку України
від 19 липня 2018 року №466-рш)

Порядок розрахунку та оприлюднення Українського індексу міжбанківських ставок

I. Загальні положення

1. Розрахунок та оприлюднення Українського індексу міжбанківських ставок [Ukrainian Index of Interbank Rates (далі – індекс UIIR)] здійснюється з метою надання учасникам ринку об'єктивних індикаторів вартості гривневих ресурсів на міжбанківському ринку України.

2. Значення індексу UIIR є індикативними, тобто жоден з учасників ринку та Національний банк України не несуть жодних зобов'язань укладати угоди за відповідними параметрами.

3. Розрахунок індексу UIIR здійснюється щодня (за підсумками кожного робочого дня) на підставі інформації про угоди з надання/розміщення гривневих ресурсів, які були укладені банками на міжбанківському ринку України у відповідний день з іншими банками та інформація про які була надана Національному банку через відповідні канали обміну інформацією торговельно-інформаційними системами (далі – ТІС) до 9 години наступного робочого дня за київським часом.

4. Розрахунок та оприлюднення індексу UIIR здійснюється за двома категоріями міжбанківських угод:

1) “кредити та депозити”, до яких для цілей розрахунку індексу UIIR включаються усі укладені за допомогою функціоналів ТІС операції із надання кредитів та розміщення депозитів (у тому числі інформація за пролонгованими угодами);

2) “угоди своп”, до яких для цілей розрахунку індексу UIIR включаються усі укладені за допомогою функціоналів ТІС операції з купівлі доларів США за гривні на умовах “своп”.

5. За кожною категорією, визначеною у пункті 4, розрахунок та оприлюднення індексу UIR здійснюється за угодами зі строком:

1) овернайт, під якими для цілей цього Порядку розуміються угоди із завершенням розрахунків наступного робочого дня після дати укладання;

2) один тиждень, під яким для цілей цього Порядку розуміються угоди із завершенням розрахунків через сім календарних днів після дати укладання або найближчого робочого дня після цієї дати (якщо через сім календарних днів після відповідного робочого дня заплановано неробочий день/неробочі дні у зв'язку з державними святами, перенесенням вихідних днів тощо);

3) два тижні, під якими для цілей цього Порядку розуміються угоди із завершенням розрахунків через 14 календарних днів після дати укладання або найближчого робочого дня після цієї дати (якщо через 14 календарних днів після відповідного робочого дня заплановано неробочий день/неробочі дні у зв'язку з державними святами, перенесенням вихідних днів тощо);

4) один місяць, під яким для цілей цього Порядку розуміються угоди із завершенням розрахунків через 29 – 32 календарні дні після дати укладання;

5) три місяці, під якими для цілей цього Порядку розуміються угоди із завершенням розрахунків через 85 – 95 календарних днів після дати укладання.

6. Розрахунок та оприлюднення усіх значень індексу UIR здійснюється в відсотках річних з точністю до чотирьох знаків після коми.

II. Умови та порядок розрахунку, оприлюднення індексу UIR

7. Пункт виключено.

8. Розрахунок індексу UIR для кожного строку кожної категорії здійснюється лише в тому разі, якщо станом на 9 год. 00 хв. ранку наступного робочого дня Національному банку через відповідні канали обміну інформацією ТІС була надана інформація стосовно хоча б п'яти угод відповідного строку та категорії, контрагентами за якими виступили не менше ніж три різні банки. Якщо зазначені умови не виконуються, то розрахунок індексу UIR для відповідного строку та категорії не здійснюється, а в інформації, яка підлягає оприлюдненню, у відповідній позиції зазначається символ “-”.

9. Для розрахунку індексу UIR за категорією “кредити та депозити” використовуються номінальні відсоткові ставки, відображені банками за відповідними угодами.

10. Для розрахунку індексу UIIR за категорією “угоди своп” використовуються розрахункові значення відсоткових ставок, які обраховуються за такою формулою:

$$\text{Stavka_swap} = \frac{[(\text{FX rate 2} - \text{FX rate 1}) \cdot 365 \cdot 100\%]}{(\text{FX rate 1} \cdot (\text{Date 2} - \text{Date 1}))},$$

де: Stavka_swap – 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;

Date 2 – дата валютування по гривні за другою операцією;

365 – розрахункова кількість днів у році.

11. Розрахунок індексу UIIR для кожного строку кожної категорії здійснюється в такому порядку:

1) усі угоди відповідного строку та категорії ранжуються від найменшої до найбільшої 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;

2) із ряду угод, отриманих після виконання підпункту 1 цього пункту, розраховується стандартне відхилення процентної ставки за такою формулою:

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

де σ_r – стандартне відхилення процентної ставки;

X_{ri} – процентна ставка i -ї угоди;

\bar{X}_r – середньоарифметичне значення ряду процентних ставок;

n – кількість угод.

3) із ряду угод, отриманого після виконання підпункту 1 цього пункту, відсікаються угоди, процентна ставка яких відхиляється від

середньоарифметичного значення процентної ставки $\overline{X_r}$ більше ніж на два стандартні відхилення процентної ставки σ_r ;

4) отриманий після виконання підпункту 3 цього пункту ряд угод вважається базовим рядом для розрахунку індексу UIR;

5) значення UIR розраховується як звичайне середнє арифметичне значення базового ряду.

12. Оприлюднення індексу UIR за відповідний робочий день здійснюється до 10 год. 00 хв. ранку наступного робочого дня на сторінках Офіційного інтернет-представництва Національного банку України.

III. Прикінцеві положення

13. Якщо після часу, визначеного в пункті 3 цього Порядку, Національному банку через відповідні канали обміну інформацією ТІС надаватиметься додаткова/відкоригована інформація за угодами попереднього робочого дня, то індекс UIR перерахуванню не підлягає.

14. Будь-які зміни до умов та порядку розрахунку індексу UIR набувають чинності не раніше, ніж через тиждень після їх оприлюднення на сторінках Офіційного інтернет-представництва Національного банку України.