

Порядок розрахунку і оприлюднення похідних показників
Українського індексу міжбанківських ставок овернайт (UONIA)

I. Загальні положення

1. Національний банк України (далі – Національний банк) здійснює розрахунок похідних показників Українського індексу міжбанківських ставок овернайт UONIA (далі – UONIA) на підставі фактичних значень UONIA, які розраховуються й оприлюднюються в порядку, визначеному окремим розпорядчим актом Національного банку.

2. Національний банк здійснює розрахунок та оприлюднення похідних показників UONIA в довідкових цілях. Національний банк та учасники ринку можуть використовувати похідні показники UONIA для визначення ставок за фінансовими інструментами та контрактами, де передбачено нарахування складних відсотків, однак не мають жодних зобов'язань цього робити.

3. Національний банк здійснює розрахунок та оприлюднення таких похідних показників UONIA:

кумулятивний індекс UONIA (назва англійською мовою – UONIA Compounded Index), який відображає щоденну наростаючу зміну вартості умовного фінансового інструменту, за яким нараховуються складні відсотки на певну початкову суму, починаючи з першого дня визначення UONIA;

кумулятивні середні ставки UONIA (назва англійською мовою – UONIA Compounded Average Rates), які відображають середнє значення UONIA для визначених розрахункових періодів.

II. Розрахунок кумулятивного індексу UONIA

4. Розрахунок кумулятивного індексу UONIA здійснюється кожного робочого дня на підставі щоденних значень UONIA за формулою, наведеною в додатку 1 до цього Порядку.

5. Розрахунок кумулятивного індексу UONIA здійснюється з точністю до восьми знаків після коми.

Округлення розрахованих значень кумулятивного індексу UONIA здійснюється за такими правилами:

якщо дев'ятий знак після коми є цифрою від 0 до 4, то восьмий знак після коми залишається без змін;

якщо дев'ятий знак після коми є цифрою від 5 до 9, то восьмий знак після коми збільшується на одиницю.

III. Розрахунок кумулятивних середніх ставок UONIA

6. Розрахунок кумулятивних середніх ставок UONIA здійснюється кожного робочого дня на підставі щоденних значень UONIA за відповідний попередній період за формулою, наведеною в додатку 2 до цього Порядку.

7. Розрахунок кумулятивних середніх ставок UONIA здійснюється з точністю до п'яти знаків після коми.

Округлення розрахованих значень кумулятивних середніх ставок UONIA здійснюється за такими правилами:

якщо шостий знак після коми є цифрою від 0 до 4, то п'ятий знак після коми залишається без змін;

якщо шостий знак після коми є цифрою від 5 до 9, то п'ятий знак після коми збільшується на одиницю.

8. Розрахунок кумулятивних середніх ставок UONIA здійснюється за такі розрахункові періоди: один місяць, три місяці, шість місяців.

Розрахунок кумулятивних середніх ставок UONIA за будь-який період, відмінний від періодів, за які Національний банк здійснює розрахунок та оприлюднення кумулятивних середніх ставок UONIA, за потреби може бути здійснений зацікавленими особами самостійно за формулою, наведеною в додатку 3 до цього Порядку.

9. Початковим днем розрахункового періоду один місяць є відповідний календарний день попереднього місяця з урахуванням особливостей, визначених у пункті 10 розділу III цього Порядку.

Початковим днем розрахункового періоду три місяці/шість місяців є відповідний календарний день місяця, який визначається шляхом віднімання від поточного місяця трьох/шести календарних місяців відповідно, що йдуть поспіль, з урахуванням особливостей, визначених у пункті 10 розділу III цього Порядку.

10. День початку розрахункового періоду, визначений відповідно до пункту 9 розділу III цього Порядку, підлягає перенесенню, якщо він припадає на неробочий день. Таке перенесення здійснюється на:

робочий день, який передував такому неробочому дню, – якщо обидва зазначених дня належать до одного календарного місяця;

наступний робочий день, що слідує за таким неробочим днем, – в іншому випадку.

IV. Оприлюднення похідних показників UONIA

11. Оприлюднення похідних показників UONIA здійснюється до 10.00 кожного робочого дня в розділі “Фінансові ринки” офіційного Інтернет-представництва Національного банку.

12. Національний банк публікує на сторінках офіційного Інтернет-представництва Національного банку повний архів значень похідних показників UONIA починаючи з дати запровадження розрахунку UONIA, а також розпорядчі акти Національного банку, відповідно до яких здійснювалися розрахунки похідних показників UONIA.

13. Національний банк під час оприлюднення значень кумулятивних середніх ставок UONIA зазначає день початку та день закінчення відповідних розрахункових періодів.

14. Опубліковані значення похідних показників UONIA не підлягають перегляду в разі внесення змін до порядку їх розрахунку.

Додаток 1
до Порядку розрахунку і
оприлюднення похідних
показників UONIA
(пункт 4 розділу II)

Формула розрахунку кумулятивного індексу UONIA

$$\text{Кумулятивний індекс } UONIA_i = \begin{cases} 100, & \text{якщо } i = 0, \\ 100 \times \prod_{t=1}^i \left(1 + \frac{r_{t-1} \times n_{t-1}}{365 \cdot 100} \right), & \text{якщо } i > 0, \end{cases}$$

де i – порядковий номер робочого дня, в який здійснюється розрахунок кумулятивного індексу UONIA;

r_{t-1} – ставка UONIA, розрахована за даними робочого дня $t-1$;

n_{t-1} – кількість календарних днів між робочим днем $t-1$ та наступним робочим днем.

$i = 0$ – відповідає першій даті, за яку було здійснено розрахунок UONIA (22.06.2020).

Початкове значення кумулятивного індексу UONIA за день 22.06.2020 становить 100,00000000.

Додаток 2
до Порядку розрахунку і
оприлюднення похідних
показників UONIA
(пункт 6 розділу III)

Формула розрахунку кумулятивної середньої ставки UONIA

Кумулятивна середня ставка UONIA за період =

$$= \left[\prod_{i=1}^{d_b} \left(1 + \frac{r_i \times n_i}{365 \cdot 100} \right) - 1 \right] \times \frac{365 \cdot 100}{d_c},$$

- де i – порядковий номер робочого дня розрахункового періоду;
 d_b – кількість робочих днів у розрахунковому періоді (день здійснення розрахунку не включається);
 r_i – значення UONIA, розраховане за даними робочого дня i ;
 n_i – кількість календарних днів між робочим днем i та наступним робочим днем, визначена таким чином, щоб сума n_i для i від 1 до d_b дорівнювала d_c ;
 d_c – кількість календарних днів у розрахунковому періоді (день розрахунку не включається).

Додаток 3
до Порядку розрахунку і
оприлюднення похідних
показників UONIA
(пункт 8 розділу III)

Формула розрахунку кумулятивної середньої ставки UONIA
за період між датами x і y

Кумулятивна середня ставка UONIA за період між датами x і y =

$$= \left(\frac{\text{Кумулятивний індекс } UONIA_y}{\text{Кумулятивний індекс } UONIA_x} - 1 \right) \times \frac{365}{d_c},$$

де x – день початку розрахункового періоду;

y – день закінчення розрахункового періоду;

d_c – кількість календарних днів у розрахунковому періоді (день розрахунку не включається).