

Витяг з Постанови Правління Національного банку України від 19 липня 2018 року № 80 «Про деякі питання встановлення офіційного курсу гривні до іноземних валют та внесення змін до Класифікатора іноземних валют та банківських металів»

Порядок розрахунку та оприлюднення офіційного курсу гривні до іноземних валют та курсу банківських металів (далі – Порядок)

1. Офіційний курс гривні до іноземних валют та банківських металів устанавлюється відповідно до Положення про встановлення офіційного курсу гривні до іноземних валют та курсу банківських металів і розрахунку довідкового значення курсу гривні до долара, затвердженим постановою Правління Національного банку України від 19 липня 2018 року № 80 (далі – Положення):

1) щоденно – для конвертованих валют, які широко використовуються для здійснення платежів за міжнародними операціями, валют країн – членів Європейського Союзу [1 група Класифікатора іноземних валют та банківських металів, затвердженого постановою Правління Національного банку України від 04 лютого 1998 року № 34 (у редакції постанови Правління Національного банку України від 19 квітня 2016 року № 269) (зі змінами)], для іноземних валют інших країн, які є головними зовнішньоторговельними партнерами України (додатки 1, 2 Положення), і для банківських металів (додаток 4 Положення);

2) один раз на місяць – для інших іноземних валют (додаток 3 Положення);

3) один раз на місяць – уточнений для спеціальних прав запозичення.

2. Офіційний курс гривні до іноземних валют та банківських металів, розраховується:

1) до долара США – відповідно до Розрахунку офіційного курсу гривні до долара США і довідкового значення курсу гривні до долара США або Розрахунку офіційного курсу гривні до долара США за особливих умов.

Визначення офіційного курсу гривні до долара США за особливих умов застосовується, якщо кількість угод з купівлі/продажу долара США на умовах “тод”, “том” і “спот”, які в день розрахунку офіційного курсу уклалися банками на міжбанківському валютному ринку України (далі – МВРУ) з іншими банками та з Національним банком, та інформація про які надавалася Національному банку торговельно-інформаційними системами (далі – ТІС) через відповідні канали обміну інформацією до 12.00 цього самого дня, є менше або дорівнює 10% від середньоденного значення аналогічного показника за попередній плинний місяць;

2) до таких валют: австралійський долар, бат, болгарський лев, вона, гонконгівський долар, данська крона, злотий, євро, єна, індійська рупія, канадський долар, куна, малайзійський ринггіт, мексиканське песо, новий

ізраїльський шекель, новозеландський долар, норвезька крона, ренд, румунський лей, рупія, сингапурський долар, турецька ліра, форинт, фунт стерлінгів, чеська крона, шведська крона, швейцарський франк, юань Женьміньбі – на підставі інформації про курс гривні до долара США, установлений згідно з підпунктом 1 пункту 2 цього Порядку, та про щоденні довідкові курси валют до євро, які оприлюднені Європейським центральним банком;

3) до таких валют: азербайджанський манат, білоруський рубль, вірменський драм, єгипетський фунт, іранський ріал, ларі, молдовський лей, російський рубль, саудівський ріал, сом, сомоні, тенге, туркменський новий манат, узбецький сум – на підставі інформації про курс гривні до долара США, установлений згідно з підпунктом 1 пункту 2 цього Порядку, та про курси національних валют до долара США, установлені відповідними центральними (національними) банками держав;

4) до таких валют: алжирський динар, ганське седі, дирхам ОАЕ, донг, іракський динар, ліванський фунт, лівійський динар, марокканський дирхам, новий тайванський долар, пакистанська рупія, сербський динар, така, туніський динар – на підставі інформації про курс гривні до долара США, установлений згідно з підпунктом 1 пункту 2 цього Порядку, та про поточні курси відповідних валют до долара США на міжнародних валютних ринках, які отримуються через ТІС;

5) до СПЗ – на підставі інформації про курс гривні до долара США, установлений згідно з підпунктом 1 пункту 4 цього Положення, та про курс СПЗ до долара США, установлений Міжнародним валютним фондом (далі – МВФ);

6) до таких банківських металів: золота, срібла, платини та паладію – на підставі інформації про курс гривні до долара США, установлений згідно з підпунктом 1 пункту 2 цього Порядку, та інформації про ціни на дорогоцінні метали Лондонської асоціації учасників ринку дорогоцінних металів (LBMA).

Інформація про ціну золота, срібла, платини та паладію для визначення офіційних курсів цих банківських металів отримується із офіційного Інтернет-представництва Лондонської асоціації учасників ринку дорогоцінних металів (LBMA) та ТІС.

3. Інформація про встановлений офіційний курс гривні до іноземних валют та курс банківських металів оприлюднюється на сторінці офіційного Інтернет-представництва Національного банку та надсилається абонентам системи електронної пошти Національного банку.

Інформація про встановлений офіційний курс гривні до долара США оприлюднюється до 16.00.

Інформація про встановлений офіційний курс гривні до інших іноземних валют та банківських металів (додатки 2 – 4 Положення) оприлюднюється до 18.00.

4. Національний банк розраховує та оприлюднює на сторінці офіційного Інтернет-представництва Національного банку довідкове значення курсу гривні до долара США згідно з укладеними на МВРУ угодами станом на 12.00 (далі – довідкове значення курсу гривні до долара США) з метою надання суб'єктам ринку оперативного індикатора курсу гривні до долара США.

Суб'єкти ринку та Національний банк не мають жодних зобов'язань щодо укладання угод за відповідними параметрами.

5. Розрахунок довідкового значення курсу гривні до долара США здійснюється кожного робочого дня відповідно до Розрахунку офіційного курсу гривні до долара США і довідкового значення курсу гривні до долара США.

Оприлюднення довідкового значення курсу гривні до долара США здійснюється в день його розрахунку до 12.30 на сторінці офіційного Інтернет-представництва Національного банку.

Розрахунок довідкового значення курсу гривні до долара США не здійснюється, якщо кількість угод з купівлі/продажу долара США на умовах “тод”, “том” і “спот”, які в день розрахунку офіційного курсу уклалися банками на МВРУ з іншими банками та з Національним банком, та інформація про які надавалася Національному банку ТІС через відповідні канали обміну інформацією до 12.00 цього самого дня, є менше або дорівнює 10% від середньоденного значення аналогічного показника за попередній плинний місяць. В інформації, яка підлягає оприлюдненню на сторінці офіційного Інтернет-представництва Національного банку, у відповідній позиції зазначається символ “-”.

Розрахунок офіційного курсу гривні до долара США і довідкового значення курсу гривні до долара США

1. Для розрахунку офіційного курсу гривні до долара США і довідкового значення курсу гривні до долара США (далі – Розрахунок) ураховується інформація про всі угоди з купівлі/продажу доларів США на умовах “тод”, “том” і “спот”, які в день розрахунку офіційного курсу уклалися банками на міжбанківському валютному ринку України з іншими банками та з Національним банком України (далі – Національний банк), та інформація про які надавалася Національному банку торговельно-інформаційними системами через відповідні канали обміну інформацією:

1) до 12.00 – для розрахунку довідкового значення курсу гривні до долара США;

2) до 15.30 – для розрахунку офіційного курсу гривні до долара США.

2. Розрахунок здійснюється в такому порядку:

1) із наявного ряду угод, визначеного відповідно до пункту 1 Розрахунку, вилучаються угоди, курси яких більше ніж на два відсотки ($\pm 2\%$) відрізняються від середньоарифметичного значення курсу ряду угод;

2) із ряду угод, отриманого після виконання підпункту 1 пункту 2 Розрахунку, розраховується стандартне відхилення курсу за такою формулою:

$$\sigma_k = \sqrt{\frac{\sum_{i=1}^n (x_{ki} - \bar{X}_k)^2}{n}},$$

де σ_k – стандартне відхилення курсу;

X_{ki} – значення курсу i -ї угоди;

\bar{X}_k – середньоарифметичне значення ряду курсів;

n – кількість угод;

3) із ряду угод, отриманого після виконання підпункту 1 пункту 2 Розрахунку, розраховується стандартне відхилення обсягу за такою формулою:

$$\sigma_o = \sqrt{\frac{\sum_{i=1}^n (x_{oi} - \bar{X}_o)^2}{n}},$$

де σ_o – стандартне відхилення обсягу;

X_{oi} – значення обсягу i -ї угоди;

\bar{X}_o – середньоарифметичне значення ряду обсягів;

n – кількість угод;

4) із ряду угод, отриманого після виконання пункту 1 Розрахунку, виключаються:

угоди, курси яких відхиляються від середньоарифметичного значення курсу \bar{X}_k більше ніж на два стандартних відхилення курсу σ_k ;

угоди, обсяги яких відхиляються від середньоарифметичного значення обсягу угод \bar{X}_o більше ніж на два стандартних відхилення обсягу σ_o ;

5) отриманий після виконання підпункту 4 пункту 2 Розрахунку ряд угод вважається базовим рядом для розрахунку офіційного курсу гривні до долара США і довідкового значення курсу гривні до долара США.

Значення офіційного курсу гривні до долара США і довідкового курсу гривні до долара США розраховується як середньозважене значення курсу базового ряду за такою формулою:

$$\bar{K} = \frac{\sum_{i=1}^n (K_i \times O_i)}{\sum_{i=1}^n O_i},$$

де \bar{K} – середньозважене значення курсу;

O_i – значення обсягу i -ї угоди;

K_i – значення курсу i -ї угоди;

n – кількість угод.

Розрахунок офіційного курсу гривні до долара США за особливих умов

1. Розрахунок офіційного курсу гривні до долара США за особливих умов (далі – Розрахунок за особливих умов) застосовується, якщо кількість угод з купівлі/продажу долара США на умовах “тод”, “том” і “спот”, які в день розрахунку офіційного курсу уклалися банками на МВРУ з іншими банками та з Національним банком, та інформація про які надавалася Національному банку ТІС через відповідні канали обміну інформацією до 12.00, є менше або дорівнює 10% від середньоденного значення аналогічного показника за попередній плинний місяць.

2. Національний банк з 12.00 до 13.00 надсилає запит на банки, які укладають угоди на МВРУ, щодо отримання котирувань з купівлі/продажу 1 млн. дол. США через функціонали ТІС у разі виникнення підстав для застосування розрахунку офіційного курсу гривні до долара США, визначених у пункті 1 Розрахунку за особливих умов. Запит здійснюється на 20 банків, що входять до визначеного відповідно до нормативно-правових актів Національного банку переліку банків, які можуть стати учасниками інтервенції за найкращим курсом, яка проводиться шляхом запиту щодо ціни на купівлю/продаж іноземної валюти в суб'єктів ринку (далі – Перелік).

3. Національний банк здійснює запит, аналогічний запиту відповідно до пункту 2 Розрахунку за особливих умов, засобами телефонного зв'язку на 10 банків з Переліку, якщо за результатами запиту відповідь з наданням курсових котирувань з купівлі та/або продажу долара США отримана менше ніж від 5 банків, або якщо жодна з ТІС з будь-яких причин не працює. Запит здійснюється на перші 10 банків з Переліку, якщо день здійснення такого запиту припадає на парне число, а якщо на непарне – на інші 10 банків з Переліку.

4. Національний банк, якщо відповіді з наданням курсових котирувань з купівлі та/або продажу долара США після пунктів 2 або 3 Розрахунку за особливих умов отримуватимуться не менше ніж від 5 банків, може використовувати отримані котирування для розрахунку офіційного курсу гривні до долара США відповідно до пункту 5 Розрахунку за особливих умов.

5. Офіційний курс гривні до долара США розраховується:

1) відповідно до Розрахунку офіційного курсу гривні до долара США і довідкового значення курсу гривні до долара США (додаток 5 до Положення про встановлення офіційного курсу гривні до іноземних валют та курсу банківських металів і розрахунку довідкового значення курсу гривні до долара США) – якщо кількість угод з купівлі/продажу долара США на умовах “тод”, “том” і “спот”, які в день розрахунку офіційного курсу уклалися банками на МВРУ з іншими банками та з Національним банком, та інформація про які надавалася

Національному банку ТІС через відповідні канали обміну інформацією до 15.30 цього самого дня, є більше ніж 10% від середньоденного значення аналогічного показника за попередній плинний місяць;

2) як звичайне середньоарифметичне значення всіх курсових котирувань з купівлі та/або продажу доларів США, отриманих відповідно до пункту 2 або пункту 3 Розрахунку за особливих умов, – якщо кількість угод з купівлі/продажу долара США на умовах “тод”, “том” і “спот”, які в день розрахунку офіційного курсу уклалися банками на МВРУ з іншими банками та з Національним банком, та інформація про які надавалася Національному банку ТІС через відповідні канали обміну інформацією до 15.30 цього самого дня, є менше або дорівнює 10% від середньоденного значення аналогічного показника за попередній плинний місяць та за дотриманням умови, що викладена в пункті 4 Розрахунку за особливих умов;

3) як значення, яке дорівнює офіційному курсу гривні до долара США, що діє на день здійснення розрахунку, – якщо не виконується жодна з умов для розрахунку, передбачена підпунктами 1 та 2 пункту 5 Розрахунку за особливих умов .