



Правління Національного банку України
ПОСТАНОВА

03 грудня 2015 року

м. Київ

№ 860

Про розрахунок та оприлюднення
Українського індексу міжбанківських ставок

*(зі змінами, унесеними рішеннями Правління
Національного банку України
від 19.07.2018 № 466-рш,
від 14.05.2020 № 330-рш)*

На виконання підпункту VI пункту А. 15 Комплексної програми розвитку фінансового сектору України до 2020 року, затвердженої постановою Правління Національного банку України від 18 червня 2015 року № 391, відповідно до протоколу засідання Комітету з управління активами та пасивами Національного банку України від 26 листопада 2015 року №16 Правління Національного банку України **постановляє:**

1. Затвердити Порядок розрахунку та оприлюднення Українського індексу міжбанківських ставок, що додається.

2. Департаменту відкритих ринків (Пономаренко С. В.) започаткувати розрахунок та оприлюднення Українського індексу міжбанківських ставок на сторінці Офіційного інтернет-представництва Національного банку України з 28 грудня 2015 року.

3. Департаменту інформаційних технологій (Нагорнюк В.В.) доопрацювати відповідні програмні комплекси в частині автоматизації процесу розрахунку показників Українського індексу міжбанківських ставок.

4. Контроль за виконанням цієї постанови покласти на заступника Голови Національного банку України Чурія О. Є.

Голова

В. О. Гонтарева

ЗАТВЕРДЖЕНО
Постанова Правління
Національного банку України
03 грудня 2015 року № 860

Порядок розрахунку та оприлюднення
Українського індексу міжбанківських ставок

*(зі змінами, унесеними рішеннями Правління
Національного банку України
від 19.07.2018 № 466-рш,
від 14.05.2020 № 330-рш)*

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.

*(пункт 3 розділу I у редакції рішення
Правління Національного банку України
від 19.07.2018 № 466-рш)*

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 UPR включаються усі укладені за допомогою функціоналів ТІС операції з купівлі доларів США за гривні на умовах “своп”.

*(пункт 4 розділу I у редакції рішення
Правління Національного банку України
від 19.07.2018 № 466-рш)*

5. За кожною категорією, визначеною у пункті 4, розрахунок та оприлюднення індексу UPR 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 UPR здійснюється в відсотках річних з точністю до чотирьох знаків після коми.

6¹. Національний банк України здійснює оверсайт індексу UPR. Оверсайт індексу UPR – діяльність Національного банку України із забезпечення безперервного, надійного та ефективного розрахунку та оприлюднення індексу UPR. Така діяльність включає моніторинг, аналіз та ухвалення рішень щодо будь-яких питань, пов'язаних із розрахунком та оприлюдненням індексу UPR.

З метою опрацювання питань та підготовки пропозицій та/або рішень, пов'язаних із здійсненням оверсайта індексу UIIR, Правління Національного банку України створює Комітет оверсайта Українського індексу міжбанківських ставок (UIIR).

*(розділ I доповнено підпунктом б'
згідно з рішенням Правління
Національного банку України
від 14.05.2020 № 330-рш)*

II. Умови та порядок розрахунку, оприлюднення індексу UIIR

7. Пункт 7 розділу II виключено

*(згідно з рішенням Правління
Національного банку України
від 19.07.2018 № 466-рш)*

8. Розрахунок індексу UIIR 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 UIIR для відповідного строку та категорії не здійснюється, а в інформації, яка підлягає оприлюдненню, у відповідній позиції зазначається символ “-”.

*(пункт 8 розділу II зі змінами згідно з рішенням
Правління Національного банку України
від 19.07.2018 № 466-рш)*

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

*(пункт 9 розділу II зі змінами згідно з рішенням
Правління Національного банку України
від 19.07.2018 № 466-рш)*

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

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

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.

*(пункт 10 розділу II у редакції рішення
Правління Національного банку України
від 19.07.2018 № 466-рш)*

11. Розрахунок індексу UIPR 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 \bar{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 UPR;

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

*(пункт 11 розділу II у редакції рішення
Правління Національного банку України
від 19.07.2018 № 466-рш)*

12. Оприлюднення індексу UPR 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 UPR перерахуванню не підлягає.

*(пункт 13 розділу II у редакції рішення
Правління Національного банку України
від 19.07.2018 № 466-рш)*

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

Директор Департаменту
відкритих ринків

С. В. Пономаренко

ПОГОДЖЕНО
Заступник Голови
Національного банку України
_____ О. Є. Чурій
“ ___ ” _____ 2015 року