

Положення
про встановлення офіційного курсу гривні до іноземних валют
та розрахунку довідкового значення курсу гривні до долара США й облікової
ціни банківських металів

*(зі змінами, унесеними постановами Правління Національного банку України
[від 01 червня 2020 року № 70](#))*

I. Загальні положення

1. Це Положення розроблено відповідно до статей 7, 15 та 36 Закону України “Про Національний банк України” і регламентує питання встановлення і використання Національним банком України (далі – Національний банк) офіційного курсу гривні до іноземних валют та розрахунку довідкового значення курсу гривні до долара США й облікової ціни банківських металів.

2. Для цілей цього Положення термін “котирування BFIX” розуміється як значення середньозважених курсових/цінових котирувань BGN (Bloomberg Generic Price) іноземних валют/банківських металів на ринку спот до долара США (або долара США до іноземних валют/банківських металів), які щоденно розраховуються торговельно-інформаційною системою BLOOMBERG (далі - TIC BLOOMBERG) станом на 15.30 за київським часом і інформація про які надходить до Національного банку від TIC BLOOMBERG із використанням спеціальних рішень передавання даних.

3. Національний банк:

1) установлює офіційний курс гривні до іноземних валют та міжнародної рахункової грошової одиниці (далі – офіційний курс гривні до іноземних валют) з періодичністю відповідно до переліків іноземних валют, визначених відповідно до підпунктів 1, 2 пункту 5 розділу II цього Положення;

2) розраховує облікову ціну банківських металів з періодичністю відповідно до переліку банківських металів, визначеного відповідно до підпункту 3 пункту 5 розділу II цього Положення;

3) встановлює уточнений офіційний курс гривні до спеціальних прав запозичення (далі – СПЗ) – один раз на місяць (другого робочого дня місяця, станом на останній робочий день попереднього місяця).

4. Національний банк не має жодних зобов'язань зі здійснення операцій з купівлі-продажу іноземної валюти за їх офіційним курсом та з купівлі-продажу банківських металів за їх обліковою ціною.

II. Порядок затвердження та оприлюднення переліків іноземних валют, до яких Національний банк встановлює офіційний курс гривні, та банківських металів, до яких Національний банк розраховує облікову ціну

5. Національний банк щорічно впродовж двох тижнів після дати оприлюднення на сторінці офіційного Інтернет-представництва Національного банку Платіжного балансу України за попередній рік затверджує та оприлюднює на сторінці офіційного Інтернет-представництва Національного банку:

1) перелік іноземних валют, до яких Національний банк щоденно встановлює офіційний курс гривні. До цього переліку включаються іноземні валюти, що входять до 1 групи 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) (далі – Класифікатор), та іноземні валюти, емітентами яких є країни, які за даними Платіжного балансу України за рік, що передує встановленню цього переліку, входять до 30 країн із найбільшим обсягом товарообігу з Україною;

2) перелік іноземних валют, до яких Національний банк один раз на місяць встановлює офіційний курс гривні. До цього переліку включаються іноземні валюти (з тих, що не увійшли до переліку іноземних валют, зазначеного в підпункті 1 пункту 5 розділу II цього Положення), емітентами яких є країни, що утворилися внаслідок припинення існування СРСР, а також країни, які за даними Платіжного балансу України за рік, що передує встановленню цього переліку, посідають місця з 31 до 60 за обсягом товарообігу з Україною;

3) перелік банківських металів, до яких Національний банк щоденно розраховує облікову ціну. До цього переліку включаються банківські метали, що входять до 1 групи Класифікатора.

6. Переліки, зазначені в підпунктах 1–3 пункту 5 розділу II цього Положення, є чинними до моменту оприлюднення Національним банком нових переліків.

III. Порядок розрахунку, оприлюднення, дії та використання офіційного курсу гривні до іноземних валют та облікової ціни банківських металів

7. Офіційний курс гривні до іноземних валют, зазначених у підпунктах 1, 3 пункту 3 розділу I цього Положення, розраховується:

1) до долара США – відповідно до розрахунку офіційного курсу гривні до долара США і довідкового значення курсу гривні до долара США (додаток 1) або розрахунку офіційного курсу гривні до долара США за особливих умов (додаток 2).

Розрахунок 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 валютному ринку України 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;

унаслідок події операційного ризику на етапах отримання та/або обробки інформації з ТІС про угоди, визначені в абзаці третьому підпункту 1 пункту 7 розділу III цього Положення, кількість угод, інформація про які є доступною, станом на 12.00 є меншою або дорівнює 10% від середньоденного значення аналогічного показника за попередній плинний місяць.

Національний банк з 12.15 до 13.00 надсилає запит на банки, які укладають угоди на валютному ринку України, 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 в абзацах другому – четвертому підпункту 1 пункту 7 розділу III цього Положення. 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).

Національний банк здійснює запит, аналогічний запиту відповідно до абзацу п'ятого підпункту 1 пункту 7 розділу III цього Положення, засобами

телефонного зв'язку на 10 банків з Переліку, якщо за результатами попереднього 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.

Національний банк, якщо відповіді з наданням курсових котирувань з купівлі та/або продажу долара США після запитів, відправлених відповідно до абзаців п'ятого та шостого підпункту 1 пункту 7 розділу III цього Положення, отримані не менше ніж від 5 банків, має право використовувати отримані котирування для розрахунку офіційного курсу гривні до долара США відповідно до розрахунку офіційного курсу гривні до долара США за особливих умов (додаток 2);

2) до іноземних валют (крім долара США та СПЗ):

на підставі інформації про курс гривні до долара США, розрахований згідно з підпунктом 1 пункту 7 розділу III цього Положення, та про котирування BFIX іноземних валют – для валют, за якими в день розрахунку офіційного курсу гривні ТІС BLOOMBERG оприлюднила котирування BFIX;

на підставі інформації про курс гривні до долара США, розрахований згідно з підпунктом 1 пункту 7 розділу III цього Положення, та останньої наявної на момент розрахунку офіційного курсу гривні інформації про курси іноземних валют до долара США (або долара США до іноземних валют), установлені відповідними центральними (національними) банками – емітентами валюти, або про поточні курси іноземних валют до долара США (або долара США до іноземних валют) на міжнародних валютних ринках, які отримуються через ТІС, – для валют, за якими в день розрахунку офіційного курсу гривні ТІС BLOOMBERG не розрахував котирування BFIX або якщо інформація про такі котирування на момент розрахунку офіційного курсу гривні внаслідок події операційного ризику на етапах отримання та/або обробки інформації з ТІС BLOOMBERG не була доступна для використання;

3) до СПЗ (щоденний) – на підставі інформації про курс гривні до долара США, розрахований згідно з підпунктом 1 пункту 7 розділу III цього Положення, та розрахункового значення курсу СПЗ до долара США, яке обраховується із застосуванням підходів, наведених на сторінці “SDR Valuation” офіційного Інтернет-представництва Міжнародного валютного фонду (далі – МВФ), з використанням котирувань BFIX валют як значень обмінних курсів валют, які входять до кошика СПЗ.

Якщо для валюти, що входить до кошика СПЗ, у день розрахунку офіційного курсу гривні ТІС BLOOMBERG не оприлюднила котирування BFIX, або якщо інформація про таке котирування на момент розрахунку офіційного

курсу гривні внаслідок події операційного ризику на етапах отримання та/або обробки інформації з TIC BLOOMBERG не була доступною для використання, для обрахунку розрахункового значення курсу СПЗ до долара США використовується остання наявна на момент розрахунку офіційного курсу гривні інформація про курс такої валюти до долара США (або долара США до такої валюти), установлений центральним (національним) банком-емітентом цієї валюти;

4) до СПЗ (уточнений) – другого робочого дня місяця на підставі інформації про курс гривні до долара США на останній робочий день попереднього місяця, розрахований згідно з підпунктом 1 пункту 7 розділу III цього Положення, та інформації про курс СПЗ до долара США, який встановлений МВФ на його останній робочий день попереднього місяця.

8. Облікова ціна банківських металів, зазначена в підпункті 2 пункту 3 розділу I цього Положення, розраховується:

1) на підставі інформації про курс гривні до долара США, розрахований згідно з підпунктом 1 пункту 7 розділу III цього Положення, та про цінові котирування BFIX долара США до банківських металів – для банківських металів, за якими в день розрахунку офіційного курсу гривні TIC BLOOMBERG оприлюднила цінові котирування BFIX долара США до банківських металів;

2) на підставі інформації про курс гривні до долара США, розрахований згідно з підпунктом 1 пункту 7 розділу III цього Положення, та інформації про останню наявну ціну банківських металів, отриманої з офіційного Інтернет-представництва Лондонської асоціації учасників ринку дорогоцінних металів (LBMA) або TIC – для банківських металів, за якими в день розрахунку облікової ціни TIC BLOOMBERG не оприлюднила цінові котирування BFIX долара США до банківських металів або якщо інформація про такі котирування на момент розрахунку облікової ціни внаслідок події операційного ризику на етапах отримання та/або обробки інформації з TIC BLOOMBERG не була доступна для використання.

9. Числове значення офіційного курсу гривні до долара США визначається як сума гривень за 1 одиницю іноземної валюти, до інших іноземних валют, крім долара США, та облікової ціни банківських металів – відповідно до переліків іноземних валют та банківських металів, зазначених у пункті 5 розділу II цього Положення.

Офіційний курс гривні до іноземних валют установлюється з точністю до чотирьох десяткових знаків, крім уточненого офіційного курсу гривні до СПЗ,

який установлюється з точністю до шести десяткових знаків. Облікова ціна банківських металів розраховується з точністю до двох десяткових знаків.

(пункт 9 розділу III у редакції постанови Правління Національного банку України від 01.06.2020 № 70)

10. Офіційний курс гривні до іноземних валют та облікова ціна банківських металів, зазначені в підпунктах 1 та 3 пункту 5 розділу II цього Положення, починають діяти наступного робочого дня після дня встановлення та/або розрахунку.

Офіційний курс гривні до іноземних валют та облікова ціна банківських металів, установлений/розрахована:

1) на останній робочий день тижня або на передсвятковий день, діють протягом наступних вихідних або святкових днів;

2) в останній робочий день тижня або в передсвятковий день, починають діяти в перший робочий день наступного тижня або в перший післясвятковий робочий день.

Офіційний курс гривні до іноземних валют, зазначених у підпункті 2 пункту 5 розділу II цього Положення, установлюється в останній робочий день місяця та починає діяти з першого числа наступного календарного місяця і діє до кінця цього місяця.

11. Національний банк має право встановлювати офіційний курс гривні до іноземних валют та розраховувати облікову ціну банківських металів на визначену дату на рівні попереднього робочого дня в разі перенесення робочих днів.

12. Офіційний курс гривні до іноземних валют та облікова ціна банківських металів використовуються резидентами та нерезидентами України:

1) для відображення в бухгалтерському обліку операцій з іноземною валютою та банківськими металами;

2) для проведення валютних операцій, що здійснюються Національним банком з Державною казначейською службою України;

3) в інших випадках, визначених законодавством України.

Уточнений офіційний курс гривні до СПЗ, що зазначений у підпункті 4 пункту 7 розділу III цього Положення, використовується для складання місячного балансу та іншої бухгалтерської та статистичної звітності Національного банку.

13. Інформація про встановлений офіційний курс гривні до іноземних валют та розраховану облікову ціну банківських металів оприлюднюється на сторінці офіційного Інтернет-представництва Національного банку не пізніше 16.00 у день встановлення/розрахунку та надсилається абонентам системи електронної пошти Національного банку.

Національний банк, якщо офіційний курс гривні до долара США був розрахований з використанням розрахунку офіційного курсу гривні до долара США за особливих умов (додаток 2), повідомляє про це на сторінці офіційного Інтернет-представництва Національного банку одночасно з оприлюдненням інформації про встановлений офіційний курс гривні до іноземних валют та розраховану облікову ціну банківських металів.

IV. Порядок розрахунку та оприлюднення довідкового значення курсу гривні до долара США

14. Національний банк розраховує та оприлюднює на сторінці офіційного Інтернет-представництва Національного банку довідкове значення курсу гривні до долара США згідно з укладеними на валютному ринку України 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.

Національний банк не має жодних зобов'язань щодо укладання угод за довідковим значенням курсу гривні до долара США.

15. 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 (додаток 1).

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

16. Розрахунок довідкового значення курсу гривні до долара США не здійснюється, якщо:

1) кількість угод з купівлі/продажу долара США на умовах “тод”, “том” і “спот”, які в день розрахунку офіційного курсу уклалися банками на валютному ринку України 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;

2) унаслідок події операційного ризику на етапах отримання та/або обробки інформації з ТІС про угоди, визначені в підпункті 1 пункту 15 розділу ІV цього Положення, кількість угод, інформація про які є доступною, станом на 12.00 є меншою 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 “_”.

Додаток 1
до Положення про встановлення
офіційного курсу гривні до іноземних
валют та розрахунку довідкового
значення курсу гривні до долара США
й облікової ціни банківських металів
(підпункт 1 пункту 7 розділу III)

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 валютному ринку України з іншими банками та з Національним банком, та інформація про які надавалася Національному банку ТІС 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, виключаються угоди, курси яких більше ніж на 2 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{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.

Додаток 2
до Положення про встановлення
офіційного курсу гривні до іноземних
валют та розрахунку довідкового значення
курсу гривні до долара США
й облікової ціни банківських металів
(підпункт 1 пункту 7 розділу III)

Розрахунок офіційного курсу гривні до долара США
за особливих умов

1. Офіційний курс гривні до долара США розраховується:

1) відповідно до розрахунку, наведеного в додатку 1 до Положення про встановлення офіційного курсу гривні до іноземних валют та розрахунку довідкового значення курсу гривні до долара США й облікової ціни банківських металів (далі – Положення), – якщо кількість угод з купівлі/продажу долара США на умовах “тод”, “том” і “спот”, які в день розрахунку офіційного курсу укладалися банками на валютному ринку України 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 абзацу п'ятого або шостого підпункту 1 пункту 7 розділу III Положення, – якщо кількість угод з купівлі/продажу долара США на умовах “тод”, “том” і “спот”, які в день розрахунку офіційного курсу укладалися банками на валютному ринку України 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 абзаці сьомому підпункту 1 пункту 7 розділу III Положення;

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 абзацами другим – п'ятим підпункту 1 пункту 7 розділу III Положення.