

Методика розрахунку поточної ціни цінного папера
(нова редакція)

1. В формулах, наведених в Методиці розрахунку поточної ціни цінного папера (надалі - Методика), використовуються наступні позначення:

P_i - поточна ціна цінного паперу поточного розрахункового періоду (i). При визначенні поточної ціни боргового цінного паперу не враховується накопичений процентний дохід (НКД);

P_u - ціна біржового контракту (договору) u , який враховується при підрахунку поточної ціни, що укладений на Біржі за таким цінним папером протягом розрахункового періоду. Для боргових цінних паперів беруться ціни біржових контрактів без врахування накопиченого процентного доходу (НКД);

N_u - кількість цінних паперів в біржовому контракті (договорі) u , який враховується при підрахунку поточної ціни, що укладений на Біржі за таким цінним папером протягом розрахункового періоду;

$\sum N_u$ - загальна кількість цінних паперів в усіх біржових контрактах (договорах), укладених на Біржі за таким цінним папером протягом розрахункового періоду, які враховуються при підрахунку поточної ціни;

$Plast_{ок}$ - остання поточна ціна, розрахована на підставі біржових контрактів (договорів), поточного торговельного дня або у випадку відсутності укладених протягом поточного торговельного дня біржових контрактів, які враховуються при розрахунку поточної ціни цінного папера, останнє розраховане за останні 12 місяців на підставі біржових контрактів (договорів) значення поточної ціни відповідного цінного папера ;

$P_{maxbid.i}$ - краща (максимальна) ціна на купівлю цінного папера в заявках, що враховуються при визначенні поточної ціни відповідно до пункту 8 цієї Методики, на кінець розрахункового періоду;

$P_{minask.i}$ - краща (мінімальна) ціна на продаж цінного папера в заявках, що враховуються при визначенні поточної ціни відповідно до пункту 8 цієї Методики, на кінець розрахункового періоду;

j - поточний торговельний день;

P_j - ціна закриття поточного торговельного дня, визначається відповідно до пункту 13 цієї Методики;

P_{j_a} - визначена з метою оприлюднення ціна закриття боргового цінного паперу за результатами поточного торговельного дня із врахуванням накопиченого на дату оприлюднення процентного доходу (НКД);

A_j - накопичений на дату оприлюднення процентний дохід (НКД) за борговим цінним папером, грн.

2. Розрахунковим періодом розрахунку поточної ціни цінного паперу виступає 1 (одна) хвилина. Поточна ціна цінного паперу (далі – поточна ціна) розраховується один раз на хвилину.

3. Перший розрахунок поточної ціни (ціни відкриття) здійснюється через 10 хвилин від початку торговельної сесії у режимах торгів, які беруть участь у формуванні поточної ціни цього цінного папера.
4. Поточна ціна (P_i) розраховується як середнє арифметичне зважене цін біржових контрактів (договорів), укладених на Біржі за таким цінним папером протягом розрахункового періоду, з урахуванням вимог пункту 5 цієї Методики.

$$P_i = \sum P_y * N_y / \sum N_y$$

5. При розрахунку поточної ціни цінного папера не враховуються:
 - договори РЕПО,
 - біржові контракти (договори), укладені на підставі адресних заявок,
 - при первинному розміщенні цінних паперів та
 - біржові контракти (договори), укладені на односторонніх аукціонах, а також
 - при проведенні аукціонів з продажу акцій, що належать державі.
6. При визначенні поточної ціни боргових цінних паперів використовується ціна купівлі-продажу боргових цінних паперів, яка виражається у гривнях за один цінний папір (за 1 шт.) з точністю, встановленою окремо і притаманною для даного цінного паперу з урахуванням особливостей його котирування, без врахування накопиченого процентного доходу (НКД).
7. У разі відсутності протягом розрахункового періоду біржових контрактів (договорів), які враховуються при розрахунку поточної ціни цінного папера відповідно до вимог пункту 5 цієї Методики, поточна ціна цінного папера визначається з урахуванням заявок, на підставі яких на момент розрахунку можуть бути укладені такі біржові контракти, відповідно до вимог пунктів 8 - 12 цієї Методики.
8. При визначенні поточної ціни враховуються активні на момент розрахунку заявки, адресовані усім учасникам біржових торгів, за виключенням заявок, на підставі яких можуть бути укладені біржові контракти, що не враховуються при розрахунку поточної ціни цінного папера відповідно до пункту 5 цієї Методики.
9. Якщо на кінець розрахункового періоду краща ціна на купівлю цінного папера в активних заявках, що враховуються при визначенні поточної ціни, вища за останнє розраховане за останні 12 місяців на підставі біржових контрактів (договорів) значення поточної ціни відповідного цінного папера, то поточна ціна цінного папера вважається рівною цій кращій ціні на купівлю:

Якщо $P_{maxbid.i} > Plast_{ок}$,

$$P_i = P_{maxbid.i}$$

10. Якщо на кінець розрахункового періоду краща ціна на продаж цінного папера в активних заявках, що враховуються при визначенні поточної ціни, нижча за останнє розраховане за останні 12 місяців на підставі біржових контрактів (договорів) значення поточної ціни відповідного цінного папера, то поточна ціна цінного папера вважається рівною цій кращій ціні на продаж:

Якщо $P_{minask.i} < Plast_{ок}$,

$$P_i = P_{minask.i}$$

11. Якщо на кінець розрахункового періоду краща ціна на купівлю цінного папера в активних заявках, що враховуються при визначенні поточної ціни, вища за останнє розраховане за останні 12 місяців на підставі біржових контрактів (договорів) значення поточної ціни відповідного цінного папера, а

краща ціна на продаж цінного папера в заявках, що враховуються при визначенні поточної ціни, нижча за останнє розраховане за останні 12 місяців на підставі біржових контрактів (договорів) значення поточної ціни відповідного цінного папера,

то поточна ціна цінного папера вважається рівною кращій ціні на купівлю

$$\text{Якщо виконується умова } P_{maxbid.i} > Plast_{\delta k} \text{ та } Plast_{\delta k} > P_{minask.i}, \\ P_i = P_{maxbid.i}$$

12. В усіх інших випадках поточна ціна цінного папера вважається рівною останній розрахованій відповідно до пункту 4 цієї Методики поточній ціні цього цінного папера:

У випадках:

відсутності укладених біржових контрактів, які враховуються при визначенні поточної ціни,

відсутності поданих заявок, які враховуються при визначенні поточної ціни,

якщо $P_{maxbid.i} \leq Plast_{\delta k}$ та/або $Plast_{\delta k} \leq P_{minask.i}$,

$$P_i = Plast_{\delta k}$$

13. Ціна закриття (P_j) - останнє розраховане на підставі біржових контрактів протягом торговельного дня значення поточної ціни. Якщо протягом поточного торговельного дня не було укладено біржових контрактів, на підставі яких розраховується поточна ціна цінного паперу, ціна закриття (P_j) визначається як останнє значення поточної ціни, розраховане на підставі біржових контрактів, за умови, що з моменту її останнього розрахунку минуло не більше ніж 12 місяців.

Таким чином,

$$P_j = Plast_{\delta k}$$

14. В цілях оприлюднення в загальнодоступній базі даних Національної комісії з цінних паперів та фондового ринку про ринок цінних паперів ціна закриття для боргових цінних паперів визначається з урахуванням вимог другого абзацу пункту 15 цієї Методики (P_{j_a}).

15. Інформація про ціни закриття цінних паперів оприлюднюється в загальнодоступній базі даних Національної комісії з цінних паперів та фондового ринку про ринок цінних паперів з точністю до чотирьох знаків після коми.

В цілях оприлюднення інформації про ціни закриття боргових цінних паперів, які торгуються без врахування накопиченого процентного доходу (НКД), розраховане Біржею значення ціни закриття боргового цінного паперу виражається у гривнях, виходячи з останнього за результатами торговельного дня значення поточної ціни боргового цінного паперу, розрахованого на підставі біржових контрактів, та розміру НКД:

$$P_{j_a} = Plast_{\delta k} + A_j$$

16. При визначенні поточної ціни першого розрахункового періоду поточного торговельного дня:

- останньою розрахованою поточною ціною цінного паперу вважається останнє значення ціни закриття торговельного дня (останнє значення поточної ціни, розраховане на підставі біржових контрактів) у випадку, якщо з моменту її останнього розрахунку минуло не більше ніж 12 місяців.
17. У разі зупинення торгів цінним папером розрахунок поточної ціни такого цінного папера не здійснюється протягом терміну зупинення біржових торгів за таким цінним папером.