

МЕТОДИКА **розрахунку біржового фондового індексу УФБ**

1. Загальні положення

1.1. Методика розрахунку біржового фондового індексу УФБ (далі – Методика), розроблена відповідно до чинного законодавства та Правил Української фондової біржі (далі – УФБ), затверджених протоколом Біржової ради УФБ від 12.11.2015р. №9.

1.2. Методика визначає порядок формування бази розрахунку біржового фондового індексу УФБ (далі – індекс), порядок розрахунку та оприлюднення розрахованого індексу.

1.3. Індекс є показником, який визначає зведений курс цінних паперів, що котируються на УФБ, та розраховується УФБ з урахуванням вимог, встановлених НКЦПФР.

1.4. Індекс, який розраховується згідно з цією Методикою, має наступні найменування:

- повне найменування індексу – «Індекс УФБ»;
- міжнародне найменування індексу – «UKRSE Index».

1.5. Терміни, що використовуються в цій Методиці, вживаються у значенні згідно з чинним законодавством та Правилами УФБ.

2. Порядок формування бази розрахунку індексу

2.1. Індекс розраховується за цінними паперами українських емітентів, що допущені до обігу на УФБ та включені до бази розрахунку індексу, яка формується за наступними етапами:

2.1.1. Із загальної кількості цінних паперів, допущених до обігу на УФБ, обираються цінні папери, які перебувають в обігу на УФБ строком не менше 3 місяців та за якими розраховується біржовий курс.

2.1.2. Перелік цінних паперів, які входять до бази розрахунку індексу, не повинен перевищувати 10. Також формується перелік цінних паперів, які можуть бути включені до бази розрахунку індексу (далі Лист очікування).

2.1.3. При розрахунку Індексу УФБ використовуються складові окремих цінних паперів з ваговими коефіцієнтами які залежать від обсягу цих цінних паперів, що вільно обертаються на ринку цінних паперів (з урахуванням особливостей, викладених в цій методиці).

2.1.5. Черговий перегляд бази розрахунку індексу та вагових коефіцієнтів здійснюється Котирувальною комісією УФБ 15 січня, 15 квітня, 15 липня та 15 жовтня. Якщо зазначена дата припадає на неробочий день, черговий перегляд

бази розрахунку індексу здійснюється наступного робочого дня після зазначеної дати.

2.1.6. Введення в дію бази розрахунку індексу відбувається з першого торговельного дня місяця, наступного за місяцем, в якому здійснюється черговий перегляд бази розрахунку.

2.1.7. З дати введення в дію бази розрахунку на черговий період втрачає силу база розрахунку за попередній період.

2.1.8. У випадку, якщо цінний папір, включений до бази розрахунку індексу, виключається з біржового списку з підстав, передбачених Правилами УФБ, Котирувальна комісія УФБ протягом одного робочого дня здійснює позачерговий перегляд бази розрахунку індексу та вагових коефіцієнтів.

2.1.9. У випадку, якщо цінний папір, включений до бази розрахунку індексу, змінює рівень лістингу, включається в біржовий реєстр або виключається з нього, перегляд бази розрахунку не виконується.

2.1.10. Оприлюднення бази розрахунку індексу при черговому та позачерговому перегляді здійснюється через веб-сайт УФБ не пізніше останнього робочого дня, що передує даті введення в дію нової бази розрахунку індексу.

3. Порядок розрахунку індексу

3.1. Розрахунок індексу здійснюється кожного торговельного дня по закінченні усіх торговельних сесій в яких передбачено розрахунок біржових курсів.

3.1 Розрахунок Індексу УФБ виконується за формулою

$$\text{Idx}_t = \text{Idx}_{t-1} * \sum_{i=1}^N \frac{P_{i,t}}{P_{i,t-1}} * W_i ,$$

де:

Idx - Індекс УФБ;

t - дата розрахунку;

t-1 - дата попереднього торговельного дня;

P - біржовий курс, або остання поточна ціна, визначена згідно до Правил УФБ;

i - номер цінного паперу в базі розрахунку;

W - ваговий коефіцієнт цінного паперу.

3.2. Вагові коефіцієнти цінних паперів відображають вплив конкретного цінного паперу на Індекс УФБ, розраховується в залежності від виду цінного паперу та обсягу цінних паперів у вільному обігу за формулою

$$W_i = \frac{S_i}{\sum_{i=1}^N S_i} ,$$

де **S** є показник ліквідності цінного паперу. Показник ліквідності цінного паперу має базове значення 1(одиниця). Для цінних паперів, включених до біржового реєстру, показник ліквідності збільшується на 2 для цінних паперів першого рівня лістингу і на 1 для цінних паперів другого рівня лістингу. Для

акцій показник ліквідності збільшується на долю цінних паперів що знаходиться у вільному обігу.

3.3. У випадку зупинення (припинення) торгів цінними паперами, які включено до бази розрахунку, для розрахунку індексу протягом періоду зупинення торгів (до дати поновлення торгів або дати виключення із біржового списку) використовується останнє значення біржового курсу або останньої поточної ціни Р.

3.4. Розрахунок індексу здійснюється з точністю до двох знаків після коми.

3.5. Початкове значення Індексу УФБ дорівнює Індексу корпоративних облігацій УФБ, розрахованого за останній торговельний день, що передує даті введення цієї методики в дію. При першому розрахунку попереднім днем вважається останній торговельний день, що передує даті введення цієї методики в дію

4. Розкриття інформації

4.1. Розкриття інформації про Індекс УФБ та методику його розрахунку здійснюється на веб-сайті УФБ.

5. Заключні положення

5.1. Ця Методика затверджується Біржовою радою і вводиться в дію з дати, що визначається рішенням Біржової ради.

5.2. Зміни та доповнення до цієї Методики набувають чинності в порядку, визначеному п. 5.1 Методики, та оприлюднюються через веб-сайт УФБ не пізніше ніж за два робочих дні до дати введення їх в дію.