

Додаток 1
до Положення про розрахунок та
оприлюднення Українського індексу
міжбанківських ставок овернайт
(UONIA)
(пункт 10 розділу II)

Порядок розрахунку Українського індексу міжбанківських ставок овернайт
(UONIA)

1. З угод, відібраних відповідно до пунктів 6 та 7 розділу II цього Положення, формується первісна вибірка угод для розрахунку UONIA. Усі угоди первісної вибірки з надання кредитів та розміщення депозитів, що укладені окремим банком з одним і тим самим контрагентом, для цілей розрахунку UONIA агрегуються в одну угоду шляхом знаходження середньозваженого значення відсоткової ставки за всіма такими угодами.

2. Отриманий в результаті виконання пункту 1 додатка 1 до цього Положення ряд угод/агрегованих угод ранжується від найменшого до найбільшого значення відсоткової ставки. З отриманого ранжованого ряду відсікаються 5% угод/агрегованих угод від загальної їх кількості зверху ряду та 5% угод/агрегованих угод від загальної їх кількості знизу ряду.

Якщо 5% угод/агрегованих угод від загальної кількості не є цілим числом, то відповідна величина округлюється до цілого числа.

3. Із ряду угод/агрегованих угод, отриманих після виконання пункту 2 додатка 1 до цього Положення, розраховується стандартне відхилення відсоткової ставки за такою формулою:

$$\sigma_r = \sqrt{\frac{\sum_{i=1}^n (x_{ri} - \bar{x}_r)^2}{n}},$$

де σ_r – стандартне відхилення відсоткової ставки;
 x_{ri} – відсоткова ставка i -ї угоди/агрегованої угоди;
 $\bar{x}_r$ – середньоарифметичне значення ряду відсоткових ставок;
 n – кількість угод/агрегованих угод.

4. Із ряду угод/агрегованих угод, отриманого після виконання пункту 2 додатку 1 до цього Положення, відсікаються угоди/агреговані угоди, відсоткова

ставка за якими відхиляється від середньоарифметичного значення відсоткової ставки $\bar{X}_T$ більше, ніж на два стандартних відхилення відсоткової ставки σ_T .

5. Отриманий після виконання пункту 4 додатка 1 до цього Положення ряд угод вважається базовим рядом для розрахунку UONIA.

6. Значення UONIA розраховується як звичайне середнє арифметичне значення базового ряду.