



Методика расчета отраслевых индексов

1. Общие положения

1.1 Отраслевые индексы являются индексами украинского фондового рынка, рассчитываемые в соответствии с настоящей Методикой.

1.2 Индексы рассчитываются по акциям эмитентов, экономическая деятельность которых относится к соответствующим секторам экономики. Перечень Индексов, рассчитываемых, приведен в Приложении к настоящей Методике.

2. Общий порядок расчета Индексов

2.1 Индекс рассчитывается ежедневно после окончания торговых сессий на бирже ПФТС и «Украинской бирже»

2.2 Для каждого эмитента акций, который включен в базу расчета индекса, за формулами (1) и (2) рассчитывается капитализация акций данного эмитента и ее удельный вес в суммарной капитализации акций, которые входят в базу расчета индекса, соответственно.

$$CAP_i = P_i^{market} * Q_i * FF_i \quad (1)$$

$$W_i = \frac{CAP_i}{\sum_{i=1}^k CAP_i} \quad (2)$$

где:

$CAPI_i$ – капитализация акций i -того эмитента;

W_i – удельный вес капитализации акций i -того эмитента в суммарной капитализации акций, которые входят в базу расчета индекса;

P_i^{market} – рыночная цена акций i -того эмитента;

Q_i – количество акций i -того эмитента, которые находятся в обращении, шт.;

FF_i – коэффициент free-float акций i -того эмитента;

k – количество акций, включенных в базу расчета индекса

2.3 Рыночная цена акций (P_i^{market}) i -того эмитента равна последней сделке по итогам торгов на «Украинской бирже» и ПФТС.

2.4 Если цены на обеих биржах отличаются друг от друга, для расчета берется средняя арифметическая цена.

2.5 Для расчета индекса используется формула (3):

$$Index_T = Index_{(T-1)} * \frac{\sum_{i=1}^M (P_{iT}^t * Q_{iT} * FF_{iT} * W_{iT})}{\sum_{i=t}^M (P_{i(T-1)} * Q_{iT} * FF_{iT} * W_{iT})} \quad (3)$$

где:

$Index_{T-1}$ – последнее значение индекса, рассчитанное за предыдущий торговый день (T-1);

P_{iT}^t – цена i -той акции, рассчитанная в момент времени t текущего дня (день T);

$P_{i(T-1)}$ – последняя цена i -той акции, рассчитанная в день T-1;

Q_{iT} – количество акций i -того эмитента, которые находятся в обращении, шт.;

W_{iT} – весовой коэффициент i -той акции;

FF_{iT} коэффициент free-float i -той акции;

M – общее количество акций, которое входит в базу расчета индекса.

Перечень Отраслевых индексов

№ п/п	Наименование Индекса на русском языке	Дата первого произведенного расчета Индекса	Начальное значение Индекса I₁
1	Индекс металлургии	24 февраля 2010 года	100 пунктов
2	Индекс энергетики	24 февраля 2010 года	100 пунктов
3	Индекс машиностроения	24 февраля 2010 года	100 пунктов
4	Индекс финансов	24 февраля 2010 года	100 пунктов