



НАЦІОНАЛЬНИЙ БАНК УКРАЇНИ

НАКАЗ

26 березня 2019 року

м. Київ

№ 137-но

Про затвердження параметричних
моделей для розрахунку базових кривих
безкупонної дохідності

Відповідно до статей 7, 15 та 56 Закону України “Про Національний банк України”, пунктів 12, 13 Порядку оцінки за справедливою вартістю цінних паперів резидентів, що перебувають у власності Національного банку України або приймаються ним як забезпечення виконання зобов’язань, схваленого постановою Правління Національного банку України від 26 жовтня 2015 року № 732 (із змінами), з метою вдосконалення підходів до визначення справедливої вартості цінних паперів, які перебувають у власності Національного банку України або приймаються ним як забезпечення виконання зобов’язань,

НАКАЗУЮ:

1. Затвердити такі параметричні моделі для розрахунку базових кривих безкупонної дохідності за групами державних облігацій:

1) група гривневих облігацій внутрішніх державних позик (далі – ОВДП) – модель Свенссона;

2) група валютних ОВДП та валютних ОВДП з достроковим погашенням, номінованих у доларах США, – модель Нельсона-Сігела.

2. Визнати таким, що втратив чинність, наказ Національного банку України від 20 вересня 2018 року № 890-но “Про затвердження моделей для розрахунку базових кривих безкупонної дохідності”.

3. Департаменту управління ризиками (Ігор Будник) довести зміст цього наказу до відома банків України.

4. Контроль за виконанням цього наказу залишаю за собою.

5. Наказ набирає чинності з 01 квітня 2019 року.

Голова

Яків СМОЛІЙ