



**Утверждена**  
решением Правления  
от 30 ноября 2001 года №112/0

**Методика**  
расчета индикаторов денежного рынка

**I. Формирование индикаторов**

1. Настоящая Методика устанавливает порядок расчета индикаторов денежного рынка Республики Казахстан.
2. Индикаторы характеризуют текущую ситуацию на денежном рынке и выступают в качестве инструмента анализа и прогнозирования конъюнктуры денежного рынка. Индикаторы денежного рынка рассчитываются ежедневно по результатам торгового дня на основе показателей биржевых сделок и котировок по финансовым инструментам денежного рынка. В случае невозможности расчета индикатора более пяти рабочих дней подряд по причине отсутствия сделок и котировок по финансовому инструменту Правление биржи вправе принять решение о прекращении расчета соответствующего индикатора.
3. Перечень рассчитываемых индикаторов устанавливается настоящей Методикой и утверждается Правлением биржи.

**II. Виды индикаторов**

4. Индикаторами денежного рынка являются:
  - 1) **TONIA** – средневзвешенная процентная ставка репо сроком на один день на рынке автоматического репо.

**TONIA** рассчитывается с 01 сентября 2001 года на основе параметров сделок открытия репо сроком на один день, заключенных в расчетный день на рынке автоматического репо, по следующей формуле:

$$Y_t = \frac{\sum V_{cl} - \sum V_{op}}{\sum V_{op}} \times 365 / T \times 100 \%$$

где:

- $Y_t$  - средневзвешенная процентная ставка на текущую дату,  
 $\sum V_{cl}$  - объем закрытия по всем сделкам, заключенным в текущий день,  
 $\sum V_{op}$  - объем открытия по всем сделкам, заключенным в текущий день,  
 $T$  - количество календарных дней репо.

Если в расчетный день отсутствуют сделки репо сроком на один день, расчет индикатора не осуществляется.