

Методика расчета индекса АО «УзРТСБ»

1. Общие положения

Индексы АО «УзРТСБ» «UZEX-EPI», «UZEX-EFMI», «UZEX-ENMI», «UZEX-ESPI», «UZEX-ESMI», «UZEX-EPII» (далее индексы) являются индикаторами, отражающими изменения конъюнктуры и текущего состояния определенного сегмента товарного рынка на АО «УзРТСБ».

Биржевой индекс – это расчетная величина (интегральный индекс), формирующаяся на базе цен товаров, входящих в «индексную корзину», и характеризует динамику изменения цен на биржевом рынке. Индекс используется в индикативных целях и выполняет информационную функцию.

Индекс АО «УзРТСБ» рассчитывается на основе цен в национальной валюте, сформированных по результатам торгов в течение торговой недели. Номенклатура товаров (индексная корзина) для расчета индекса содержит в себе перечень товаров, реализуемых на биржевых торгах, и имеющих существенное влияние на соответствующие тенденции рынка (индексная корзина прилагается).

Расчет сводных отраслевых индексов сегмента биржевого рынка

Сводные отраслевые индексы цен сегмента биржевого рынка промышленной продукции исчисляются по соответствующим группам товаров различной степени агрегации:

-по товарам, относящимся к топливной промышленности (Exchange Petroleum Index-**EPI**);

-по товарам, относящимся к черной металлургии (Exchange ferrous metals Index -**EFMI**);

-по товарам, относящимся к цветной металлургии (Exchange non-ferrous metallurgy Index-**ENMI**);

-по товарам, относящимся к химической и нефтехимической промышленности (Exchange chemical and petrochemical Index-**ESPI**);

-по товарам, относящимся к промышленности строительных материалов (Exchange construction materials Index **ESMI**);

-по товарам, относящимся к перерабатывающей промышленности (Exchange processing industry Index-**EPII**)

Для расчета сводных индексов цен производителей продукции используются два массива статистической информации:

индексы цен на наблюдаемые виды товаров (базовая цена и текущая цена);

структура весов текущего периода (количество реализованной продукции по отдельным видам товаров и объем продукции в стоимостном выражении по сегментным отраслям).

Все сегментные индексы рассчитываются по единой методике. Для расчета сегментного индексов цен биржевого рынка применяется формула Пааше, так как текущая номенклатура реализованной продукции на бирже изменчива относительно еженедельной периодичности. Индекс цен Пааше характеризует изменение цен отчетного периода по сравнению с базисным по товарам, реализованным в отчетном периоде. То есть индекс цен Пааше показывает насколько подешевели или подорожали товары.

2. Формула расчета сегментных индексов биржевого рынка

Сегментный индекс (**IP**) рассчитывается по формуле Пааше, как отношение фактической стоимости продукции отчетного периода **Pt * Qt** к стоимости товаров, реализованных в отчетном периоде по ценам базисного периода **PO * Qt**

$$IP = \frac{\sum N(Pt * Qt)}{\sum N(PO * Qt)}$$

где:

IP = Изменение во времени указывает на характер изменения рынка (падение или рост цен)

Pt – цена товара на текущий момент

P0 – цена товара на базовый период

Qt – Объем реализованного товара.

N – Количество товаров, включенных в индексную корзину.

Пример расчета сводного индекса по товарам, относящимся к сегменту цветной металлургии.

Шаг 1. Рассчитывается сумма фактической стоимости всех товаров за отчетный период, предусмотренных для расчета сводного индекса:

Наименование товарной позиции	Средневзвешенная цена сформированная в течение недели, в тыс. сум	Объем реализации соответствующая ед. изм.	Сумма фактической стоимости товаров
1. Алюминий	7 116,1	20	142 322,7
2. Лом магния	4 110,0	1	4 110,0
3. Медь и изделия из нее	23 196,1	1 085	25 167 834,4
4. Цинк	14 746,4	48	707 828,8
Сумма			26 022 095,9

$$\Sigma N(P_t * Q_t) = (7\ 116 * 20) + (4\ 110 * 1) + (23\ 196,1 * 1\ 085) + (14\ 746,4 * 48) = 26\ 022\ 095,9 \text{ сум}$$

Шаг 2. Рассчитывается стоимость всех товаров, реализованных в отчетном периоде по ценам базисного периода, предусмотренных для расчета сводного индекса (товары включенные в индексную корзину)

Наименование товарной позиции	Средневзвешенная цена сформированная в течение базисной недели, в тыс. сум	Объем реализации соответствующая ед. изм.	Сумма фактической стоимости товаров
1. Алюминий	6 847,7	20,0	136 954
2. Лом магния	4 103,0	1,0	4 103
3. Медь и изделия из нее	19 048,2	1085	20 667 297
4. Цинк	6 072,2	48,0	291456,6
Сумма			21 099 810,6

$$\Sigma N(P_0 * Q_t) = (6\ 847,7 * 20) + (4\ 103 * 1) + (19\ 048,2 * 1\ 085) + (6\ 072,2 * 48) = 21\ 099\ 810,6 \text{ сум}$$

Шаг 3. Отношение фактической стоимости продукции отчетного периода **Pt * Qt** к стоимости товаров, реализованных в отчетном периоде по ценам базисного периода **P0 * Qt**

$$IP = \frac{\sum N(P_t * Q_t)}{\sum N(P_0 * Q_t)} = \frac{26\,022\,095,9}{21\,099\,810,6} = 123,3$$

3. Исходные данные

Исходными данными для расчета индекса является информация о сделках по товарам, выключенным в индекс, содержащая данные о средневзвешенных ценах и объемах реализации.

4. Точность предоставления информации

Значения индекса рассчитывается с точностью до двух знаков после запятой.

5. Список товарных активов «Индексная корзина»

Список товарных активов, используемых для расчета индекса меняется в соответствии с состоянием биржевого рынка.

Номенклатура товаров утверждается не более чем один раз в течение трех месяцев на основании текущего состояние рынка АО «УзРТСБ».

6. Периодичность подготовки индекса «ЕРІ», «ЕFMI», «ENMI», «ЕСPI», «ЕСMI», «ЕРII»

Индекс рассчитывается каждый пятый день недели на основе цен товарных активов, входящих в индексную корзину по результатам торгов в течение недели.

7. Раскрытие информации

Настоящая Методика, а также изменения и дополнения в Методику, значения индекса, «индексная корзина» раскрываются на Официальном сайте «УзРТСБ» в сети Интернет не позднее, чем за 3 рабочих дня до вступления их в силу.

8. Контроль и порядок внесения изменений в методику расчета индекса

Решения об утверждении и вступлении в силу настоящей Методики, а также изменений и дополнений в Методику принимаются Правлением АО «УзРТСБ».

Индексная корзина для сегмента Промышленности строительных материалов
(Exchange construction materials Index **ЕСМІ**):

Цемент
Стекло листовое
Шифер
Битум
Известь
Гипс и гипсовый камень
Кирпич

Индексная корзина для сегмента Топливной промышленности
(Exchange Petroleum Index-**ЕРІ**):

Сжиженный газ
Дизельное топливо
Бензин автомобильный
Масло индустриальное
Печное топливо
Масло моторное
Керосин
Масло трансформаторное
Масло турбинное
Масло гидравлическое
Масло трансмиссионное
Масло компрессорное
Масло дизельное
Масло редукторное

Индексная корзина для сегмента Химической и нефтехимической промышленности (Exchange chemical and petrochemical Index- **ЕСРІ**)

Полиэтилен
Минеральные удобрения
Полипропилен

Индексная корзина для сегмента цветной металлургии
(Exchange non-ferrous metallurgy Index-**ЕНМІ**)

Медь и изделия из нее
Цинк
Алюминий
Лом магния

Индексная корзина для сегмента Черная металлургия
(Exchange ferrous metals Index -**ЕFМІ**):

Арматура
Уголок
Лист стальной
Проволока
Круг
Квадрат
Швеллер
Полоса
Катанка

Индексная корзина для сегмента Перерабатывающая промышленность
(Exchange processing industry Index-EPII)

Шрот
Шелуха
Пшеница фуражная
Линт
Саломас
Кормосмесь
Глицерин
Полиакрилонитрильные волокна
Гудрон хлопковый
Пух текстильный
Соапсток