

Индикатор TONIA (Tenge OverNight Index Average) является основным индикатором рынка репо и представляет собой средневзвешенную ставку по операциям репо сроком на один день, которые проходят с ценными бумагами из корзины государственных ценных бумаг (далее – корзина ГЦБ). TONIA рассчитывается по итогам каждого торгового дня и выбрана участниками рынка как безрисковая ставка.

Методика расчёта TONIA приведена в «Методика расчёта индикаторов рынка денег» на сайте Биржи KASE (https://kase.kz/files/normative_base/met_indicators_money_market.pdf). Для расчёта данного индикатора отбираются сделки по открытию операций репо с Корзиной ГЦБ объёмом не менее 1 млн тенге и сроком один день. Все сделки ранжируются от менее доходных к более доходным. От общего объёма всех сделок отсекаются 5% сделок с наибольшим и наименьшим значением доходности. Если объём оставшихся после отсечения сделок больше или равен 100 млрд тенге, то для расчёта TONIA считается средневзвешенная ставка по операциям репо за этот день. Если объём сделок в этот день не превышает 100 млрд, то TONIA определяется как сумма действующего в этот день значения базовой ставки, установленной Национальным Банком Республики Казахстан, и среднего спреда (разницы) TONIA к базовой ставке за предыдущие пять дней.

Единица измерения TONIA: %

Время обновления индикатора: в будни, после окончания торгов, с 17:30 до 20:00 (по времени г. Нур-Султан)

TCI (TONIA Compounded Index) – композитный индекс TONIA, который рассчитывается каждый календарный день на основании последнего рассчитанного значения индикатора TONIA. Первоначальное значение индекса TCI зафиксировано на уровне 1,0000000000 пункта по состоянию на 28 декабря 2020 года. Текущее значение TCI можно узнать на сайте Биржи KASE (https://kase.kz/ru/money_market/repo-indicators/tonia_compounded/).

TCR (TONIA Compounded Rate) – составная ставка TONIA, которая рассчитывается на базе значений TCI каждый день. В расчете используется скользящее окно, которое равно фактическому количеству календарных дней в расчетном периоде. Биржа рассчитывает и публикует индикатор TCR со следующими сроками: один месяц (TCR_1M), три месяца (TCR_3M), шесть месяцев (TCR_6M).

Единицы измерения:

- Индикатор TCI – базисные пункты;
- Индикатор TCR – % годовых.

Время обновления индикаторов: каждый день с 17:30 до 20:00 (по времени г. Нур-Султан)