

Nasdaq CSD SE

TURUVÄÄRTUSE ARVUTAMISE REEGLID

Kehtiv alates:

18.09.2017

VÄÄRTPABERITE TURUVÄÄRTUSE ARVUTAMISE REEGLID

1. Väärtpaberite turuväärtus arvutatakse järgmise valemi alusel:

$$KDI = \left(\frac{\sum_{i=1}^E DL_i * DK_i}{E} \right) * k$$

Kus:

KDI – väärtpaberite hooldustasu / väärtpaberikonto haldustasu;
DL – väärtpaberite saldo arvestusperioodi iga kalendripäeva lõpus;
DK – väärtpaberite hind arvestusperioodi iga kalendripäeva lõpus. Väärtpaberite hinna määramisele kohaldatakse punktides 2-4 kehtestatud reegleid;
E – arvestusperioodi kalendripäevade arv;
k – väärtpaberite hooldustasu / väärtpaberikonto haldustasu määr.

2. Kui väärtpaberite saldo (DL) väljendab väärtpaberite väärtust (nimiväärtuseta väärtpaberi puhul), siis ei korrutata väärtpaberite hooldustasu või väärtpaberikonto haldustasu arvutamisel väärtpaberite saldot väärtpaberite hinnaga (DK).

3. Väärtpaberite hind määratakse järgmiste reeglite alusel:

3.1. Völakirjade puhul võrdub väärtpaberite hind väärtpaberite nimiväärtusega.

3.2. Lepingulise investeerimisfondi osakute hind võrdub osakute puhasväärtusega (NAV).

3.3. Punktides 3.1 ja 3.2 nimetamata ning börsil, reguleeritud turul, mitmepoolses kauplemissüsteemis või organiseeritud kauplemiskohas (edaspidi kauplemiskoht) mittekaubeldavate väärtpaberite hind võrdub väärtpaberite nimiväärtusega.

3.4. Punktides 3.1 ja 3.2 nimetamata ning ühes või mitmes Nasdaq Tallinn, Nasdaq Riia või Nasdaq Vilniuse poolt opereeritavas kauplemiskohas kaubeldavate väärtpaberite hind määratakse järgmiste reeglite alusel:

3.4.1. väärtpaberi hind on vastava kauplemispäeva sulgemishindadest madalaim;

3.4.2. kui vastaval kauplemispäeval sulgemishind puudub, siis võetakse väärtpaberi hinna määramisel aluseks madalaim viimastest olemasolevatest sulgemishindadest.

3.5. Punktides 3.1 ja 3.2 nimetamata väärtpaberite puhul, mis ei ole kauplemisele võetud Nasdaq Tallinn, Nasdaq Riia või Nasdaq Vilniuse poolt opereeritavas kauplemiskohas, kuid millega kaubeldakse ühes või mitmes Euroopa Majanduspiirkonna kauplemiskohas, määratakse väärtpaberite hind järgmiste reeglite alusel:

3.5.1. väärtpaberi hind on vastava kauplemispäeva sulgemishindadest madalaim;

3.5.2. kui vastaval kauplemispäeval sulgemishind puudub, siis võetakse väärtpaberi hinna määramisel aluseks madalaim viimastest olemasolevatest sulgemishindadest.

4. Turuväärtuse arvutamisel ei võeta arvesse likvideerimisel või pankrotis ettevõtete väärtpabereid.

5. Kui väärtpaberi hind või nimiväärtus on väljendatud mõnes muus vääringus kui euro, kasutatakse vastaval kauplemispäeval kehtivat euro ja vastava valuuta ametlikku vahetuskurssi.