

Akciový trh: akciový index - metodika

Posledná aktualizácia: 27.11.2017 || Počet zobrazení: null

Metaúdaje

Kontakt

Kontaktná osoba

Organizácia

Odbor

Adresa

Telefón

Fax

E-mail

Róbert Prieceľ

Burza cenných papierov v Bratislave, a.s

Vysoká 17, P. O. Box 151, 814 99 Bratislava

+421 2 49236 141

+421 2 49236 103

prieceľ@bsse.sk

Kontaktná osoba

Organizácia

Odbor

Adresa

Telefón

Fax

E-mail

Linda Moková

Ministerstvo financií Slovenskej republiky

Oddelenie finančnej štatistiky verejného sektora

Štefanovičova 5, 817 82 Bratislava

+421 2 59583 208

+421 2 59583 266

linda.mokova@mfsr.sk

I. Analytický rámec, koncept, definície a klasifikácie

Index SAX zahŕňa všetky tituly akcií z trhu kótovaných cenných papierov obchodovaných na Burze cenných papierov v Bratislave, a.s. (BCPB) v poslednom kalendárnom roku. Index patrí k takzvaným performance (vývojovým) indexom, ktoré odrážajú celkovú zmenu bohatstva (majetku) vyplývajúcu z investícií do akcií, ktoré sú zahrnuté v indexe. To znamená, že odráža, okrem zmien v cenách, aj platby dividend a príjem vyplývajúci zo zmien v množstve akciového kapitálu, ktorý je rozdielom medzi aktuálnou trhovou cenou a upisovacou cenou nových akcií. Do 30.6.2001 sa oficiálna denná hodnota indexu SAX vypočítavala raz denne z priemerných kurzov, od 1.7.2001 sa hodnoty indexu prepočítavajú a zverejňujú v reálnom čase, pričom oficiálnou dennou hodnotou je hodnota vypočítaná zo záverečných kurzov základných titulov.

II. Rozsah údajov

Index SAX je kapitálovo vážený index - porovnáva trhovú kapitalizáciu vybranej skupiny akcií (reprezentatívne portfólio) s trhovou kapitalizáciou tej istej skupiny akcií v referenčnom dni. Pre získanie viac informácií môžete kontaktovať BCPB, divíziu projektovej a systémovej podpory (p. Marek Osvald).

III. Výpočtové postupy

Akciový cenový index sa počíta počas celého obchodného dňa od 11,00 h do 15,30 h. Oficiálna hodnota indexu SAX pre aktuálny deň sa počíta zo záverečných kurzov základných titulov. Je zverejňovaná o 17,00 h a šírená agentúram a všetkým inštitúciám, ktoré majú zmluvu s BCPB o šírení, resp. zasielaní informácií BCPB. BCPB publikuje hodnoty indexu na svojej web stránke.

IV. Charakteristika základných údajov

Primárnym zdrojom pre index SAX sú trhové údaje z BCPB.

V. Postupy zostavovania

Emisiám zahrnutým v báze indexu SAX sú priradené váhy v proporcii k ich trhovej kapitalizácii. Index SAX sa počíta pomocou nasledujúceho vzorca:

F_i = opravný faktor pre i-tu akciu

P_i^{act} = záverečný kurz i-tej akcie k danému dňu

P_i^r = záverečný kurz i-tej akcie k referenčnému dňu (14. september 1993)

G_i = počet akcií i-tej spoločnosti k danému dňu

Formula pre výpočet: Paasche

Pravidelná revízia bázy indexu SAX sa vykonáva dvakrát ročne. Aktualizovaná báza vstupuje do platnosti vždy v prvý burzový deň mesiacov február a august bežného roka.

VI. Ostatné aspekty

- Počiatočná hodnota indexu SAX - 100 bodov sa viaže ku dňu 14.9.1993. Váha jednej spoločnosti v indexe môže byť max. 20 %.

Báza indexu od 1.8.2013:

- Zložka SAX
 - Biotika
 - OTP Banka Slovensko
 - Slovenské energetické strojárne
 - Slovnaft
 - Všeobecná úverová banka
 - Tatry mountain resorts
 - Best Hotel Properties