

УТВЕРЖДЕНО

Президент Закрытого акционерного
общества «Санкт-Петербургская
Международная
Товарно-сырьевая Биржа»

« ____ » ноября 2011 г.
(Приказ № ____)

_____ **А.Э. Рыбников**

Методика расчета индексов цен нефтепродуктов

ЗАО «СПбМТСБ»

Редакция №8

1. Общие положения

- 1.1. Настоящие индексы характеризуют динамику изменения цен нефтепродуктов на внутреннем российском рынке, в том числе нефтепродуктов, являющихся базовым активом для фьючерсных контрактов, торгуемых в Секции срочного рынка Закрытого акционерного общества «Санкт-Петербургская Международная Товарно-сырьевая Биржа» (далее – Биржа). Индексы рассчитываются как средневзвешенная цена по всем стандартным биржевым сделкам с нефтепродуктами (инструментами), входящими в базу расчета соответствующего индекса, заключённым в течение одного торгового дня в секции «Нефтепродукты» Биржи. В расчете используются сделки, приведённые по ценам к ж/д станции Владимир Горьковской ж/д (являющейся также базисом ценообразования фьючерсных контрактов) по дифференциалу тарифа транспортировки. Учитываются сделки с биржевым товаром, отгружаемым железнодорожным или трубопроводным транспортом. Индексы рассчитываются для следующих обобщенных видов нефтепродуктов:
- дизельное топливо летнее;
 - дизельное топливо зимнее;
 - бензин Регуляр-92;
 - бензин Премиум-95;
 - топливо для реактивных двигателей.
- 1.2. Наименование индексов цен нефтепродуктов устанавливается в Приложении № 01.
- 1.3. Значения индекса цен нефтепродуктов раскрываются на Официальном сайте Биржи в сети Интернет.
- 1.4. Порядок определения биржевых инструментов, входящих в базу расчета соответствующего индекса цен для каждого вида нефтепродуктов, определен в Приложении № 02.
- 1.5. Решения об утверждении и вступлении в силу настоящей Методики, а также изменений и дополнений в Методику принимаются Президентом Биржи.

2. Порядок расчета индекса

- 2.1. Индекс цен нефтепродуктов рассчитывается в течение торговой сессии Биржи каждый раз при заключении сделки с биржевым инструментом, входящим в базу расчета индекса.
- 2.2. Значение Индекса определяется в рублях Российской Федерации за одну тонну нефтепродуктов.
- 2.3. В целях расчета индекса цены сделок с биржевыми инструментами, входящими в базу расчета индекса, с условиями поставки «франко-вагон станция отправления» и «франко-труба» приводятся по ценам к ж/д станции Владимир Горьковской ж/д путем учета затрат на транспортировку до указанной станции. При этом используются цены сделок с биржевыми инструментами, торгующиеся в соответствии с Общей (унифицированной) Спецификацией биржевого товара по Секции «Нефтепродукты» ЗАО «СПБМТСБ», а также Спецификацией биржевого товара, контролером поставки по которому выступает Открытое акционерное общество «Нефтяная компания «Роснефть», и Спецификацией биржевого товара, контролером поставки по которому выступает Открытое акционерное общество «Акционерная компания по транспорту нефти «Транснефть».

Цены сделок с биржевыми инструментами, входящие в базу расчета индекса и торгующиеся в соответствии со спецификацией на топливо для реактивных двигателей с организацией биржевых торгов на балансовых пунктах по секции «Нефтепродукты», не приводятся по ценам к ж/д станции Владимир Горьковской ж/д.

Цены сделок с биржевыми товарами, входящими в базу расчета индекса с условиями поставки «франко-вагон станция назначения», «франко-вагон промежуточная станция», «самовывоз железнодорожным транспортом», «франко-резервуар» и «франко-автоцистерна» не включаются в расчет индекса.

- 2.4. Стоимость транспортировки нефтепродуктов рассчитывается согласно Прейскуранту № 10-01 «Тарифы на перевозки грузов и услуги инфраструктуры, выполняемые Российскими железными дорогами» (утв. Постановлением ФЭК РФ № 47-т/5 от 17.06.2003 г., с последующими изменениями и дополнениями).

Параметры, связанные со свойствами нефтепродуктов, а также параметры цистерны, используемые в целях расчета стоимости транспортировки нефтепродуктов, определены в Приложении № 03.

- 2.5. Значение индекса цен нефтепродуктов рассчитывается как средневзвешенная цена сделок с биржевыми инструментами, входящими в базу расчета соответствующего индекса, совершенных за текущий торговый день, по следующей формуле:

$$\text{Индекс} = \frac{\sum_{i=1}^N \sum_{j=1}^M P_{i,j} \cdot Vol_{i,j}}{\sum_{i=1}^N \sum_{j=1}^M Vol_{i,j}},$$

где N – количество инструментов, входящих в базу расчета индекса для данной группы;

M – количество сделок с i – ым инструментом, совершенных за текущий торговый день;

$P_{i,j}$ – цена j – ой сделки с i – ым инструментом с учетом затрат на транспортировку до станции Владимир Горьковской ж/д;

$Vol_{i,j}$ – объем j – ой сделки с i – ым инструментом.

Цены и объемы сделок, исключаемые из расчета значения индекса цен нефтепродуктов:

- 1) Адресные и нестандартные сделки;
- 2) Сделки, цены которых отличаются от последнего рассчитанного значения индекса более чем на 70%.

2.6. Если значение индекса не может быть определено в порядке, изложенном в пункте 2.5 настоящей Методики, то в качестве значения индекса используется значение индекса, определенное для данной группы инструментов в предшествующий торговый день.

Приложение № 01

к Методике расчета индекса
цен нефтепродуктов

Наименование индексов цен нефтепродуктов

№ п.п.	Обобщенный вид нефтепродуктов	Наименование индекса	Наименование индекса на английском языке
1.	дизельное топливо летнее	Индекс нефтепродуктов СПбМТСБ - ДТЛ	SPIMEX Petroleum Index - DTL
2.	дизельное топливо зимнее	Индекс нефтепродуктов СПбМТСБ - ДТЗ	SPIMEX Petroleum Index - DTW
3.	бензин Регуляр-92	Индекс нефтепродуктов СПбМТСБ - Регуляр-92	SPIMEX Petroleum Index - REG
4.	бензин Премиум-95	Индекс нефтепродуктов СПбМТСБ - Премиум-95	SPIMEX Petroleum Index - PREM
5.	топливо для реактивных двигателей	Индекс нефтепродуктов СПбМТСБ - ТС(РТ)	SPIMEX Petroleum Index - JET

Приложение № 02

к Методике расчета индекса
цен нефтепродуктов

Порядок определения биржевых инструментов, входящих в базу расчета индексов цен нефтепродуктов

База расчета индекса цен нефтепродуктов определяется как множество биржевых инструментов, сделки с которыми заключаются в секции «Нефтепродукты» Биржи, отвечающих следующим условиям:

1. Базовый актив биржевого инструмента входит в список базовых активов соответствующего индекса цен нефтепродуктов, приведенный в Таблице 1 настоящего Приложения;
2. Базис поставки биржевого инструмента входит в список общих базисов поставки или в список базисов поставки соответствующего индекса цен нефтепродуктов, приведенные в Таблице 2 настоящего Приложения.

Таблица 1. Список базовых активов

№ п.п.	Код	Наименование
Индекс нефтепродуктов СПБМТСБ – ДТЛ		
1.	DEC2	топливо дизельное ЕВРО сорт С, вид II
2.	DEC3	топливо дизельное ЕВРО сорт С, вид III
3.	DLC1	топливо дизельное ЭКТО, сорт С, вид I
4.	DLC2	топливо дизельное ЭКТО сорт С, вид II
5.	DS1G	топливо дизельное Л-0,05-62
6.	DS1S	топливо дизельное Л-0,05-62
7.	DS2G	топливо дизельное Л-0,035-62
8.	DS9S	топливо дизельное Л-0,05-40
9.	DTEC	топливо дизельное ЕВРО сорт С, вид I
10.	DTED	топливо дизельное ЕВРО сорт D, вид I
11.	DTS1	топливо дизельное Л-0,05-62
12.	DTS4	топливо дизельное летнее марки ДЛЭЧ-0,05-62
13.	DTS9	топливо дизельное Л-0,05-40
Индекс нефтепродуктов СПБМТСБ - ДТЗ		
1.	DE03	топливо дизельное ЕВРО класс 0 вид III
2.	DE12	топливо дизельное ЕВРО класс 1, вид II
3.	DE13	топливо дизельное ЕВРО класс 1 вид III
4.	DE22	топливо дизельное ЕВРО класс 2, вид II
5.	DE23	топливо дизельное ЕВРО класс 2, вид III
6.	DE32	топливо дизельное ЕВРО класс 3, вид II
7.	DE33	топливо дизельное ЕВРО класс 3, вид III
8.	DE43	топливо дизельное ЕВРО класс 4, вид III
9.	DEE2	топливо дизельное ЕВРО сорт Е, вид II
10.	DEE3	топливо дизельное ЕВРО сорт Е, вид III
11.	DEF2	топливо дизельное ЕВРО сорт F, вид II
12.	DTE1	топливо дизельное ЕВРО класс 1, вид I
13.	DTE2	топливо дизельное ЕВРО класс 2, вид I

14.	DTEE	топливо дизельное ЕВРО сорт Е, вид I
15.	DTW1	топливо дизельное 3-0,05 минус 25
16.	DTW2	топливо дизельное 3-0,05 минус 35
17.	DTW6	топливо дизельное ДЭКп-3-0,035 минус 20
18.	DTW7	топливо дизельное 3-0,05 минус 32 кл. 2
19.	DTW8	топливо дизельное 3-0,05 минус 35
20.	DW11	топливо дизельное 3-0,05 минус 45
21.	DW1S	топливо дизельное 3-0,05 минус 25
Индекс нефтепродуктов СПБМТСБ - Регуляр-92		
1.	A921	Бензин Регуляр ЕВРО-92 вид I
2.	A922	бензин Регуляр ЕВРО-92 вид II
3.	A92E	Бензин Регуляр Евро-92
4.	A92P	Бензин АИ-92 ЭКп
5.	AU92	Бензин Регуляр-92
Индекс нефтепродуктов СПБМТСБ - Премиум-95		
1.	A951	бензин Премиум ЕВРО-95 вид I
2.	A952	бензин Премиум ЕВРО-95 вид II
3.	A95E	Бензин Премиум-95 Евро
4.	A95P	Бензин АИ-95 ЭКп Эк.кл.3
5.	A95R	Бензин АИ-95 ЭКп Эк.кл.4
6.	AU95	Бензин Премиум-95
Индекс нефтепродуктов СПБМТСБ - ТС(РТ)		
1.	JET	Топливо для реактивных двигателей марки ТС-1
2.	RKT	Топливо для реактивных двигателей РТ
3.	TRD	Топливо РТ ТС-1

Таблица 2. Список базисов поставки

№ п.п.	Код	Наименование	Код станции
Общие базисы поставки			
1.	VLD	ЛПДС «Володарская» (г. Москва), Аэропорт, Московская ЖД	180701
2.	YAI	Яничино, Московская ЖД	194507
3.	RNT	ЗАО «РНПК», Стенькино II, Московская ЖД	223108
4.	STI	Стенькино II, Московская ЖД	223108
5.	VLI	Владимир, Горьковская ЖД	262704
6.	ZEL	Зелецино, Горьковская ЖД	269601
7.	NVY	Новаярославская, Северная ЖД	314909
8.	SYR	Сызрань I, Куйбышевская ЖД	635607
9.	KHP	Кашпир, Куйбышевская ЖД	636101
10.	FTS	Самарская группа НПЗ (ОАО «Новокуйбышевский НПЗ», ОАО, «Куйбышевский НПЗ», ОАО «Сызранский НПЗ»), Новокуйбышевская, Куйбышевская ЖД	639400
11.	NOK	Новокуйбышевская, Куйбышевская ЖД	639400
12.	SAM	Самарская группа НПЗ (ОАО «Новокуйбышевский НПЗ», ОАО «Куйбышевский НПЗ», ОАО «Сызранский НПЗ»), Новокуйбышевская, Куйбышевская ЖД	639400
13.	KZH	Кряж, Куйбышевская ЖД	639608
Индекс нефтепродуктов СПБМТСБ – ДТЛ			
1.	NIK	ЛПДС «Никольское» (г.Тамбов), Никольское, Юго-Восточная ЖД	600203

Приложение № 03

к Методике расчета индекса
цен нефтепродуктов

Параметры, связанные со свойствами нефтепродуктов, и параметры цистерны

Обобщенный вид нефтепродуктов	Код ЕТСНГ	Класс груза	Вес груза в одном вагоне тонн/цс	Грузоподъемность вагона тонн/цс
Бензины Регуляр-92 и Премиум-95	21105	2	52	66
Дизельное топливо летнее и дизельное топливо зимнее	21403, 21404	2	55	66
Топливо для реактивных двигателей	21205	2	55	66