



УТВЕРЖДЕНА

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

01.09.2015 (Приказ №334)



Президент ЗАО «СПБМТСБ»

А.Э. Рыбников

Спецификация

расчетных фьючерсных контрактов
на территориальные биржевые индексы
цен нефтепродуктов

Редакция №01

СЕКЦИЯ СРОЧНОГО РЫНКА ЗАО «СПБМТСБ»

Раздел 1. Термины и определения

- 1.1. Термины, специально не определенные в настоящей Спецификации расчетных фьючерсных контрактов на территориальные биржевые индексы цен нефтепродуктов (далее – Спецификация), Правилах проведения организованных торгов в Секции срочного рынка Закрытого акционерного общества «Санкт-Петербургская Международная Товарно-сырьевая Биржа» (далее – Правила торгов), иных Внутренних документах ЗАО «СПбМТСБ» (далее – Биржа), а также в Правилах осуществления клиринговой деятельности Закрытого акционерного общества «Расчетно-депозитарная компания» на срочном рынке ЗАО «СПбМТСБ» (далее – Правила клиринга) используются в значениях, установленных законами, нормативными актами Банка России и иными нормативными правовыми актами Российской Федерации.

Раздел 2. Общие положения

- 2.1. Настоящая Спецификация определяет качественные и количественные характеристики, а также стандартные условия Договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, базисными активами которых являются территориальные биржевые индексы цен нефтепродуктов (далее – фьючерс, фьючерсный контракт).
- Территориальные биржевые индексы цен нефтепродуктов рассчитываются в соответствии с Методикой расчета территориальных биржевых индексов цен нефтепродуктов ЗАО «СПбМТСБ».
- 2.2. Спецификация совместно с Правилами клиринга и Правилами торгов определяют порядок возникновения, изменения, прекращения и исполнения обязательств, возникающих по заключаемым Договорам.
- 2.3. Президентом или лицом его замещающим утверждаются Параметры расчетных фьючерсных контрактов на территориальные биржевые индексы цен нефтепродуктов, содержащие следующие параметры расчетных фьючерсных контрактов, базисными активами которых являются территориальные биржевые индексы цен нефтепродуктов:
- наименование фьючерсного контракта;
 - код базисного актива;
 - наименование базисного актива;
 - минимальное изменение цены;
 - стоимостная оценка минимального изменения цены.
- 2.4. Параметры, утвержденные в соответствии с пунктом 2.3 настоящего Раздела Спецификации, раскрываются путем размещения на официальном сайте Биржи в сети Интернет.
- 2.5. Параметры, утвержденные в соответствии с пунктом 2.3 настоящего Раздела Спецификации, вступают в силу в дату, определяемую Президентом Биржи, либо лицом его замещающим, но не ранее, чем через пять дней после дня раскрытия информации в соответствии с пунктом 2.4 настоящего Раздела Спецификации.

- 2.6. Все приложения к Спецификации являются ее неотъемлемой частью.

Раздел 3. Код фьючерса

- 3.1. Присвоение кода фьючерсному контракту определенной серии в СЭТ срочного рынка осуществляется по следующей формуле:

$$F + S + XXXXXXXX + M + Y,$$

где F – фьючерс;

S – расчетный;

$XXXXXXX$ – код базисного актива, определяемый в Параметрах расчетных фьючерсных контрактов на территориальные биржевые индексы цен нефтепродуктов в соответствии с пунктом 2.3 настоящей Спецификации;

M – порядковый номер месяца исполнения серии фьючерса с января по сентябрь, для октября, ноября и декабря – «А», «В» и «С» соответственно;

Y – последняя цифра года исполнения серии фьючерса.

Раздел 4. Базисные активы

- 4.1. Базисными активами фьючерсных контрактов являются территориальные биржевые индексы цен нефтепродуктов, рассчитываемые в соответствии с Методикой расчета территориальных биржевых индексов цен нефтепродуктов ЗАО «СПбМТСБ». Коды и наименования базисных активов определяются в Параметрах расчетных фьючерсных контрактов на территориальные биржевые индексы цен нефтепродуктов в соответствии с пунктом 2.3 настоящей Спецификации.

Раздел 5. Торговые дни и сроки исполнения

- 5.1. Первым Торговым днем серии фьючерса является дата, устанавливаемая решением Президента Биржи, либо лица его замещающего. Решение должно содержать:
- код фьючерсного контракта;
 - дату первого Торгового дня, в которую может быть заключен фьючерсный контракт;
 - теоретическую расчетную цену фьючерсного контракта.
- 5.2. Последним Торговым днем серии фьючерса с определенным месяцем исполнения является день исполнения этого фьючерса.
- 5.3. Днем исполнения серии фьючерса с определенным месяцем исполнения, исключая декабрь, является последний Торговый день этого месяца, если иное не установлено решением Президента Биржи, либо лица его замещающего.

Для серии фьючерса, исполнение которого производится в декабре, днем исполнения является 20 (двадцатое) число этого месяца. Если данный день не является Торговым днем, то днем исполнения серии фьючерса является ближайший следующий Торговый день.

- 5.4. Торги серией фьючерса проводятся каждый рабочий день в соответствии с Правилами торгов, начиная с первого Торгового дня и до последнего Торгового дня, определенных в соответствии с пунктами 5.1 и 5.2 настоящего Раздела, если иное не установлено решением Президента Биржи, либо лица его замещающего.

Раздел 6. Прекращение обязательств по серии фьючерса

- 6.1. Основаниями прекращения обязательств по серии фьючерса являются:
- надлежащее исполнение обязательств по серии фьючерса;
 - наличие встречных обязательств по одной серии фьючерса, позиции по которым учитываются на одном позиционном регистре;
 - иные основания, предусмотренные Правилами клиринга и Правилами торгов.
- 6.2. Обязательства по серии фьючерса прекращаются в порядке, установленном Правилами клиринга.

Раздел 7. Порядок исполнения

- 7.1. Исполнение серии фьючерса осуществляется путем периодической выплаты Участниками клиринга денежных средств, составляющих вариационную маржу и начисленных по позициям, открытым по данной серии фьючерса, в период со дня открытия данных позиций до последнего дня торгов данной серией фьючерса включительно в соответствии с настоящей Спецификацией, Правилами торгов и Внутренними документами Клиринговой организации.

Раздел 8. Цена фьючерса

- 8.1. Минимальное изменение цены фьючерса и стоимостная оценка минимального изменения цены фьючерса определяются в Параметрах расчетных фьючерсных контрактов на территориальные биржевые индексы цен нефтепродуктов в соответствии с пунктом 2.3 настоящей Спецификации.
- 8.2. Цена фьючерса может иметь значения, кратные минимальному изменению цены.
- 8.3. Цена фьючерса устанавливается в российских рублях как значение территориального биржевого индекса цен нефтепродуктов, являющегося базисным активом данного фьючерса, округленного с точностью до 10 (десяти) российских рублей по правилам математического округления.

Раздел 9. Расчетная (котировальная) цена

- 9.1. Определение расчетной цены для серии фьючерса устанавливается в соответствии с Правилами торгов.

Раздел 10. Окончательная расчетная цена

- 10.1. Окончательная расчетная цена для серии фьючерса определяется как среднее арифметическое значений территориального биржевого индекса цен нефтепродуктов, являющегося базисным активом данного фьючерса, рассчитанных по итогам пяти предшествующих Торговых дней, включая день исполнения данной серии фьючерса, округленное с точностью до 10 (десяти) российских рублей по правилам математического округления, если данное значение отличается от расчетной цены, установленной для данного фьючерса в торговый день, предшествующий последнему торговому дню, не более, чем на значение лимита изменения цены, установленное для данного фьючерса на день его исполнения.
- 10.2. Окончательная расчетная цена для серии фьючерса определяется как расчетная цена, установленная для данного фьючерса в торговый день, предшествующий последнему торговому дню, уменьшенная на значение лимита изменения цены, установленное для данного фьючерса, если определенная таким образом цена превышает среднее арифметическое значений территориального биржевого индекса цен нефтепродуктов, являющегося базисным активом данного фьючерса, рассчитанных по итогам пяти предшествующих Торговых дней, включая день исполнения данной серии фьючерса, округленное с точностью до 10 (десяти) российских рублей по правилам математического округления.
- 10.3. Окончательная расчетная цена для серии фьючерса определяется как расчетная цена, установленная для данного фьючерса в торговый день, предшествующий последнему торговому дню, увеличенная на значение лимита изменения цены, установленное для данного фьючерса, если определенная таким образом цена меньше среднее арифметическое значений территориального биржевого индекса цен нефтепродуктов, являющегося базисным активом данного фьючерса, рассчитанных по итогам пяти предшествующих Торговых дней, включая день исполнения данной серии фьючерса, округленное с точностью до 10 (десяти) российских рублей по правилам математического округления.

Раздел 11. Лимит изменения цены

- 11.1. Лимит изменения цены для серии фьючерса устанавливается в соответствии с Внутренними документами Клиринговой организации.

Раздел 12. Лимит на долю рынка

- 12.1. Лимит на долю рынка для серии фьючерса устанавливается в соответствии с Внутренними документами Клиринговой организации.

Раздел 13. Сборы

- 13.1. Виды, порядок расчета и оплаты биржевых сборов для серии фьючерса устанавливаются в соответствии с тарифами, утвержденными Советом директоров Биржи и содержащимися в Тарифном сборнике Биржи, который размещается на сайте Биржи в сети Интернет.

Раздел 14. Депозитная маржа

- 14.1. Депозитная маржа является специальным возвратным взносом, производимым каждым Участником клиринга для обеспечения исполнения его обязательств в случаях и порядке, определяемых Внутренними документами Клиринговой организации.
- 14.2. Требования к размеру депозитной маржи для серии фьючерса определяются в соответствии с Внутренними документами Клиринговой организации.

Раздел 15. Вариационная маржа

- 15.1. Порядок определения суммы денежных средств, составляющих вариационную маржу для серии фьючерса, определяется в соответствии с Внутренними документами Клиринговой организации.

Раздел 16. Порядок заключения Договоров

- 16.1. Порядок заключения Договоров регламентируется Правилами торгов.

Раздел 17. Ответственность сторон за неисполнение обязательств по фьючерсному контракту

- 17.1. Ответственность сторон за неисполнение обязательств по фьючерсному контракту устанавливается Внутренними документами Клиринговой организации и Правилами торгов.

Раздел 18. Последствия внесения изменений и дополнений в Спецификацию

- 18.1. Внесение изменений и дополнений в настоящую Спецификацию регламентируется Правилами торгов. Порядок действий в случае внесения изменений и дополнений в Спецификацию определяется Президентом Биржи.