

УТВЕРЖДЕНО

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

«___» июля 2011 г.
(Приказ № ___)

_____ **Р.Н. ЛЬВОВ**

Методика расчета индексов цен нефтепродуктов

ЗАО «СПбМТСБ»

Редакция №5

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. В целях расчета индекса цены сделок с биржевыми инструментами, входящими в базу расчета индекса, приводятся по ценам к ж/д станции Владимир Горьковской ж/д путем учета затрат на транспортировку до указанной станции.
- 2.3. 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:

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

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

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

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

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

Цены и объемы адресных и нестандартных сделок исключаются из расчёта значения индекса цен нефтепродуктов.

- 2.4. Если значение индекса не может быть определено в порядке, изложенном в пункте 2.2 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.	DTS1	Дизельное топливо летнее Л-0,05-62
2.	DTS2	Дизельное топливо летнее марки Л-0,2-62
3.	DTS6	ДТ летнее 0.2-40
4.	DTS7	ДТ летнее 0.2-62 (1000)
5.	DTS8	Дизельное топливо летнее ДТЛ 0,1-62
6.	DTS9	ДТ Л-0.05-40
7.	DTEC	ДТ ЕВРО Сорт С вид 1
8.	DEC2	ДТ ЕВРО сорт С вид II
9.	DEC3	топливо дизельное Евро сорт С, вид III
10.	DLC2	топливо дизельное ЭКТО сорт С, вид II
11.	DTED	топливо дизельное ЕВРО сорт D, вид I
Индекс нефтепродуктов СПБМТСБ - ДТЗ		
1.	DTW1	Дизельное топливо зимнее 0,05-25
2.	DTW2	Дизельное топливо зимнее 0,05-35
3.	DTW3	Дизельное топливо зимнее марки З-0,2-35
4.	DTW7	Дизельное топливо зимнее З-0,05-32 кл. 2
5.	DTW9	топливо дизельное З-0,2 минус 25
6.	DW10	ДТЗ-0.2-45
7.	DTEE	ДТ ЕВРО Сорт Е вид 1
8.	DEE2	ДТ ЕВРО зимнее сорт Е вид II
9.	DEE3	Дизельное топливо ЕВРО зимнее сорт Е, ВИД III
10.	DTE1	ДТ ЕВРО класс 1 вид 1
11.	DTE2	ДТ ЕВРО зимнее кл.2 вид I
12.	DTEF	ДТ ЕВРО зимнее сорт F вид I
13.	DEF2	ДТ ЕВРО зимнее сорт F вид II
14.	DE12	Дизельное топливо ЕВРО класс 1 вид II
15.	DE22	ДТ ЕВРО зимнее кл.2 вид II

16.	DE13	топливо дизельное ЕВРО класс 1 вид III
17.	DE23	топливо дизельное ЕВРО класс 2, вид III
18.	DT22	ДТ ЕВРО класс 2 вид II
Индекс нефтепродуктов СПБМТСБ - Регуляр-92		
1.	A92E	Бензин автомобильный Регуляр Евро-92
2.	AU92	Бензин автомобильный Регуляр-92
3.	A921	Бензин Регуляр ЕВРО-92 вид I
4.	A924	Бензин Регуляр-92 кл. 4
5.	A92P	Бензин автомобильный АИ-92 ЭКп
6.	A92S	бензин Регуляр Евро-92 вид II класс В
Индекс нефтепродуктов СПБМТСБ - Премиум-95		
1.	A95E	Бензин Премиум-95 Евро
2.	AU95	Бензин автомобильный Премиум-95
3.	A951	бензин Премиум ЕВРО-95 вид I
4.	A952	бензин Премиум ЕВРО-95 вид II
5.	A954	Бензин Премиум-95 класс 4
6.	A95P	Бензин автомобильный АИ-95 ЭКп
7.	A95T	Бензин Премиум-95 класс 2
8.	A95D	Бензин Премиум Евро-95 вид II кл. D, Рязань
9.	A95B	Бензин Премиум Евро-95 вид II класс В
Индекс нефтепродуктов СПБМТСБ - ТС(РТ)		
1.	JET	Топливо для реактивных двигателей марки ТС-1
2.	JETH	Топливо для реактивных двигателей марки ТС-1, высший сорт
3.	TRD	Топливо РТ ТС-1
4.	RKT	Топливо для реактивных двигателей РТ

Таблица 2. Список базисов поставки

№ п.п.	Код	Наименование
Общие базисы поставки		
1.	RNK	ЗАО РНПК
2.	RNT	ЗАО РНПК, труба
3.	STI	ст. Стенькино-2
4.	YAR	ЯНОС
5.	JRS	Ярославль
6.	NVY	ст. Новоярослав
7.	MOS	Московский НПЗ
8.	YAI	ст. Яничкино
9.	VOL	ЛПДС Володарская
10.	NOR	Нижегородский НПЗ
11.	ZEL	ст. Зелецино
12.	SAM	Самарская гр.НПЗ
13.	NOK	ст. Новокуйбышев
14.	KHP	ст. Кашпир
15.	KZH	ст. Кряж
16.	SYR	ст. Сызрань I
17.	VLI	ст.Владимир
Индекс нефтепродуктов СПБМТСБ - ТС(РТ)		
1.	SHR	ТЗК-Шереметьево

2.	LOB	ст. Лобня
3.	DMD	Домодедово Фьюэл Сервисиз
4.	AER	ст. Аэропорт
5.	KOS	ст. Космос
6.	BSU	Белгород-Сумской
7.	KED	ст. Кендери
8.	RZB	Ржев-Белорусски
9.	TUS	ст. Тушино
10.	BAY	ст. Бабынино
11.	VST	ст. Восстание
12.	GON	ст. Гороховец
13.	GUS	ст. Гусино
14.	DZE	Дзержинск, Горьковская ЖД
15.	ZAV	ст. Заволжье
16.	KOZ	Кожевненное, Горьковская ЖД
17.	KOI	ст. Костариха
18.	KSR	Курск, Московская ЖД
19.	LEO	Лесок, Московская ЖД
20.	LUN	Луховицы, Московская ЖД
21.	LYN	Лянгасово, Горьковская ЖД
22.	NOM	Новосмоленская, Московская ЖД
23.	PEO	Петелино, Московская ЖД
24.	HOH	Хохольская, Юго-Восточная ЖД
25.	CHO	ст. Чебсара
26.	AJE	ст. Аэропорт
27.	KSS	ст. Космос
28.	LON	ст. Лобня
29.	ZEC	ст. Зелецино
Индекс нефтепродуктов СПБМТСБ – ДТЛ		
1.	NIK	ЛПДС «Никольское» (г.Тамбов)