

**УТВЕРЖДЕНО**

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

02 августа 2012 г.

**А.Э. РЫБНИКОВ**

**СПЕЦИФИКАЦИЯ  
РАСЧЕТНОГО ФЬЮЧЕРСНОГО КОНТРАКТА  
НА ИНДЕКС НЕФТЕПРОДУКТОВ СПБМТСБ – ДТЛ**

**Редакция №1**

**Секция срочного рынка ЗАО «СПБМТСБ»**

## 01. Общие положения

---

01.01. Настоящая Спецификация расчетного фьючерсного контракта на Индекс нефтепродуктов СПБМТСБ–ДТЛ (далее – Спецификация) устанавливает основные качественные и количественные характеристики фьючерсного контракта на Индекс нефтепродуктов СПБМТСБ–ДТЛ (далее – фьючерс, фьючерсный контракт).

Индекс нефтепродуктов СПБМТСБ–ДТЛ рассчитывается в соответствии с Методикой расчета индексов цен нефтепродуктов ЗАО «СПБМТСБ».

01.02. Спецификация совместно с Правилами осуществления клиринговой деятельности Закрытого акционерного общества «Расчетно-депозитарная компания» на срочном рынке ЗАО «СПБМТСБ» (далее – Правила клиринга), Правилами биржевой торговли в Секции срочного рынка Закрытого акционерного общества «Санкт-Петербургская Международная Товарно-сырьевая Биржа» (далее – Правила торгов), иными документами, указанными в Спецификации, определяет порядок возникновения обязательств по фьючерсному контракту, а также порядок их изменения и прекращения.

01.03. Термины, определение которых не приведено в тексте настоящей Спецификации, определяются в соответствии с Правилами торгов, иными внутренними документами ЗАО «СПБМТСБ» (далее – ЗАО «СПБМТСБ», Биржа), регламентирующими деятельность Секции срочного рынка ЗАО «СПБМТСБ», Правилами клиринга, а также в соответствии с законами, нормативными правовыми актами федерального органа исполнительной власти по рынку ценных бумаг и иными нормативными правовыми актами Российской Федерации.

## 02. Код фьючерса

---

02.01. Фьючерсы в СЭТ кодируются следующим образом: FSIDTSVLIMГ,

где **F** – фьючерс;

**S** – расчетный;

**IDTSVLI** – код базового актива;

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

**Г** – последняя цифра года исполнения серии фьючерса.

## 03. Базовый актив

---

- 03.01. Базовым активом фьючерса является Индекс нефтепродуктов СПБМТСБ–ДТЛ, рассчитываемый в соответствии с Методикой расчета индексов цен нефтепродуктов ЗАО «СПБМТСБ».
- 03.02. Количество базового актива в стоимостном выражении по одному фьючерсу равно произведению 1 (Одного) рубля и значения Индекса нефтепродуктов СПБМТСБ–ДТЛ, округленного с точностью до 10 (десяти) российских рублей по правилам математического округления.

## 04. Торговые дни

---

- 04.01. Торги фьючерсом проводятся каждый рабочий день в соответствии с Правилами торгов, если иное не установлено решением Президента ЗАО «СПБМТСБ».
- 04.02. Последним торговым днем фьючерса с определенным месяцем исполнения является день исполнения этого фьючерса.
- 04.03. Следующий торговый день после дня исполнения определенной серии фьючерса является первым торговым днем новой серии фьючерса.

## 05. Сроки исполнения

---

- 05.01. Допускается обращение серий фьючерса с исполнением в любой календарный месяц года.
- 05.02. Если иное не установлено решением Президента ЗАО «СПБМТСБ», то одновременно проводятся торги сериями фьючерса с днями исполнения, приходящимися на 3 (три) ближайших месяца исполнения и 3 (три) следующих месяца исполнения, приходящихся на конец квартала (март, июнь, сентябрь, декабрь).
- 05.03. Днем исполнения фьючерса с определенным месяцем исполнения является 20-е (двадцатое) число этого месяца. Если данный день не является рабочим днем, то днем исполнения фьючерса является ближайший следующий рабочий день.

## 06. Прекращение обязательств по серии фьючерса

---

- 06.01. 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.
- 06.02. Обязательства по серии фьючерса прекращаются в порядке, установленном Правилами клиринга.

## 07. Порядок исполнения

---

- 07.01. Фьючерсы являются расчетными срочными контрактами и исполняются путем периодической выплаты Участниками клиринга вариационной маржи, начисленной по позициям, открытым по данной серии фьючерса, в период со дня открытия данных позиций до дня исполнения данной серии фьючерса включительно в соответствии с настоящей Спецификацией, Правилами клиринга и внутренними документами Биржи.

## 08. Цена фьючерса

---

- 08.01. Цена для серии фьючерса устанавливается в рублях Российской Федерации как произведение 1 (Одного) рубля и значения Индекса нефтепродуктов СПБМТСБ–ДТЛ, округленного с точностью до 10 (десяти) российских рублей по правилам математического округления.
- 08.02. Минимальное изменение цены для серии фьючерса составляет 10 (десять) российских рублей.
- 08.03. Цена фьючерса может иметь значения, кратные минимальному изменению цены.
- 08.04. Стоимостная оценка минимального изменения цены фьючерса равна 10 (десяти) российским рублям.

## 09. Расчетная (котирувальная) цена

---

- 09.01. Порядок определения расчетной цены для серии фьючерса устанавливается в соответствии с Правилами торгов.

## 10. Окончательная расчетная цена

---

- 10.01. Окончательная расчетная цена для серии фьючерса определяется в соответствии с одним из следующих пунктов:
- 10.02. Окончательная расчетная цена для серии фьючерса определяется как произведение 1 (Одного) рубля и среднеарифметического значения Индекса нефтепродуктов СПБМТСБ–ДТЛ, рассчитанных по итогам пяти предшествующих рабочих 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.
- 10.03. 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 произведение 1 (Одного) рубля и среднеарифметического значения Индекса нефтепродуктов СПБМТСБ–ДТЛ, рассчитанных по итогам пяти предшествующих рабочих дней, включая день исполнения данной серии фьючерса, округленное с точностью до 10 (десяти) российских рублей по правилам математического округления.
- 10.04. 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 произведения 1 (Одного) рубля и среднеарифметического значения Индекса нефтепродуктов СПБМТСБ–ДТЛ, рассчитанных по итогам пяти предшествующих рабочих дней, включая день исполнения данной серии фьючерса, округленного с точностью до 10 (десяти) российских рублей по правилам математического округления.

## 11. Лимит изменения цены

---

- 11.01. Лимит изменения цены для серии фьючерса устанавливается в соответствии с внутренними документами Клиринговой организации.

## 12. Лимит на долю рынка

---

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

## 13. Сборы

---

- 13.01. Виды, порядок расчета и оплаты биржевых сборов для серии фьючерса устанавливаются в соответствии с Правилами торгов и внутренними документами Клиринговой организации.

## 14. Депозитная маржа

---

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

## 15. Вариационная маржа

---

- 15.01. Размер вариационной маржи для серии фьючерса определяется в соответствии с внутренними документами Клиринговой организации.

## 16. Порядок заключения сделок

---

- 16.01. Порядок заключения сделок регламентируется Правилами торгов.

## 17. Ответственность сторон за неисполнение обязательств по фьючерсному контракту

---

- 17.01. Ответственность сторон за неисполнения обязательств по фьючерсному контракту устанавливается внутренними документами Клиринговой организации.

## 18. Последствия внесения изменений и дополнений в Спецификацию

---

- 18.01. Внесение изменений и дополнений в Спецификации срочных контрактов регламентируется Правилами торгов. Порядок действий в случае внесения изменений и дополнений в Спецификацию определяется Президентом Биржи.