

СЛУЖБА БАНКА РОССИИ  
ПО ФИНАНСОВЫМ РЫНКАМ  
**ЗАРЕГИСТРИРОВАНО**  
Дата "22" ноября 2013 г.  
в реестре за № 13-576/113-4  
Заместитель руководителя С.К. Хармашев  
Подпись \_\_\_\_\_



УТВЕРЖДЕНА

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

12 сентября 2013 г. (Приказ № 542)

Президент ЗАО «СПБМТСБ»



А.Э. Рыбников А.Э. Рыбников

# Спецификация

расчетного фьючерсного контракта на  
Индекс нефтепродуктов СПБМТСБ – ДТЛ

СЛУЖБА БАНКА РОССИИ  
ПО ФИНАНСОВЫМ РЫНКАМ  
**УПРАВЛЕНИЕ ДЕЛАМИ  
И АРХИВА**  
**ПРИЛОЖЕНИЕ**  
К ВХ. № 50-13-6395  
ОТ 27.09.2013

Редакция №04

СЕКЦИЯ СРОЧНОГО РЫНКА ЗАО «СПБМТСБ»

# Оглавление

Раздел 1. Термины и определения.....	3
Раздел 2. Общие положения.....	3
Раздел 3. Код фьючерса.....	3
Раздел 4. Базисный актив.....	4
Раздел 5. Торговые дни.....	4
Раздел 6. Сроки исполнения.....	4
Раздел 7. Прекращение обязательств по серии фьючерса.....	4
Раздел 8. Порядок исполнения.....	5
Раздел 9. Цена фьючерса.....	5
Раздел 10. Расчетная (котировальная) цена.....	5
Раздел 11. Окончательная расчетная цена.....	5
Раздел 12. Лимит изменения цены.....	6
Раздел 13. Лимит на долю рынка.....	6
Раздел 14. Сборы.....	6
Раздел 15. Депозитная маржа.....	7
Раздел 16. Вариационная маржа.....	7
Раздел 17. Порядок заключения Договоров.....	7
Раздел 18. Ответственность сторон за неисполнение обязательств по фьючерсному контракту.....	7
Раздел 19. Последствия внесения изменений и дополнений в Спецификацию.....	8

## Раздел 1. Термины и определения

- 1.1 Термины, специально не определенные в настоящей Спецификации, Правилах проведения организованных торгов в Секции срочного рынка Закрытого акционерного общества «Санкт-Петербургская Международная Товарно-сырьевая Биржа» (далее – Правила торгов), Правилах осуществления клиринговой деятельности РДК (ЗАО) на срочном рынке ЗАО «СПБМТСБ» (далее – Правила клиринга) и иных Внутренних документах Биржи, используются в значениях, установленных законами, нормативными актами Банка России и иными нормативными правовыми актами Российской Федерации.

## Раздел 2. Общие положения

- 2.1 Настоящая Спецификация расчетного фьючерсного контракта на Индекс нефтепродуктов СПБМТСБ–ДТЛ (далее – Спецификация) устанавливает основные качественные и количественные характеристики Договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, базисным активом которых является Индекс нефтепродуктов СПБМТСБ–ДТЛ (далее – фьючерс, фьючерсный контракт).

Индекс нефтепродуктов СПБМТСБ–ДТЛ рассчитывается в соответствии с Методикой расчета 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.

## Раздел 3. Код фьючерса

- 3.1 Фьючерсы в СЭТ кодируются следующим образом: FSIDLVLIMГ,

где F – фьючерс;

S – расчетный;

IDTLVLI – код базисного 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.

## Раздел 4. Базисный актив

- 4.1 Базисным активом фьючерса является Индекс нефтепродуктов СПБМТСБ–ДТЛ, рассчитываемый в соответствии с Методикой расчета индексов цен нефтепродуктов ЗАО «СПБМТСБ».
- 4.2 Количество базисного 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.

## Раздел 5. Торговые дни

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

## Раздел 6. Сроки исполнения

- 6.1 Допускается обращение серий фьючерса с исполнением в любой календарный месяц года.
- 6.2 Если иное не установлено решением Президента ЗАО «СПБМТСБ», то одновременно проводятся торги сериями фьючерса с днями исполнения, приходящимися на 2 (два) ближайших месяца исполнения – март, июнь, сентябрь, декабрь.
- 6.3 Днем исполнения фьючерсов с определенным месяцем исполнения, исключая декабрь, является последний торговый день этого месяца.

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

## Раздел 7. Прекращение обязательств по серии фьючерса

- 7.1 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.

7.2 Обязательства по серии фьючерса прекращаются в порядке, установленном Правилами клиринга.

## Раздел 8. Порядок исполнения

8.1 Фьючерсы являются расчетными срочными контрактами и исполняются 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 дня исполнения данной серии фьючерса включительно в соответствии с настоящей Спецификацией, Правилами торгов и Правилами клиринга.

## Раздел 9. Цена фьючерса

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

## Раздел 10. Расчетная (котировальная) цена

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

## Раздел 11. Окончательная расчетная цена

11.1 Окончательная расчетная цена для серии фьючерса определяется в соответствии с одним из следующих пунктов:

- 11.1.1 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.
- 11.1.2 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 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.
- 11.1.3 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 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.

## Раздел 12. Лимит изменения цены

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

## Раздел 13. Лимит на долю рынка

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

## Раздел 14. Сборы

- 14.1 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.

## Раздел 15. Депозитная маржа

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

## Раздел 16. Вариационная маржа

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

## Раздел 17. Порядок заключения Договоров

- 17.1 Порядок заключения Договоров регламентируется Правилами торгов.

## Раздел 18. Ответственность сторон за неисполнение обязательств по фьючерсному контракту

- 18.1 Ответственность сторон за неисполнение обязательств по фьючерсному контракту устанавливается Внутренними документами Клиринговой организации.

## Раздел 19. Последствия внесения изменений и дополнений в Спецификацию

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



Всего прошито, пронумеровано,  
скреплено печатью 8 листов  
Президент ЗАО «СПбМТСБ»

А.Э. Рыбников

(подпись)

*12.09.2013*  
*A. E. Rybnikov*

