

СЛУЖБА БАНКА РОССИИ
ПО ФИНАНСОВЫМ РЫНКАМ
ЗАРЕГИСТРИРОВАНО
Дата "12" ноября 2013 г.
в реестре за № 13-576/пз-4
Заместитель руководителя *С.К. Каршанов*
Подпись _____



УТВЕРЖДЕНА

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

12 сентября 2013 г. (Приказ № 548)

Президент ЗАО «СПБМТСБ»



A. E. Rybnikov
А.Э. Рыбников

Спецификация

расчетного фьючерсного контракта на
Индекс нефтепродуктов СПБМТСБ – ДТЗ

СЛУЖБА БАНКА РОССИИ
ПО ФИНАНСОВЫМ РЫНКАМ
**УПРАВЛЕНИЕ ДЕЛАМИ
И АРХИВА**
ПРИЛОЖЕНИЕ
К ВХ. № 50-13-6395
ОТ 27 09 2013

Редакция №01

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–ДТЗ (далее – Спецификация) устанавливает основные качественные и количественные характеристики Договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, базисным активом которых является Индекс нефтепродуктов СПБМТСБ–ДТЗ (далее – фьючерс, фьючерсный контракт).

Индекс нефтепродуктов СПБМТСБ–ДТЗ 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: FSIDTZVLIМГ,

где F – фьючерс;

S – расчетный;

IDTZVLI – код базисного актива;

М – 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–ДТЗ, 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–ДТЗ, 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–ДТЗ, 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–ДТЗ, 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–ДТЗ, 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–ДТЗ, 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 2 листов
Президент ЗАО «СПбМТСБ»
12.09.2013
А.Э. Рыбников
(подпись)