

УТВЕРЖДЕНА

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

06.10.2014 (Приказ №281)

с изменениями и дополнениями от
31.07.2015 (Приказ №273)

Президент ЗАО «СП6МТСБ»

_____ А.Э. Рыбников

Методика

расчета индексов цен нефтепродуктов

Раздел 1. Термины и определения

База расчета	Множество биржевых инструментов, на основании цен договоров с которыми осуществляется расчет индекса цен нефтепродуктов
Базис поставки	Место, в котором обязанность поставщика по поставке биржевого товара признается исполненной (место перехода прав собственности на данный биржевой товар), определенное в соответствии со спецификациями биржевого товара по Секции «Нефтепродукты» ЗАО «СПбМТСБ».
Биржа	Закрытое акционерное общество «Санкт-Петербургская Международная Товарно-сырьевая Биржа».
Биржевой инструмент	Биржевой товар с указанным базисом поставки и способом поставки, допущенный к торгам по соответствующей Спецификации биржевого товара.
Биржевой товар	Нефтепродукты и продукция нефтехимического производства определенной категории (вида, марки, качества), не изъятые из оборота и допущенные Биржей к биржевой торговле в Секции «Нефтепродукты».
Группа базисов поставки	Совокупность базисов поставки, сгруппированных согласно следующему правилу: <ul style="list-style-type: none">▪ Базисы поставки, находящиеся в непосредственной близости друг от друга, отнесены к одной группе, при этом: <ul style="list-style-type: none">▪ Каждый базис поставки должен быть отнесен к какой-либо группе;▪ Группа может состоять из одного базиса поставки.
Дополнительная группа базисов поставки	Группа базисов поставки более удаленная от станции Владимир Горьковской железной дороги, чем основные базисы поставки. Список дополнительных групп базисов поставки определен в Порядке определения базы расчета индексов цен нефтепродуктов. Договоры, заключенные на базисах поставки, входящих в дополнительную группу базисов поставки, могут быть использованы при расчете индекса цен нефтепродуктов, если для этой дополнительной группы базисов поставки рассчитан коэффициент приведения согласно Порядку приведения цен договоров к станции Владимир Горьковской железной дороги.
Дополнительный базис поставки	Базис поставки, входящий в дополнительную группу базисов поставки.
Коэффициент приведения	Поправочный коэффициент, рассчитываемый для каждой дополнительной группы базисов поставки по каждому виду нефтепродуктов. Значения коэффициентов приведения определены в Порядке приведения цен договоров к станции Владимир Горьковской железной дороги.

Основная группа базисов поставки	Группа базисов поставки, расположенная в непосредственной близости от станции Владимир Горьковской железной дороги. Список основных групп базисов поставки определен в Порядке определения базы расчета индексов цен нефтепродуктов. Договоры, заключенные на базисах поставки, входящих в основную группу базисов поставки, используются для определения ценового уровня индекса цен нефтепродуктов.
Основной базис поставки	Базис поставки, входящий в основную группу базисов поставки.

Термины, специально не определенные в настоящей Методике, используются в значениях, установленных внутренними документами Биржи, а также в соответствии с законами и иными правовыми актами Российской Федерации.

Раздел 2. Общие положения

- 2.1. Настоящая Методика расчета индексов цен нефтепродуктов (далее – Методика) устанавливает правила расчета значений индексов цен нефтепродуктов (далее – индексы), характеризующих динамику изменения цен нефтепродуктов на внутреннем российском рынке, в том числе нефтепродуктов, являющихся базовым активом для фьючерсных контрактов, допущенных к торгам в Секции срочного рынка Биржи.
- 2.2. Индексы рассчитываются для следующих видов нефтепродуктов:
- дизельное топливо (код – DT_);
 - дизельное топливо летнее (код - DTL);
 - дизельное топливо зимнее (код - DTZ);
 - дизельное топливо межсезонное (код - DTM);
 - бензин Регуляр-92 (код - REG);
 - бензин Премиум-95 (код - PRM);
 - топливо для реактивных двигателей (код - TRD);
 - мазут (код - MZT).
- 2.3. Наименования индексов для каждого вида нефтепродуктов на русском и английском языке предусмотрены в Приложении №01 к настоящей Методике.
- 2.4. Индекс обозначается кодом *SPI_OIL*,
где *SPI* (SPIMEX petroleum index) – обозначение индексов цен нефтепродуктов, одинаковое для всех индексов цен нефтепродуктов, не зависимо от того, для какого вида нефтепродуктов рассчитывается индекс;
OIL – код вида нефтепродуктов, определенный в пункте 2.2. настоящей Методики, для которого рассчитывается индекс.
- 2.5. Индексы рассчитываются как средневзвешенная цена по всем договорам, заключённым на биржевых торгах в течение одного торгового дня в Секции «Нефтепродукты» Биржи с биржевыми инструментами, входящими в базу расчета соответствующего индекса. Базисы поставки, на основе которых формируется база расчета индекса, подразделяются на основные (находящиеся в

непосредственной близости от станции Владимир Горьковской железной дороги) и дополнительные. При расчете индекса цены договоров приводятся к станции Владимир Горьковской железной дороги путем включения в цену расходов на транспортировку, либо с использованием рассчитанных коэффициентов приведения.

- 2.6. Значения индексов раскрываются на [Официальном сайте Биржи в сети Интернет](#).
- 2.7. Методика, а также изменения и дополнения в Методику утверждаются Президентом Биржи. Дата вступления в силу утвержденного документа определяется по решению Президента Биржи.

Методика, а также изменения и дополнения в Методику, утвержденные Президентом Биржи, раскрываются на [Официальном сайте Биржи в сети Интернет](#) в срок не позднее 10 (десяти) рабочих дней до даты вступления утвержденного документа в силу, если иной срок не установлен решением Президента Биржи.

Раздел 3. Порядок расчета

- 3.1. Значения индекса рассчитываются ежедневно по окончании торгов в Секции «Нефтепродукты» Биржи.

- 3.2. Значения индекса определяются в рублях за тонну нефтепродуктов.

- 3.3. Биржевые инструменты, входящие в базу расчета индекса (кроме индекса цен дизельного топлива), определяются согласно [Порядку определения базы расчета индексов цен нефтепродуктов](#).

База расчета индекса цен дизельного топлива формируется из биржевых инструментов, входящих в базы расчета индексов дизельного топлива летнего, дизельного топлива межсезонного и дизельного топлива зимнего.

- 3.4. Приведение цен договоров к станции Владимир Горьковской железной дороги осуществляется согласно [Порядку приведения цен договоров к станции Владимир Горьковской железной дороги](#).

- 3.5. Значение индекса цен нефтепродуктов одного вида (*SPI_OIL*) рассчитывается как средневзвешенная цена договоров с биржевыми инструментами, входящими в базу расчета индекса, заключенных за текущий торговый день (день *T*), и удовлетворяющих условиям пункта 3.6. настоящей Методики, по следующей формуле:

$$SPI_OIL = \frac{\sum Pr_i \cdot Vol_i}{\sum Vol_i},$$

где Pr_i – цена i – го договора с биржевым инструментом, входящим в базу расчета соответствующего индекса согласно [Порядку определения базы расчета индексов цен нефтепродуктов](#);

Vol_i – объем i – го договора с биржевым инструментом, входящим в базу расчета соответствующего индекса согласно [Порядку определения базы расчета индексов цен нефтепродуктов](#).

- 3.6. Договоры, входящие в расчет значения индекса цен нефтепродуктов одного вида (кроме индекса цен дизельного топлива), должны удовлетворять следующим условиям:

1. договор не является договором, заключенным на основании адресных заявок;

2. объем договора не более 3000 тонн;
3. цена договора не более чем на 10% больше максимального и не более чем на 10% меньше минимального из следующих двух значений:
 - значение индекса, определенное для нефтепродуктов соответствующего вида в предыдущий торговый день (день $T - 1$);
 - среднее арифметическое значений индексов, определенных для нефтепродуктов соответствующего вида, за период со дня $T - 6$ по день $T - 2$ (включительно)¹.

Договоры, входящие в расчет индекса цен дизельного топлива должны входить в расчет индекса одного из следующих видов нефтепродуктов: дизельного топлива летнего, дизельного топлива межсезонного или дизельного топлива зимнего.

- 3.7. Если значение индекса не может быть определено из-за отсутствия договоров, соответствующих требованиям, предусмотренным в пункте 3.6. настоящей Методики, то в качестве значения индекса используется значение индекса, определенное для данного вида нефтепродуктов в предшествующий торговый день.
- 3.8. Значение индекса в первый день расчета в соответствии с настоящей Методикой определяется согласно пункту 3.5. настоящей Методики.

¹ Если за этот период не заключено ни одного договора, удовлетворяющего условиям, предусмотренным в подпунктах 1, 2 пункта 3.6 настоящей Методики, с биржевым инструментом, входящим в базу расчета соответствующего индекса, выполнение условия, предусмотренного в подпункте 3 пункта 3.5 настоящей Методики, не требуется.

Приложение №01

к Методике расчета индексов цен
нефтепродуктов

Наименования индексов цен нефтепродуктов

Вид нефтепродуктов	Наименование индекса	Наименование индекса на английском языке	Товарный знак
дизельное топливо	Индекс цен нефтепродуктов СПбМТСБ – ДТ	SPIMEX Petroleum Index – DT_	
дизельное топливо летнее	Индекс цен нефтепродуктов СПбМТСБ – ДТЛ	SPIMEX Petroleum Index – DTL	
дизельное топливо зимнее	Индекс цен нефтепродуктов СПбМТСБ – ДТЗ	SPIMEX Petroleum Index – DTZ	
дизельное топливо межсезон.	Индекс цен нефтепродуктов СПбМТСБ – ДТМ	SPIMEX Petroleum Index – DTM	
бензин Регуляр-92	Индекс цен нефтепродуктов СПбМТСБ – Регуляр-92	SPIMEX Petroleum Index – REG	
бензин Премиум-95	Индекс цен нефтепродуктов СПбМТСБ – Премиум-95	SPIMEX Petroleum Index – PRM	
топливо для реактивных двигателей	Индекс цен нефтепродуктов СПбМТСБ – ТС(РТ)	SPIMEX Petroleum Index – TRD	
мазут	Индекс цен нефтепродуктов СПбМТСБ – Мазут	SPIMEX Petroleum Index – MZT	