

УТВЕРЖДЕНО

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

10.01.2013 г. (Приказ № 01)

А.Э. Рыбников

Методика расчета индексов цен нефтепродуктов

Редакция №13

ЗАО «СПбМТСБ»

1. Термины и определения

База расчета индекса	Множество биржевых инструментов, на основании цен сделок с которыми осуществляется расчет индекса цен нефтепродуктов.
Базис поставки	Место перехода прав собственности на данный биржевой товар, определенное в соответствии с Общей (унифицированной) Спецификацией биржевого товара по Секции «Нефтепродукты» ЗАО «СПБМТСБ», Спецификацией биржевого товара, контролером поставки по которому выступает Открытое акционерное общество «Нефтяная компания «Роснефть» или Спецификацией на топливо для реактивных двигателей с организацией биржевых торгов на балансовых пунктах по Секции «Нефтепродукты».
Биржа	Закрытое акционерное общество «Санкт-Петербургская Международная Товарно-сырьевая Биржа»
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».
Биржевой инструмент	Биржевой товар с указанным базисом поставки, допущенный к торгам на определенных условиях поставки.
Группа дополнительных базисов поставки	<p>Множество базисов поставки, находящихся в непосредственной близости друг от друга и удовлетворяющих следующим условиям:</p> <ul style="list-style-type: none">▪ не являются основными базисами;▪ цены биржевых товаров на этих базисах имеют сильную корреляцию с ценами биржевых товаров на основных базисах поставки. <p>Группа может состоять из одного базиса поставки.</p>
Дополнительный базис поставки	Базис поставки, входящий в группу дополнительных базисов поставки. Список дополнительных базисов поставки для каждого вида нефтепродуктов определен в Порядке определения базы расчета индекса цен нефтепродуктов.
Коэффициент приведения	Поправочный коэффициент, рассчитываемый для каждой группы дополнительных базисов поставки по каждому виду нефтепродуктов. Значения коэффициентов приведения определены в Порядке приведения цен сделок к станции Владимир Горьковской ж/д.
Основные базисы поставки	Базисы поставки, приведенные в Порядке определения базы расчета индекса цен нефтепродуктов и используемые для определения ценового уровня индекса цен нефтепродуктов.

Термины, специально не определенные в настоящей Методике, используются в значениях, установленных внутренними документами Биржи.

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.

Индексы рассчитываются как средневзвешенная цена по всем биржевым сделкам, заключённым 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 ж/д) и дополнительные. При расчете индекса цены сделок приводятся к станции Владимир Горьковской ж/д путем включения в цену расходов на транспортировку, либо с использованием рассчитанных коэффициентов приведения.

2.2 Индексы рассчитываются для следующих видов нефтепродуктов:

- дизельное топливо летнее;
- дизельное топливо зимнее;
- дизельное топливо межсезонное;
- бензин Регуляр-92;
- бензин Премиум-95;
- топливо для реактивных двигателей;
- мазут.

2.3 Наименования индексов на русском и английском языке устанавливаются в Приложении № 01 к настоящей Методике.

2.4 Значения индексов раскрываются на Официальном сайте Биржи в сети Интернет.

2.5 Решения об утверждении и вступлении в силу настоящей Методики, а также изменений и дополнений в Методику принимаются Президентом Биржи.

Настоящая Методика, а также изменения и дополнения в Методику раскрываются на Официальном сайте Биржи в сети Интернет не позднее, чем за 5 рабочих дней до вступления в силу.

3. Порядок расчета индекса

3.1 Индекс рассчитывается в течение торговой сессии Биржи каждый раз при заключении сделки с биржевым инструментом, входящим в базу расчета индекса.

3.2 Значение индекса определяется в российских рублях за одну тонну нефтепродуктов.

- 3.3 Биржевые инструменты, входящие в базу расчета индекса, определяются согласно Порядку определения базы расчета индекса цен нефтепродуктов.
- 3.4 Приведение цен сделок к станции Владимир Горьковской ж/д осуществляется согласно Порядку приведения цен сделок к станции Владимир Горьковской ж/д.
- 3.5 Значение индекса рассчитывается как средневзвешенная цена сделок с биржевыми инструментами, входящими в базу расчета соответствующего индекса, совершенных за текущий торговый день (день T) и удовлетворяющих следующим условиям:
- 1) сделка не является адресной;
 - 2) объем сделки не более 6000 тонн
 - 3) приведенная цена сделки не более чем на 10% больше максимального и не более чем на 10% меньше минимального из следующих двух значений:
 - a. значение индекса в предыдущий торговый день (день $T - 1$);
 - b. среднее арифметическое значений индекса за период со дня $T - 6$ по день $T - 2$ (включительно)¹.

Значение индекса рассчитывается по следующей формуле:

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

где N – количество биржевых инструментов, входящих в базу расчета индекса для данного вида нефтепродуктов;

M – количество сделок с i – ым биржевым инструментом, совершенных за текущий торговый день и удовлетворяющих условиям в первом абзаце этого пункта;

$Pr_{i,j}$ – цена j – ой сделки с i – ым биржевым инструментом, приведенная к станции Владимир Горьковской ж/д;

$Vol_{i,j}$ – объем j – ой сделки с i – ым биржевым инструментом

- 3.6 Если значение индекса не может быть определено в порядке, изложенном в пункте 3.5. настоящей Методики, то в качестве значения индекса используется значение индекса, определенное для данного вида нефтепродуктов в предшествующий торговый день.

¹ Если за этот период не совершено ни одной сделки, удовлетворяющей условиям, предусмотренным в подпунктах 1, 2 пункта 3.5 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 индекса
цен нефтепродуктов

Наименования индексов цен нефтепродуктов

Вид нефтепродуктов	Наименование индекса	Наименование индекса на английском языке
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 реакт. двигателей	Индекс цен нефтепродуктов СПбМТСБ – ТС (РТ)	SPIMEX Petroleum Index – TRD
мазут	Индекс цен нефтепродуктов СПбМТСБ – Мазут	SPIMEX Petroleum Index – MZT