

**УТВЕРЖДЕНО**

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

10.01.2013 г. (Приказ № 01)

с изменениями и дополнениями от

11.04.2013 г. (Приказ № 215)

**А.Э. Рыбников**

# Методика

расчета индексов цен нефтепродуктов

# Раздел 1. Термины и определения

<b>База расчета</b>	Множество биржевых инструментов, на основании цен сделок с которыми осуществляется расчет индекса цен нефтепродуктов
<b>Базис поставки</b>	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».
<b>Биржа</b>	Закрытое акционерное общество «Санкт-Петербургская Международная Товарно-сырьевая Биржа».
<b>Биржевой товар</b>	Нефтепродукты и продукция нефтехимического производства определенной категории (вида, марки, качества), не изъятые из оборота и допущенные Биржей к биржевой торговле в Секции «Нефтепродукты».
<b>Биржевой инструмент</b>	Биржевой товар с указанным базисом поставки, допущенный к торгам на определенных условиях поставки.
<b>Группа базисов поставки</b>	Совокупность базисов поставки, сгруппированных согласно следующему правилу: <ul style="list-style-type: none"><li>▪ Базисы поставки, находящиеся в непосредственной близости друг от друга, отнесены к одной группе,</li></ul> при этом: <ul style="list-style-type: none"><li>▪ Каждый базис поставки должен быть отнесен к какой-либо группе;</li><li>▪ Группа может состоять из одного базиса поставки.</li></ul>
<b>Дополнительная группа базисов поставки</b>	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. Сделки 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 сделок к станции Владимир Горьковской железной дороги.
<b>Дополнительный базис поставки</b>	Базис поставки, входящий в дополнительную группу базисов поставки.
<b>Коэффициент приведения</b>	Поправочный коэффициент, рассчитываемый для каждой дополнительной группы базисов поставки по каждому виду нефтепродуктов. Значения коэффициентов приведения определены в Порядке приведения цен сделок 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](#). Сделки 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.

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 железной дороги) и дополнительные. При расчете индекса цены сделок приводятся к станции Владимир Горьковской железной дороги 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 10 рабочих дней до вступления их в силу.

## Раздел 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 индексов цен нефтепродуктов.

3.4. Приведение цен сделок к станции Владимир Горьковской железной дороги осуществляется согласно Порядку приведения цен сделок к станции Владимир Горьковской железной дороги.

3.5. Значение индекса рассчитывается как средневзвешенная цена сделок с биржевыми инструментами, входящими в базу расчета соответствующего индекса, совершенных за текущий торговый день (день Т) 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:
  - значение индекса в предыдущий торговый день (день Т – 1);
  - среднее арифметическое значений индекса за период со дня Т – 6 по день Т – 2 (включительно)<sup>1</sup>.

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 железной дороги;

$Vol_{i,j}$  – 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.

---

<sup>1</sup> 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 индексов 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