



УТВЕРЖДЕНА

Президентом Акционерного общества «Санкт-Петербургская Международная Товарно-сырьевая Биржа»

09/09/2016 (Приказ № 267)

Президент АО «СПБМТСБ»



А.Э. Рыбников

Спецификация

поставочных фьючерсных контрактов
на российскую экспортную нефть сорта Юралс-Приморск

Редакция №01

СЕКЦИЯ СРОЧНОГО РЫНКА АО «СПБМТСБ»

Раздел 1. Общие положения

- 1.1. Настоящая Спецификация поставочных фьючерсных контрактов на российскую экспортную нефть сорта Юралс-Приморск (далее – Спецификация) определяет качественные и количественные характеристики, а также стандартные условия Договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, базисным активом которых является российская экспортная нефть сорта Юралс-Приморск (далее – фьючерс, фьючерсный контракт).
- 1.2. Спецификация совместно с Правилами проведения организованных торгов в Секции срочного рынка Акционерного общества «Санкт-Петербургская Международная Товарно-сырьевая Биржа» (далее – Правила торгов) и Правилами осуществления клиринговой деятельности РДК (АО) на срочном рынке АО «СПбМТСБ» (далее – Правила клиринга) определяют порядок возникновения, изменения, прекращения и исполнения обязательств, возникающих по заключаемым Договорам и Договорам поставки, заключаемым во исполнение фьючерсного контракта.
- 1.3. Президент или лицо его замещающее своим решением утверждает следующие параметры поставочных фьючерсных контрактов:
 - качественные характеристики базисного актива;
 - поставочная партия;
 - количество базисного актива по одному фьючерсу;
 - минимальное изменение цены;
 - стоимостная оценка минимального изменения цены.
- 1.4. Параметры, утвержденные в соответствии с пунктом 1.3 настоящего Раздела Спецификации, раскрываются путем размещения на официальном сайте Биржи в сети Интернет.
- 1.5. Параметры, утвержденные в соответствии с пунктом 1.3 настоящего Раздела Спецификации, вступают в силу в дату, определяемую Президентом Биржи, либо лицом его замещающим, но не ранее, чем через пять дней после дня раскрытия информации в соответствии с пунктом 1.4 настоящего Раздела Спецификации.
- 1.6. Термины, специально не определенные в настоящей Спецификации, Правилах торгов, Правилах клиринга и иных Внутренних документах Биржи, используются в значениях, установленных законами, нормативными актами Банка России и иными нормативными правовыми актами Российской Федерации.

Раздел 2. Код фьючерса

- 2.1. Присвоение кода фьючерсному контракту определенной серии в СЭТ срочного рынка осуществляется по следующей формуле:

$$U + M + Y,$$

где U – код базисного актива;

М – порядковый номер месяца исполнения обязательств по поставке базисного актива для серии фьючерса с января по сентябрь, для октября, ноября и декабря – «А», «В» и «С» соответственно;

У – последняя цифра года исполнения обязательств по поставке базисного актива для серии фьючерса.

Раздел 3. Базисные активы

- 3.1. Базисным активом фьючерсных контрактов является российская экспортная нефть сорта Юралс-Приморск, качественные характеристики которой определены в соответствии с пунктом 1.3 настоящей Спецификации.
- 3.2. Поставка базисного актива осуществляется на базисе поставки порт «Приморск» на условиях и в порядке, установленных настоящей Спецификацией и Правилами торгов.

Раздел 4. Торговые дни и сроки исполнения

- 4.1. Первым Торговым днем серии фьючерса является дата, устанавливаемая решением Президента Биржи, либо лица его замещающего. Решение должно содержать:
 - код фьючерсного контракта;
 - дату первого Торгового дня, в который может быть заключен фьючерсный контракт;
 - теоретическую расчетную цену фьючерсного контракта.
- 4.2. Последним Торговым днем серии фьючерса является день, наступающий за двадцать один календарный день до первого календарного дня месяца исполнения обязательств по поставке базисного актива для серии фьючерса, если иное не установлено решением Президента Биржи, либо лица его замещающего. Если данный день не является Торговым днем, то последним Торговым днем серии фьючерса является ближайший предшествующий этому дню Торговый день.
- 4.3. Торги серией фьючерса проводятся каждый рабочий день в соответствии с Правилами торгов, начиная с первого Торгового дня и до последнего Торгового дня, определенных в соответствии с пунктами 4.1 и 4.2 настоящего Раздела Спецификации, если иное не установлено решением Президента Биржи, либо лица его замещающего.
- 4.4. Днем исполнения серии фьючерса является последний Торговый день серии фьючерса, определенный в соответствии с пунктом 4.2 настоящего Раздела Спецификации.
- 4.5. Исполнение обязательств по поставке базисного актива осуществляется в соответствии с Договором поставки в период с первого календарного дня по последний календарный день определенного для серии фьючерса месяца исполнения обязательств по поставке базисного актива (пункт 2.1 настоящего Раздела Спецификации).

Раздел 5. Прекращение обязательств по серии фьючерса

- 5.1. 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;
 - основания, предусмотренные Правилами клиринга (в том числе, уплата неустойки) в случаях неисполнения Участником клиринга обязательств по серии фьючерса, определяемых в соответствии с Правилами торгов, Правилами клиринга и настоящей Спецификацией;
 - иные основания, предусмотренные Правилами клиринга.
- 5.2. Обязательства по серии фьючерса прекращаются в порядке, установленном Правилами клиринга.

Раздел 6. Порядок исполнения

- 6.1. Исполнение серии фьючерса осуществляется 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 последнего дня торгов данной серией фьючерса включительно и заключения Участниками поставки от своего имени Договоров поставки на условиях и в порядке, установленных настоящей Спецификацией, Правилами торгов и Внутренними документами Клиринговой организации.

Раздел 7. Поставочная партия

- 7.1. Поставка базисного актива осуществляется поставочными партиями за исключением случаев адресного определения сторон по Договорам поставки, осуществляемого в соответствии с Правилами торгов.

Раздел 8. Цена фьючерса¹

- 8.1. Цена фьючерса устанавливается в долларах США за один баррель базисного актива.
- 8.2. Минимальное изменение цены фьючерса и стоимостная оценка минимального изменения цены фьючерса определяется решением Президента в соответствии с пунктом 1.3 настоящей Спецификации.
- 8.3. Цена фьючерса может иметь значения, кратные минимальному изменению цены.

Раздел 9. Расчетная (котировальная) цена

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

Раздел 10. Окончательная расчетная цена

- 10.1. Окончательной расчетной ценой для серии фьючерса является расчетная цена, установленная в последний Торговый день для данной серии фьючерса.

Раздел 11. Лимит изменения цены

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

Раздел 12. Лимит на долю рынка

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

¹ Денежные обязательства по фьючерсному контракту подлежат оплате в рублях в сумме, эквивалентной размеру обязательства, определенному в соответствии с Внутренними документами клиринговой организации. Подлежащая уплате в рублях сумма определяется по курсу доллара США к российскому рублю, определенному в соответствии с Правилами клиринга с учетом ограничения на колебание курса доллара США, установленного решением Клиринговой организации и опубликованного на сайте Клиринговой организации в сети Интернет (и справочно на сайте Биржи). В случае если значение курса доллара США оказывается ниже/выше границ указанного ограничения, то значение курса доллара США считается равным значению нижней/верхней границы указанного ограничения соответственно.

Раздел 13. Сборы

- 13.1. 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 14. Депозитная маржа

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

Раздел 15. Вариационная маржа

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

Раздел 16. Порядок заключения Договоров и Договоров поставки

- 16.1. Порядок заключения Договоров и Договоров поставки регламентируется Правилами торгов.

Раздел 17. Ответственность сторон за неисполнение обязательств по фьючерсному контракту

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

Раздел 18. Последствия внесения изменений и дополнений в Спецификацию

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