

УТВЕРЖДЕНА

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

16.03.2020 (Приказ №129/20)

Президент АО «СПБМТСБ»

А.Э. Рыбников

Спецификация

расчетных фьючерсных контрактов
на поставочный фьючерсный контракт на нефтепродукты

Редакция №01

СЕКЦИЯ СРОЧНОГО РЫНКА АО «СПБМТСБ»

Раздел 1. Термины

1.1. Термины, специально не определенные в:

- настоящей Спецификации расчетных фьючерсных контрактов на поставочный фьючерсный контракт на нефтепродукты (далее – Спецификация);
- Правилах проведения организованных торгов в Секции срочного рынка Акционерного общества «Санкт-Петербургская Международная Товарно-сырьевая Биржа» (далее – Правила торгов);
- Правилах осуществления клиринговой деятельности Акционерного общества «Расчетно-депозитарная компания» на срочном рынке АО «СПБМТСБ» (далее – Правила клиринга);

используются в значениях, установленных законами, нормативными актами Банка России и иными нормативными правовыми актами Российской Федерации.

Раздел 2. Общие положения

- 2.1. Настоящая Спецификация определяет качественные и количественные характеристики, а также стандартные условия Договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, базисными активами которых являются поставочные фьючерсные контракты на нефтепродукты, допущенные к торгам в Секции срочного рынка АО «СПБМТСБ» (далее – фьючерс, фьючерсный контракт).
- 2.2. Спецификация совместно с Правилами клиринга и Правилами торгов определяют порядок возникновения, изменения, прекращения и исполнения обязательств, возникающих по заключаемым Договорам.
- 2.3. Параметры расчетных фьючерсных контрактов, определенные настоящей Спецификацией (далее – Параметры), утверждаются Президентом или лицом его замещающим. К таким параметрам относятся:
- наименование фьючерсного контракта;
 - код базисного актива (код типа поставочного фьючерсного контракта на нефтепродукты);
 - наименование базисного актива (наименование типа поставочного фьючерсного контракта на нефтепродукты);
 - минимальное изменение цены;
 - стоимостная оценка минимального изменения цены.
- 2.4. Параметры, утвержденные в соответствии с пунктом 2.3 настоящего Раздела Спецификации, раскрываются путем размещения на официальном сайте Биржи в сети Интернет.
- 2.5. Параметры, утвержденные в соответствии с пунктом 2.3 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 2.4 настоящего Раздела Спецификации.

- 2.6. Все приложения к Спецификации являются ее неотъемлемой частью.

Раздел 3. Код фьючерса

- 3.1. Присвоение кода фьючерсному контракту определенной серии в СЭТ срочного рынка осуществляется по следующим формулам:

$$S + X \dots X + M + Y,$$

где S – расчетный;

$X \dots X$ – код базисного актива (код типа поставочного фьючерсного контракта на нефтепродукты), определяемый в соответствии с пунктом 2.3 настоящей Спецификации;

M – порядковый номер месяца исполнения серии поставочного фьючерсного контракта на нефтепродукты, являющегося базисным активом фьючерса, с января по сентябрь, для октября, ноября и декабря – «А», «В» и «С» соответственно;

Y – последняя цифра года исполнения серии поставочного фьючерсного контракта на нефтепродукты, являющегося базисным активом фьючерса.

Раздел 4. Базисные активы

- 4.1. Базисными активами фьючерсных контрактов являются поставочные фьючерсные контракты на нефтепродукты, допущенные к торгам в Секции срочного рынка АО «СПБМТСБ».

Раздел 5. Торговые дни и сроки исполнения

- 5.1. Первым Торговым днем серии фьючерса является дата, устанавливаемая решением Президента Биржи, либо лица его замещающего. Решение должно содержать:
- код фьючерсного контракта, содержащий указание на месяц исполнения серии фьючерса;
 - дату первого Торгового дня, в который может быть заключен фьючерсный контракт;
 - теоретическую расчетную цену фьючерсного контракта.
- 5.2. Последний торговый день серии фьючерса с определенным месяцем исполнения совпадает с последним торговым днем серии поставочного фьючерсного контракта на нефтепродукты, являющегося базисным активом фьючерса, если иное не установлено решением Президента Биржи, либо лица его замещающего.

- 5.3. День исполнения серии фьючерса с определенным месяцем исполнения совпадает с последним торговым днем серии поставочного фьючерсного контракта на нефтепродукты, являющегося базисным активом фьючерса, если иное не установлено решением Президента Биржи, либо лица его замещающего.
- 5.4. 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 5.1 и 5.2 настоящего Раздела, если иное не установлено решением Президента Биржи, либо лица его замещающего.

Раздел 6. Прекращение обязательств по серии фьючерса

- 6.1. Основаниями прекращения обязательств по серии фьючерса являются:
- надлежащее исполнение обязательств по серии фьючерса;
 - наличие подлежащих зачету встречных обязательств по одной серии фьючерса, позиции по которым учитываются на одном позиционном регистре;
 - иные основания, предусмотренные Правилами клиринга.
- 6.2. Обязательства по серии фьючерса прекращаются в порядке, установленном Правилами клиринга.

Раздел 7. Порядок исполнения

- 7.1. 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.

Раздел 8. Цена фьючерса

- 8.1. Цена для серии фьючерса указывается в рублях Российской Федерации.
- 8.2. Цена фьючерса может иметь значения, кратные минимальному изменению цены.
- 8.3. Минимальное изменение цены фьючерса и стоимостная оценка минимального изменения цены фьючерса определяется решением Президента в соответствии с пунктом 2.3 настоящей Спецификации.

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 окончательная расчетная цена поставочного фьючерсного контракта на нефтепродукты, являющегося базисным активом данного фьючерса, если окончательная расчетная цена поставочного фьючерсного контракта на нефтепродукты 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.
- 10.2. В случае, если окончательная расчетная цена поставочного фьючерсного контракта на нефтепродукты отличается от расчетной цены, установленной для фьючерса в торговый день, предшествующий последнему торговому дню, более, чем на значение лимита изменения цены, установленного для данного фьючерса на день его исполнения, то окончательная расчетная цена для серии фьючерса определяется в следующем порядке.
- 10.2.1. Если окончательная расчетная цена фьючерса, уменьшенная на значение лимита изменения цены, установленное для данного фьючерса, превышает окончательную расчетную цену поставочного фьючерсного контракта на нефтепродукты, являющегося базисным активом данного фьючерса, то 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.
- 10.2.2. Если окончательная расчетная цена фьючерса, увеличенная на значение лимита изменения цены, установленное для данного фьючерса, меньше окончательной расчетной цены поставочного фьючерсного контракта на нефтепродукты, являющегося базисным активом данного фьючерса, то 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.

Раздел 11. Лимит изменения цены

- 11.1. Лимит изменения цены для серии фьючерса устанавливается в соответствии с Правилами осуществления клиринговой деятельности РДК (АО) на срочном рынке АО «СПБМТСБ».

Раздел 12. Лимит на долю рынка

- 12.1. Лимит на долю рынка для серии фьючерса устанавливается в соответствии с Правилами осуществления клиринговой деятельности РДК (АО) на срочном рынке АО «СПБМТСБ».

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 Правилами осуществления клиринговой деятельности РДК (АО) на срочном рынке АО «СПБМТСБ».
- 14.2. Требования к размеру депозитной маржи для серии фьючерса определяются в соответствии с Правилами осуществления клиринговой деятельности РДК (АО) на срочном рынке АО «СПБМТСБ».

Раздел 15. Вариационная маржа

- 15.1. Порядок определения суммы денежных средств, составляющих вариационную маржу для серии фьючерса, определяется в соответствии с Правилами осуществления клиринговой деятельности РДК (АО) на срочном рынке АО «СПБМТСБ».

Раздел 16. Порядок заключения Договоров

- 16.1. Порядок заключения Договоров регламентируется Правилами торгов.

Раздел 17. Ответственность сторон за неисполнение обязательств по фьючерсному контракту

- 17.1. Ответственность сторон за неисполнение обязательств по фьючерсному контракту устанавливается Правилами осуществления клиринговой деятельности РДК (АО) на срочном рынке АО «СПбМТСБ».

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 Спецификацию определяется Президентом Биржи.