



УТВЕРЖДЕНА

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

07.08.2019 (Приказ № 331)

Президент АО «СПБМТСБ»



А.Э. Рыбников

Спецификация

поставочных фьючерсных контрактов
на нефтепродукты с базовой точкой ценообразования

Редакция №03

СЕКЦИЯ СРОЧНОГО РЫНКА АО «СПБМТСБ»

Раздел 1. Термины

1.1. Термины, специально не определенные в:

- настоящей Спецификации поставочных фьючерсных контрактов на нефтепродукты с базовой точкой ценообразования (далее – Спецификация);
- Правилах проведения организованных торгов в Секции срочного рынка Акционерного общества «Санкт-Петербургская Международная Товарно-сырьевая Биржа» (далее – Правила торгов);
- Правилах проведения организованных торгов в Секции «Нефтепродукты» Акционерного общества «Санкт-Петербургская Международная Товарно-сырьевая Биржа» (далее – Правила торгов в Секции «Нефтепродукты»);
- Спецификации биржевого товара с организацией биржевых торгов на балансовых пунктах (Секция «Нефтепродукты» АО «СПбМТСБ») (далее – Спецификация биржевого товара с организацией биржевых торгов на балансовых пунктах в Секции «Нефтепродукты»);
- Регламенте обмена документами в Секции срочного рынка АО «СПбМТСБ»;
- Техническом регламенте предоставления Отчетных документов в Секции срочного рынка АО «СПбМТСБ»;
- Правилах осуществления клиринговой деятельности Акционерного общества «Расчетно-депозитарная компания» на срочном рынке АО «СПбМТСБ» (далее – Правила клиринга);
- Операционном регламенте осуществления клиринговой деятельности РДК (АО) на срочном рынке АО «СПбМТСБ»,

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 нефтепродукты, допущенные к торгам в Секции «Нефтепродукты» АО «СПбМТСБ» в соответствии со Спецификацией биржевого товара с организацией биржевых торгов на балансовых пунктах в Секции «Нефтепродукты» (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 поставочных фьючерсных контрактов, базисными активами которых являются нефтепродукты, допущенные к торгам в Секции «Нефтепродукты» АО «СПбМТСБ» в соответствии со Спецификацией биржевого товара с организацией биржевых торгов на балансовых пунктах в Секции

«Нефтепродукты» (далее – Параметры), утверждаются Президентом или лицом его замещающим. К таким параметрам относятся:

- наименование фьючерсного контракта;
- код базисного актива;
- наименование базисного актива и его качественные характеристики;
- код базовой точки ценообразования;
- наименование базовой точки ценообразования;
- поставочная партия;
- количество базисного актива по одному фьючерсу;
- минимальное изменение цены;
- стоимостная оценка минимального изменения цены;
- таблица стоимости транспортировки базисного актива от базовой точки ценообразования до всех возможных ж/д станций назначения, находящихся на территории Российской Федерации, на которые может быть осуществлена поставка базисного актива по Договору поставки в Секции «Нефтепродукты», заключаемому во исполнение фьючерсного контракта.

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.

В случае внесения изменений в Параметры в части изменения стоимости транспортировки от базовой точки ценообразования до ж/д станции назначения, указанные Параметры применяются в отношении серий поставочных фьючерсных контрактов на нефтепродукты с базовой точкой ценообразования, торги которыми начались после даты вступления в силу указанных Параметров. В отношении серий поставочных фьючерсных контрактов на нефтепродукты с базовой точкой ценообразования, торги которыми начались до даты вступления в силу указанных Параметров, указанные Параметры применяются, не ранее чем по истечении тридцати дней с даты раскрытия информации о Параметрах в соответствии с пунктом 2.4 настоящего Раздела Спецификации. Дата, с которой Параметры подлежат применению, определяется Президентом Биржи либо лицом его замещающим. В случаях, когда внесение изменений в Параметры не связано с изменением стоимости транспортировки от базовой точки ценообразования до ж/д станции назначения, определение даты вступления в силу Параметров, а также раскрытие информации осуществляется в порядке, предусмотренном абзацем первым настоящего пункта и пунктом 2.4 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:

3.1.1. Для фьючерсных контрактов, исполнение по которым осуществляется путем заключения Договора поставки в Секции «Нефтепродукты» на условиях поставки «франко-вагон станция назначения»:

$$F + D + XXXXX + YY + M + Y,$$

где F – фьючерс;

D – поставочный;

$XXXXX$ – код базисного актива, определяемый в соответствии с пунктом 2.3 настоящей Спецификации;

YY – код базовой точки ценообразования, определяемый в соответствии с пунктом 2.3 настоящей Спецификации;

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

Y – последняя цифра года исполнения серии фьючерса.

3.1.2. Для фьючерсных контрактов, исполнение по которым осуществляется путем заключения Договора поставки в Секции «Нефтепродукты» на условиях поставки «франко-вагон станция назначения с переходом прав собственности на станции отправления»:

$$XXX + YY + M + Y,$$

где XXX – код базисного актива, определяемый в соответствии с пунктом 2.3 настоящей Спецификации;

YY – код базовой точки ценообразования, определяемый в соответствии с пунктом 2.3 настоящей Спецификации;

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

Y – последняя цифра года исполнения серии фьючерса.

Раздел 4. Базисные активы

4.1. Базисными активами фьючерсных контрактов являются нефтепродукты, допущенные к торгам в Секции «Нефтепродукты» АО «СПБМТСБ» в соответствии со Спецификацией биржевого товара с организацией биржевых торгов на балансовых пунктах в Секции «Нефтепродукты» и определенные для фьючерсного контракта в соответствии с пунктом 2.3 настоящей Спецификации.

4.2. Поставка базисного актива осуществляется на основании Договора поставки в Секции «Нефтепродукты», заключаемого во исполнение фьючерсного контракта в отношении биржевого инструмента, определенного в Спецификации биржевого товара с организацией биржевых торгов на балансовых пунктах в Секции «Нефтепродукты».

Перечень биржевых инструментов, в отношении которых могут быть заключены Договоры поставки в Секции «Нефтепродукты» во исполнение фьючерсного контракта, формируется с учетом следующих требований:

- базисом поставки является балансовый пункт «РФ»;
- качественные характеристики базисного актива биржевого инструмента, в отношении которого могут быть заключены Договоры поставки в Секции «Нефтепродукты», соответствуют качественным характеристикам базисного актива фьючерсного контракта, определенным в соответствии с пунктом 2.3 Спецификации;
- условие поставки «франко-вагон станция назначения» или «франко-вагон станция назначения с переходом прав собственности на станции отправления».

Сформированный перечень биржевых инструментов раскрывается на официальном сайте Биржи в сети Интернет в соответствии с Правилами торгов.

Раздел 5. Базовая точка ценообразования

5.1. Базовая точка ценообразования является местом формирования цены фьючерсного контракта и определяется согласно пункту 2.3 настоящей Спецификации как ж/д станция с указанием наименования и кода ЕСР.

Раздел 6. Торговые дни и сроки исполнения

6.1. 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.

6.2. Последним торговым днем серии фьючерса с определенным месяцем исполнения является день, наступающий за два Торговых дня до дня исполнения обязательств по поставке базисного актива для данной серии фьючерса, если иное не установлено решением Президента Биржи, либо лица его замещающего.

6.3. Для фьючерсных контрактов, исполнение по которым осуществляется путем заключения Договора поставки в Секции «Нефтепродукты» на условиях поставки «франко-вагон станция назначения» днем исполнения обязательств по поставке базисного актива для серии фьючерса с определенным месяцем исполнения, исключая декабрь, является определяемый в соответствии с Правилами торгов

в Секции «Нефтепродукты» первый торговый день, следующий за последним Торговым днем месяца исполнения серии фьючерса, если иное не установлено решением Президента Биржи, либо лица его замещающего.

Для серии фьючерса с месяцем исполнения, приходящимся на декабрь, днем исполнения является определяемый в соответствии с Правилами торгов в Секции «Нефтепродукты» первый торговый день, следующий за 20 (двадцатым) числом этого месяца.

- 6.4. Для фьючерсных контрактов, исполнение по которым осуществляется путем заключения Договора поставки в Секции «Нефтепродукты» на условиях поставки «франко-вагон станция назначения с переходом прав собственности на станции отправления» днем исполнения обязательств по поставке базисного актива для серии фьючерса с определенным месяцем исполнения, исключая январь, является определяемый в соответствии с Правилами торгов в Секции «Нефтепродукты» первый Торговый день месяца исполнения серии фьючерса, если иное не установлено решением Президента Биржи, либо лица его замещающего.

Для серии фьючерса с месяцем исполнения, приходящимся на январь, днем исполнения является определяемый в соответствии с Правилами торгов в Секции «Нефтепродукты» первый торговый день, следующий за 20 (двадцатым) числом декабря предыдущего года, если иное не установлено решением Президента Биржи, либо лица его замещающего.

- 6.5. 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 6.1 и 6.2 настоящего Раздела, если иное не установлено решением Президента Биржи, либо лица его замещающего.

Раздел 7. Прекращение обязательств по серии фьючерса

- 7.1. 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;
 - 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.
- 7.2. Обязательства по серии фьючерса прекращаются в порядке, установленном Правилами клиринга.

Раздел 8. Порядок исполнения

- 8.1. 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,
 - заключения Участниками поставки от своего имени Договоров поставки в Секции «Нефтепродукты» в ходе основного режима торгов в Секции «Нефтепродукты» АО «СПБМТСБ» в соответствии с Разделом 14 Правил торгов и на условиях и в порядке, установленных в соответствии с настоящей Спецификацией, Правилами торгов в Секции «Нефтепродукты», Спецификацией биржевого товара с организацией биржевых торгов на балансовых пунктах в Секции «Нефтепродукты», Правилами осуществления клиринговой деятельности РДК (АО) на срочном рынке АО «СПБМТСБ» и Операционным регламентом осуществления клиринговой деятельности РДК (АО) на срочном рынке АО «СПБМТСБ». Перечень биржевых инструментов, с которыми могут быть заключены Договоры поставки в Секции «Нефтепродукты» во исполнение фьючерсного контракта, раскрывается на официальном сайте Биржи в сети Интернет в соответствии с Правилами торгов.

Раздел 9. Поставочная партия

- 9.1. Заключение Договора (Договоров) поставки в Секции «Нефтепродукты» во исполнение обязательств по фьючерсному контракту осуществляется в объеме, кратном размеру поставочной партии кроме случая, определенного в пункте 9.2 настоящей Спецификации.
- 9.2. В соответствии с Правилами торгов Договоры поставки в Секции «Нефтепродукты», заключаемые во исполнение обязательств по фьючерсному контракту, могут быть заключены в объеме, не кратном размеру поставочной партии, если Участники торгов подали встречные заявления о контрагенте по поставке.
- 9.3. Размер поставочной партии определяется в соответствии с пунктом 2.3 настоящей Спецификации.

Раздел 10. Цена фьючерса

- 10.1. Цена для серии фьючерса устанавливается в рублях Российской Федерации за одну тонну базисного актива с учетом налога на добавленную стоимость с точностью до 1 (одного) российского рубля.
- 10.2. Минимальное изменение цены фьючерса и стоимостная оценка минимального изменения цены фьючерса определяется решением Президента в соответствии с пунктом 2.3 настоящей Спецификации.
- 10.3. Цена фьючерса может иметь значения, кратные минимальному изменению цены.

Раздел 11. Расчетная (котировальная) цена

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

Раздел 12. Окончательная расчетная цена

- 12.1. Окончательной расчетной ценой для серии фьючерса является расчетная цена, установленная в последний торговый день для данной серии фьючерса.
- 12.2. На основании окончательной цены фьючерса рассчитывается цена Договора поставки, заключаемого в Секции «Нефтепродукты» во исполнение фьючерсного контракта. Порядок расчета цены Договора поставки определен в Правилах торгов.

Раздел 13. Лимит изменения цены

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

Раздел 14. Лимит на долю рынка

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

Раздел 15. Сборы

- 15.1. 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 16. Депозитная и поставочная маржа

- 16.1. Депозитная и поставочная 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».

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

Раздел 17. Вариационная маржа

- 17.1. 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 18. Порядок заключения Договоров

- 18.1. Порядок заключения Договоров регламентируется Правилами торгов.

Раздел 19. Ответственность сторон за неисполнение обязательств по фьючерсному контракту

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

Раздел 20. Последствия внесения изменений и дополнений в Спецификацию

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