

УТВЕРЖДЕНА

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

20.05.2019 (Приказ № 206)

Президент АО «СПБМТСБ»

 А.Э. Рыбников

Методика

определения расчетных цен фьючерсных контрактов

Редакция №02

СЕКЦИЯ СРОЧНОГО РЫНКА АО «СПБМТСБ»

Раздел 1. Общие положения

- 1.1. Настоящая Методика определения расчетных цен фьючерсных контрактов (далее – Методика) содержит порядок определения расчетных цен для фьючерсных контрактов в случаях, предусмотренных Правилами проведения организованных торгов в Секции срочного рынка Акционерного общества «Санкт-Петербургская Международная Товарно-сырьевая Биржа» (далее – Правила торгов).
- 1.2. Методика, а также изменения и дополнения в Методику утверждаются Президентом Биржи. Дата вступления в силу утвержденного документа определяется по решению Президента Биржи.
- Методика, а также изменения и дополнения в Методику, утвержденные Президентом Биржи, раскрываются на Официальном сайте Биржи в сети Интернет в срок не позднее 3 (трех) рабочих дней до даты вступления утвержденного документа в силу, если иной срок не установлен решением Президента Биржи.
- 1.3. Термины, специально не определенные в настоящей Методике, Правилах торгов, а также во Внутренних документах Биржи, используются в значениях, установленных законами, нормативными актами Банка России и иными нормативными правовыми актами Российской Федерации.

Раздел 2. Порядок определения расчетных цен

- 2.1. В соответствии с Правилами торгов расчетная цена для серии срочных контрактов устанавливается в следующих случаях:
- при определении теоретических расчетных цен для серии срочных контрактов в первые торговые дни (Раздел 3 настоящей Методики);
 - при определении нового значения расчетных цен для серии срочных контрактов. Порядок определения нового значения расчетной цены устанавливается в соответствии с Разделом 4 настоящей Методики для серий срочных контрактов всех типов кроме поставочного фьючерсного контракта на российскую экспортную нефть сорта Юралс-Приморск. Порядок определения нового значения расчетной цены для серий поставочного фьючерсного контракта на российскую экспортную нефть сорта Юралс-Приморск устанавливается в соответствии с Разделом 5 настоящей Методики.

Раздел 3. Определение теоретической цены

- 3.1. Определение теоретических расчетных цен для серии срочных контрактов в первые торговые дни осуществляется в следующем порядке:
1. В первый Торговый день в основном режиме торгов по определенной серии срочных контрактов в качестве расчетной цены, установленной для данной серии срочных контрактов в предыдущий Торговый день, используется теоретическая расчетная цена

срочных контрактов данной серии, которая утверждается Президентом Биржи либо лицом, его замещающим, либо лицом, уполномоченным Президентом Биржи.

2. Решение об определении значения теоретической расчетной цены содержит кодировку серии фьючерсного контракта и значение теоретической расчетной цены, устанавливаемой в дату первого торгового дня серии срочных контрактов.
3. Информация о теоретической расчетной цене серии срочных контрактов раскрывается Участникам торгов в СЭТ срочного рынка в первый торговый день указанной серии срочных контрактов.

Раздел 4. Определение нового значения расчетной цены

4.1. Определение нового значения расчетных цен для серии срочных контрактов осуществляется в следующем порядке:

1. Если расчетная цена для серии срочных контрактов, количество открытых позиций по которым равно нулю, не может быть определена на основании заключенных Договоров и поданных безадресных Заявок, в отношении данной серии срочных контрактов в основном режиме торгов, то необходимость определения нового значения расчетной цены для данной серии срочных контрактов и, в случае наличия такой необходимости, новое значение расчетной цены определяются Биржей.
2. Наличие необходимости определения нового значения расчетной цены возникает в случае расхождения расчетной цены серии срочных контрактов с оценочной стоимостью серии срочных контрактов, рассчитываемой Биржей.
3. При проведении оценки стоимости серии срочных контрактов, а также при определении нового значения расчетной цены может быть использована следующая информация:
 - информация о стоимости, полученная от РДК (АО);
 - информация о стоимости, полученная от Участников торгов;
 - информация о стоимости сопоставимых инструментов на зарубежных и российском рынках.

4.2. Новые значения расчетной цены устанавливаются Биржей путем раскрытия информации о них Участникам торгов в Бюллетене по итогам торгов, направляемом Участником торгов в соответствии с Техническим регламентом и публикуемом на официальном сайте Биржи по адресу <http://spimex.com/markets/derivatives/trades/results/> в день определения нового значения.

Раздел 5. Определение нового значения расчетной цены для поставочного фьючерсного контракта на российскую экспортную нефть сорта Юралс-Приморск

- 5.1. Если расчетная цена серии поставочных фьючерсных контрактов на российскую экспортную нефть сорта Юралс-Приморск, количество открытых позиций по которой равно нулю, не может быть определена на основании заключенных Договоров и поданных безадресных Заявок в отношении данной серии срочных контрактов в основном режиме торгов, то новое значение расчетной цены приравнивается к оценочной стоимости нефти сорта Юралс с поставкой на условиях FOB порт Приморск с месяцем поставки, совпадающим с месяцем поставки этого фьючерсного контракта. Оценочная стоимость нефти сорта Юралс с поставкой на условиях FOB порт Приморск в разбивке по месяцам поставки предоставляется в адрес Биржи информационным агентством Аргус (далее – Аргус) в соответствии с договором, заключенным между Биржей и Аргусом.
- 5.2. Определение нового значения расчетной цены для поставочного фьючерсного контракта на российскую экспортную нефть сорта Юралс-Приморск осуществляется в соответствии с п. 5.1 настоящего Раздела Методики каждый Торговый день, если одновременно выполнены следующие условия:
- необходимая для определения новых значений расчетных цен информация от Аргус предоставлена не ранее чем за 3 (три) календарных дня до даты определения новых значений расчетных цен;
 - если Президентом Биржи либо лицом, его замещающим, либо лицом, уполномоченным Президентом Биржи не принято решение об определении нового значения расчетной цены в порядке, отличном от предусмотренного в п. 5.1 настоящего раздела Методики.
- 5.3. В случае принятия решения об определении нового значения расчетной цены в ином порядке определение такого значения в соответствии с пунктом 5.1 настоящего Раздела Методики не осуществляется. В этом случае определение нового значения расчетной цены для поставочного фьючерсного контракта на российскую экспортную нефть сорта Юралс-Приморск может осуществляться в порядке, предусмотренном в Разделе 4 настоящей Методики.
- 5.4. Новые значения расчетной цены устанавливаются Биржей путем раскрытия информации о них Участникам торгов в Бюллетене по итогам торгов, направляемом Участникам торгов в соответствии с Техническим регламентом и публикуемом на официальном сайте Биржи по адресу <http://spimex.com/markets/derivatives/trades/results/> в день определения нового значения.