

УТВЕРЖДЕНО

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

02 августа 2012 г.

А.Э. РЫБНИКОВ

**СПЕЦИФИКАЦИЯ
ПОСТАВОЧНОГО ФЬЮЧЕРСНОГО КОНТРАКТА
НА ДИЗЕЛЬНОЕ ТОПЛИВО С ПОСТАВКОЙ ЧЕРЕЗ ЗАПРАВОЧНЫЕ КАРТЫ**

Редакция №1

Секция срочного рынка ЗАО «СПБМТСБ»

01. Общие положения

- 01.01. Настоящая Спецификация поставочного фьючерсного контракта на дизельное топливо (далее – Спецификация) устанавливает основные качественные и количественные характеристики фьючерсного контракта на дизельное топливо (далее – фьючерс, фьючерсный контракт) с поставкой через заправочные карты.
- 01.02. Функции Клиринговой организации по биржевому инструменту в соответствии с настоящей Спецификацией выполняет Закрытое акционерное общество «Расчётно-депозитарная компания» (далее – РДК (ЗАО), Клиринговая организация).
- 01.03. Спецификация совместно с Правилами осуществления клиринговой деятельности Закрытого акционерного общества «Расчётно-депозитарная компания» на срочном рынке ЗАО «СПБМТСБ» (далее – Правила клиринга), Правилами биржевой торговли в Секции срочного рынка Закрытого акционерного общества «Санкт-Петербургская Международная Товарно-сырьевая Биржа» (далее – Правила торгов), иными документами, указанными в Спецификации, определяет обязательства по фьючерсному контракту, а также порядок их возникновения, изменения и прекращения.
- 01.04. Все приложения к Спецификации являются ее неотъемлемой частью.

02. Термины и определения

Оператор поставки – организация, осуществляющая учет топлива на субсчетах, выпуск и обслуживание заправочных карт.

Субсчет – счет в системе Оператора поставки, используемый для учета обязательств Оператора поставки перед Участником поставки по поставке базового актива.

Участник поставки – Участник клиринга, на позиционном регистре которого учитываются его позиции по сериям фьючерса, или клиент Участника клиринга, позиции по сериям фьючерса которого учитываются на позиционных регистрах, открытых для учета позиций таких клиентов у Участника клиринга.

Участник поставки-продавец (Поставщик) – Участник поставки, на позиционном регистре, которого учитываются короткие позиции по сериям фьючерса.

Участник поставки-покупатель (Покупатель) – Участник поставки, на позиционном регистре которого учитываются длинные позиции по сериям фьючерса.

Термины, определение которых не приведено в тексте настоящей Спецификации, определяются в соответствии с Правилами торгов, иными внутренними документами ЗАО «СПБМТСБ» (далее – ЗАО «СПБМТСБ», Биржа), регламентирующими деятельность Секции

срочного рынка ЗАО «СПБМТСБ», Правилами клиринга, нормативными документами Оператора поставки, а также в соответствии с законами, нормативными правовыми актами Уполномоченного федерального органа исполнительной власти в области финансовых рынков и иными нормативными правовыми актами Российской Федерации.

03. Код фьючерса

03.01. Фьючерсы в СЭТ кодируются следующим образом: **FDCDDTMOSMG**,

где **F** – фьючерс;

D – поставочный;

CDDT – код базового актива;

MOS – код базиса поставки;

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

G – последняя цифра года исполнения серии фьючерса.

04. Базовый актив

04.01. Базовым активом фьючерса является дизельное топливо, поставляемое по топливным картам Оператора поставки в соответствии с договором, заключенным Участником поставки с Оператором поставки.

04.02. Количество базового актива по одному фьючерсу равно 10 (десяти) литрам.

05. Торговые дни

05.01. Торги биржевым инструментом проводятся в соответствии с Правилами торгов каждый рабочий день, если иное не установлено решением Президента ЗАО «СПБМТСБ».

05.02. Последним торговым днем серии фьючерса с определенным месяцем исполнения является 19 число месяца исполнения. Если данный день не является рабочим днем, то последним торговым днем для серии фьючерса является ближайший следующий рабочий день.

- 05.03. Следующий торговый день после дня исполнения определенной серии фьючерса является первым торговым днем новой серии фьючерса.

06. Сроки исполнения

- 06.01. Допускается обращение серий фьючерса с исполнением в любой календарный месяц года.
- 06.02. Если иное не установлено решением Президента ЗАО «СПБМТСБ», то одновременно проводятся торги сериями фьючерса с днями исполнения, приходящимися на 3 (три) ближайших месяца исполнения и 1 (один) следующий месяц исполнения, приходящийся на конец квартала (март, июнь, сентябрь, декабрь).
- 06.03. Днем проведения торгов в предпоставочном режиме торгов для серии фьючерса является торговый день, следующий за последним торговым днем.

07. Прекращение обязательств по серии фьючерса

- 07.01. 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 клиринга и настоящей Спецификацией;
 - иные основания, предусмотренные Правилами клиринга.
- 07.02. Обязательства по серии фьючерса прекращаются в порядке, установленном Правилами клиринга.

08. Порядок исполнения

- 08.01. Исполнение серии фьючерса осуществляется путем периодической выплаты Участниками клиринга вариационной маржи, начисленной по позициям, открытым по данной серии

фьючерса, в период со дня открытия данных позиций до дня исполнения данной серии фьючерса включительно и заключения Участниками поставки сделок предпоставочного периода на условиях и в порядке, установленных в пункте 23 настоящей Спецификации и иными внутренними документами Биржи.

- 08.02. Порядок определения размера обязательств по поставке/оплате поставки базового актива, порядок исполнения обязательств, а также ответственность сторон за неисполнение обязательств по фьючерсу определяются настоящей Спецификацией и Внутренними документами Клиринговой организации.

09. Поставочная партия

- 09.01. Поставка базового актива осуществляется поставочными партиями.
- 09.02. Поставочная партия устанавливается в размере 1 (одного) фьючерсного контракта, что составляет 10 (десять) литров базового актива.

10. Цена фьючерса

- 10.01. Цена для серии фьючерса устанавливается в рублях Российской Федерации за единицу базового актива (один литр) с учетом налога на добавленную стоимость с точностью до 0,10 (одной десятой) российского рубля.
- 10.02. Минимальное изменение цены для серии фьючерса составляет 0,10 (одну десятую) российского рубля.
- 10.03. Цена фьючерса может иметь значения, кратные минимальному изменению цены.
- 10.04. Стоимостная оценка минимального изменения цены фьючерса равна 1,00 (одному) российскому рублю.

11. Расчетная (котировальная) цена

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

12. Окончательная расчетная цена

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

13. Лимит изменения цены

- 13.01. Лимит изменения цены для серии фьючерса устанавливается в соответствии с внутренними документами Клиринговой организации.

14. Лимит на долю рынка

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

15. Сборы

- 15.01. Виды, порядок расчета и оплаты биржевых сборов для серии фьючерса устанавливаются в соответствии с Правилами торгов и внутренними документами Клиринговой организации.

16. Депозитная маржа

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

17. Вариационная маржа

- 17.01. Размер вариационной маржи для серии фьючерса определяется в соответствии с внутренними документами Клиринговой организации.

18. Поставочная маржа

- 18.01. Поставочная маржа является специальным возвратным взносом Участника клиринга, служащим обеспечением исполнения обязательств по поставке базового актива/оплате поставки. В случае неисполнения Участниками поставки указанных обязательств, из состава поставочной маржи Участника клиринга, являющегося Участником поставки, либо обслуживающего Клиента, являющегося Участником поставки, удерживается неустойка в соответствии с внутренними документами Клиринговой организации и Договором поставки.
- 18.02. Требования к размеру поставочной маржи для серии фьючерса определяются в соответствии с внутренними документами Клиринговой организации.

19. Порядок заключения сделок

- 19.01. Порядок заключения сделок регламентируется Правилами торгов.

20. Ответственность сторон за неисполнение обязательств по фьючерсному контракту

- 20.01. Ответственность сторон за неисполнения обязательств по фьючерсному контракту устанавливается внутренними документами Клиринговой организации.

21. Последствия внесения изменений и дополнений в Спецификацию

- 21.01. Внесение изменений и дополнений в Спецификации срочных контрактов регламентируется Правилами торгов. Порядок действий в случае внесения изменений и дополнений в Спецификацию определяется Президентом Биржи.

22. Исполнение серии фьючерсного контракта

- 22.01. Серия фьючерса исполняется путем заключения сделок в предпоставочном режиме торгов. Торги в предпоставочном режиме проводятся в период времени, определенный Правилами торгов.
- 22.02. В предпоставочном режиме проводятся торги в рамках торгового периода «Предпоставочная торговая сессия», в ходе которого на Бирже осуществляется регистрация заявок на исполнение от Участников поставки, допущенных к подаче заявок в данном торговом периоде. Биржа осуществляет допуск Участников поставки к подаче заявок в торговом периоде «Предпоставочная торговая сессия» на основании информации от Клиринговой организации о выполнении условий такого допуска, установленных внутренними документами Клиринговой организации и Биржи. После завершения сбора заявок на исполнение, подаваемых Участниками поставки и принятых Биржей, по результатам проведения торгов в торговом периоде «Предпоставочная торговая сессия» заключаются сделки предпоставочного периода.
- 22.03. Подача заявок на исполнение осуществляется по чистым позициям, определенным на момент окончания торгов в последний торговый день по серии фьючерсов отдельно по каждому из позиционных регистров, открытых для учета позиций каждого Участника поставки (далее – поставочные позиции Участника поставки) в порядке, установленном Правилами торгов и внутренними документами Клиринговой организации.
- 22.04. Подача Участником торгов заявки на исполнение в ходе торгового периода «Предпоставочная торговая сессия» в СЭТ означает его безусловное согласие заключить сделку на условиях, указанных в заявке на исполнение фьючерса и в соответствии с правилами ее исполнения, определяемыми Правилами торгов.
- 22.05. Параметры заявок на исполнение, поданных в ходе торгового периода «Предпоставочная торговая сессия», устанавливаются Правилами торгов.

- 22.06. Порядок формирования, подачи и снятия заявок на исполнение, поданных в ходе торгового периода «Предпоставочная торговая сессия», а также изменения их параметров определяется Правилами торгов.
- 22.07. Правила исполнения заявок, поданных в ходе торгового периода «Предпоставочная торговая сессия», определяются в Правилах торгов.
- 22.08. В случае если после завершения приема заявок на исполнение в первом торговом периоде «Предпоставочная торговая сессия» имеется неравенство суммарного количества позиций, по которым Участниками торгов поданы заявки на исполнение путем осуществления поставки, с суммарным количеством позиций, по которым Участниками торгов поданы заявки на исполнение путем оплаты поставки, (далее – дисбаланс заявок на исполнение) Биржа проводит в предпоставочном режиме торги в рамках торгового периода «Специальная торговая сессия» в целях заключения сделок с Гарантирующими покупателями / Гарантирующими поставщиками» с привлечением Участников торгов, являющихся Гарантирующими покупателями / Гарантирующими поставщиками. Целью торгов в торговом периоде «Специальная торговая сессия» является заключение срочных контрактов на объем дисбаланса заявок на исполнение с целью последующего устранения или уменьшения этого дисбаланса.
- 22.09. Параметры заявок, поданных в ходе торгового периода «Специальная торговая сессия», устанавливаются Правилами торгов.
- 22.10. Порядок формирования, подачи и снятия заявок, поданных в ходе торгового периода «Специальная торговая сессия», а также изменения их параметров определяются Правилами торгов.
- 22.11. Правила исполнения заявок, поданных в ходе торгового периода «Специальная торговая сессия», определяются в Правилах торгов.
- 22.12. Сделки по результатам проведения торгов в рамках торгового периода «Специальная торговая сессия» заключаются после завершения сбора заявок, подаваемых Гарантирующими покупателями / Гарантирующими поставщиками.
- 22.13. В случае заключения сделок в рамках торгового периода «Специальная торговая сессия» Биржа проводит в предпоставочном режиме торги в рамках второго торгового периода «Предпоставочная торговая сессия». Целью проведения торгов в рамках второго торгового периода «Предпоставочная торговая сессия» является подача заявок на исполнение по позициям, открытым по итогам торгового периода «Специальная торговая сессия».
- 22.14. По окончании торгового периода «Предпоставочная торговая сессия» регистрация заявок на исполнение заканчивается, и заключаются сделки предпоставочного периода.

- 22.15. Сделки предпоставочного периода заключаются в соответствии с принципом минимизации количества пар по поставке. Объем базового актива, подлежащий физической поставке, определяется как минимум из суммарного объема заявок на поставку и суммарного объема заявок на оплату поставки.
- 22.16. На основании информации, полученной от Биржи, о заключенных сделках предпоставочного периода Клиринговая организация проводит клиринговую сессию, в результате которой поставочные позиции Участников поставки закрываются в порядке, предусмотренном внутренними документами Клиринговой организации.

23. Поставка базового актива по сделке предпоставочного периода

- 23.01. Участник поставки-покупатель до начала предпоставочной торговой сессии обязан в порядке, предусмотренном внутренними документами Клиринговой организации, обеспечить наличие денежных средств на расчетном счете Клиринговой организации в одном из расчетных банков. Размер денежных средств должен быть не менее суммы денежного обязательства по оплате поставки (включая НДС) базового актива по чистым позициям, определенным на момент окончания торгов в последний торговый день по серии фьючерсов отдельно по каждому из позиционных регистров, открытых для учета позиций Участника поставки.
- 23.02. Участник поставки-продавец до начала предпоставочной торговой сессии обязан в порядке, предусмотренном внутренними документами Клиринговой организации, обеспечить наличие базового актива на субсчете, открытом у Оператора-поставки. Количество базового актива должно быть не менее объема обязательств по поставке базового актива по чистым позициям, определенным на момент окончания торгов в последний торговый день по серии фьючерсов отдельно по каждому из позиционных регистров, открытых для учета позиций Участника поставки.
- 23.03. В результате проведения клиринговой сессии во исполнение обязательств по поставке/оплате поставке по каждой сделке предпоставочного периода производится:
- перечисление денежных средств в адрес Участника поставки-продавца в размере исполненных им обязательств по поставке базового актива;
 - проведение операции по субсчетам Участников поставки, в результате которой остаток на субсчете Участника поставки-продавца/ Участника поставки-покупателя уменьшается / увеличивается на количество базового актива в размере его обязательств по сделке предпоставочного периода.

его перевода с субсчета Участника поставки-продавца на субсчет Участника поставки-покупателя.

- 23.04. В случае выполнения Участником поставки обязательств по оплате поставки/поставке в соответствии с пунктом 23.01 настоящей Спецификации, Клиринговая организация не позднее рабочего дня, следующего за датой заключения сделки предпоставочного периода, осуществляет возврат поставочной маржи Участника поставки по этой сделке предпоставочного периода.
- 23.05. В случае невыполнения Участником поставки обязательств по оплате поставки/поставке в соответствии с пунктом 23.01 настоящей Спецификации, с него удерживается неустойка в размере, определяемом внутренними документами Клиринговой организации. При уплате неустойки обязательства сторон по сделке предпоставочного периода прекращаются. При этом Клиринговая организация не позднее рабочего дня, следующего за датой заключения сделки предпоставочного периода, осуществляет возврат поставочной маржи Участнику поставки в порядке, предусмотренном Правилами клиринга.

24. Расчеты по поставке

- 24.01. Расчеты по поставке проводятся в соответствии с внутренними документами Клиринговой организации.

25. Порядок обмена документами

- 25.01. Если иное не установлено настоящей Спецификацией, внутренними документами Биржи или Клиринговой организации, формат и реквизиты документов, предоставляемых в соответствии с настоящей Спецификацией, а также порядок их предоставления устанавливается «Регламентом обмена документами», утверждаемым Президентом Биржи.