**УТВЕРЖДЕНО**

Приказом Публичного акционерного общества «Московская Биржа ММВБ-РТС»

(Приказ № МБ-П-2021-3490 от «29» ноября 2021 г.)

**СПЕЦИФИКАЦИЯ**

**ПОСТАВОЧНЫХ ФЬЮЧЕРСНЫХ КОНТРАКТОВ**

**на пшеницу**

Настоящая Спецификация поставочных фьючерсных контрактов на пшеницу (далее – Спецификация) определяет стандартные условия поставочных фьючерсных контрактов на пшеницу.

Спецификация совместно с правилами, регулирующими порядок оказания клиринговых услуг на Срочном рынке ПАО Московская Биржа (далее – Правила клиринга), правилами, регулирующими порядок проведения торгов на Срочном рынке ПАО Московская Биржа (далее – Правила торгов), определяет порядок возникновения, изменения и прекращения обязательств по поставочным фьючерсным контрактам на пшеницу (далее – Контракт, Контракты).

ПАО Московская Биржа (далее – Биржа) утверждает Список параметров фьючерсных контрактов на пшеницу (далее – Список параметров), который содержит:

* наименование Контракта;
* код базисного актива;
* базисный актив Контракта;
* основная характеристика базисного актива;
* базисы поставки;
* коды базисов;
* лот Контракта;
* минимальное изменение цены Контракта в ходе Торгов (далее – минимальный шаг цены);
* стоимость минимального шага цены;
* минимальная поставочная партия;
* размер скидок/надбавок к расчетной цене контракта за качество базисного актива (в случае их установления Биржей);
* размер скидок/надбавок к расчетной цене контракта за базис поставки (в случае их установления Биржей).

Базисным активом Контрактов, условия и параметры которых определяются в настоящей Спецификации и в Списке параметров, является пшеница с качественными характеристиками, указанными в Списке параметров.

Термины и определения, прямо не определенные в Спецификации, понимаются в соответствии с законодательством Российской Федерации, Правилами торгов, Правилами клиринга.

1. Заключение Контракта
	1. Возможность заключения Контракта на Торгах устанавливается решением Биржи, которое должно содержать:
* код (обозначение) Контракта;
* дату первого Торгового дня, в который может быть заключен Контракт (далее – первый день заключения Контракта);
* время, начиная с которого может быть заключен Контракт (момент начала Торгов Контрактом).
	1. Код (обозначение) Контракта формируется по следующим правилам:

XXXX (код базисного актива)-<месяц исполнения>.<год исполнения>, или

XXX (код базисного актива)-<месяц исполнения>.<год исполнения>, или

XX (код базисного актива)-<месяц исполнения>.<год исполнения>.

Код базисного актива определяется согласно Списку параметров.

Месяц и год исполнения в коде (обозначении) Контракта (далее – месяц и год исполнения Контракта соответственно) указываются арабскими цифрами и используются для определения последнего Торгового дня, в ходе которого может быть заключен Контракт (далее – последний день заключения Контракта) и дня исполнения Контракта.

* 1. Цена Контракта в ходе Торгов при подаче заявки и заключении Контракта указывается в рублях за 1 (одну) тонну (без учета налога на добавленную стоимость (далее – НДС)).
	2. Последним днем заключения Контракта является 10-е (десятое) число месяца и года исполнения Контракта, а в случае, если 10-й (десятый) день месяца и года исполнения Контракта не является Торговым днем – следующий Торговый день за 10-ым (десятым) числом месяца и года исполнения Контракта. Заключение Контракта в последний день заключения Контракта допускается до момента приостановки Торгов в целях проведения дневной клиринговой сессии в соответствии с Правилами торгов.

Биржа вправе по согласованию с Клиринговым центром установить иную дату последнего дня заключения Контракта, отличную от определяемой в соответствии с настоящим пунктом.

* 1. Днем исполнения Контракта является первый день, следующий за последним днем заключения Контракта[[1]](#footnote-1), в который АО НТБ проводит организованные торги на спот-рынке АО НТБ, за исключением случаев, предусмотренных пунктами 5.1. – 5.2. Спецификации.
1. Обязательства по Контракту
	1. Обязательство по уплате вариационной маржи.
		1. Стороны Контракта обязаны уплачивать друг другу денежные средства (вариационную маржу) в сумме, размер которой зависит от изменения цены базисного актива.
		2. Вариационная маржа рассчитывается и уплачивается в период с первого дня заключения Контракта до последнего дня заключения Контракта включительно.
		3. Вариационная маржа рассчитывается по следующим формулам:
			1. В ходе дневной клиринговой сессии:
2. Если расчет вариационной маржи по Контракту ранее не осуществлялся:

**ВМ1 = Round (РЦ1\*Round (W1/R;5);2) – Round (Цо\*Round (W1/R;5);2)**

где:

ВМ1 – вариационная маржа по Контракту, рассчитанная в ходе дневной клиринговой сессии текущего Торгового дня;

Round – функция математического округления с заданной точностью;

Цо – цена заключения Контракта;

РЦ1 – текущая (последняя) Расчетная цена Контракта;

W1 – стоимость минимального шага цены;

R – минимальный шаг цены.

1. Если расчет вариационной маржи по Контракту осуществлялся ранее:

**ВМ1 = Round (РЦ1\*Round (W1/R;5);2) – Round (РЦп\*Round (W1/R;5);2)** где:

ВМ1 – вариационная маржа по Контракту, рассчитанная в ходе дневной клиринговой сессии текущего Торгового дня;

Round – функция математического округления с заданной точностью;

РЦ1 – текущая (последняя) Расчетная цена Контракта;

РЦп – Расчетная цена Контракта,определенная по итогам вечернего Расчетного периода предыдущего Торгового дня;

W1 – стоимость минимального шага цены;

R – минимальный шаг цены.

* + - 1. В ходе вечерней клиринговой сессии:
1. Если расчет вариационной маржи по Контракту ранее не осуществлялся:

**ВМ2 = Round (РЦ2\*Round (W2/R;5);2) – Round (Цо\*Round (W2/R;5);2)**

где:

ВМ2 – вариационная маржа по Контракту, рассчитанная в ходе вечерней клиринговой сессии за вечерний Расчетный период текущего Торгового дня;

Round – функция математического округления с заданной точностью;

Цо – цена заключения Контракта;

РЦ2 – текущая (последняя) Расчетная цена Контракта;

W2 – стоимость минимального шага цены;

R – минимальный шаг цены.

1. Если расчет вариационной маржи по Контракту осуществлялся в ходе дневной клиринговой сессии текущего Торгового дня:

**ВМ2 = ВМ – ВМ1**

где:

ВМ2 – вариационная маржа по Контракту, рассчитанная в ходе вечерней клиринговой сессии за вечерний Расчетный период текущего Торгового дня;

ВМ – вариационная маржа по Контракту, рассчитанная в ходе вечерней клиринговой сессии за текущий Торговый день;

ВМ1 – вариационная маржа по Контракту, рассчитанная в ходе дневной клиринговой сессии текущего Торгового дня в соответствии с подпунктом 2.1.3.1 Спецификации.

При этом величина ВМ рассчитывается по следующим формулам:

1. Если расчет вариационной маржи по Контракту в ходе вечерней клиринговой сессии за предыдущий Торговый день не осуществлялся:

**ВМ = Round (РЦ2\*Round (W2/R;5);2) – Round (Цо\*Round (W2/R;5);2)**

где:

Round – функция математического округления с заданной точностью;

РЦ2 – текущая (последняя) Расчетная цена Контракта;

Цо – цена заключения Контракта;

W2 – стоимость минимального шага цены;

R – минимальный шаг цены.

1. Если расчет вариационной маржи по Контракту в ходе вечерней клиринговой сессии за предыдущий Торговый день осуществлялся:

**ВМ = Round (РЦ2\*Round (W2/R;5);2) – Round (РЦп\*Round (W2/R;5);2)**

где:

Round – функция математического округления с заданной точностью;

РЦ2 – текущая (последняя) Расчетная цена Контракта;

РЦп – Расчетная цена Контракта,определенная по итогам вечернего Расчетного периода предыдущего Торгового дня;

W2 – стоимость минимального шага цены;

R – минимальный шаг цены.

* + 1. Вариационная маржа по Контракту, рассчитанная по формулам, указанным в пункте 2.1.3. Спецификации, округляется с точностью до копеек по правилам математического округления.
		2. Расчетная цена Контракта определяется Биржей в порядке и сроки, установленные Правилами торгов и Спецификацией.
		3. Исполнение обязательств по уплате вариационной маржи осуществляется в порядке и сроки, установленные Правилами клиринга. При этом:
* если вариационная маржа положительна – обязательства по уплате вариационной маржи в сумме, равной абсолютной величине рассчитанной вариационной маржи, возникает у Продавца;
* если вариационная маржа отрицательна – обязательства по уплате вариационной маржи в сумме, равной абсолютной величине рассчитанной вариационной маржи, возникает у Покупателя.
	1. Обязательство по поставке.
		1. В день исполнения Контракта во исполнение обязательств по Контракту Участник торгов АО НТБ, идентификационные данные которого указаны Покупателем при открытии раздела регистра учета позиций, на котором учитывается позиция на покупку по поставочным фьючерсным контрактам на пшеницу, а именно: Покупатель или лицо, в интересах которого Покупатель заключил Контракт, обязан купить, а Участник торгов АО НТБ, идентификационные данные которого указаны Продавцом при открытии раздела регистра учета позиций, на котором учитывается позиция на продажу по поставочным фьючерсным контрактам на пшеницу, а именно: Продавец или лицо, в интересах которого Продавец заключил Контракт, обязан продать пшеницу, являющуюся базисным активом Контракта, в количестве, определяемом в соответствии со Спецификацией и Правилами клиринга, путем подачи заявки и заключения договора купли-продажи на спот-рынке АО НТБ с соответствующим базисом поставки и качеством товара, указанным в Списке параметров и указанным Продавцом в уведомлении о намерении поставки в адрес НКО НКЦ (АО). Подача заявки (заявок) и заключение договора (договоров) купли-продажи в целях исполнения Обязательств по поставке осуществляется в порядке, предусмотренном Правилами организованных торгов сельскохозяйственной продукцией и иными товарами на спот-рынке АО НТБ и Правилами клиринга НКО АО НРД. Цена договора купли-продажи пшеницы состоит из цены, равной Расчетной цене Контракта, определенной по итогам дневного Расчетного периода последнего дня заключения Контракта, уменьшенная/увеличенная на размер скидки/надбавки за качество и/или размер скидки/надбавки за Базис поставки, установленные Списком параметров и суммы НДС по ставке, предусмотренной действующим законодательством Российской Федерации, в случае, если Участник торгов АО НТБ, являющийся продавцом по договору купли-продажи пшеницы, является плательщиком НДС. Определение покупателей и продавцов, являющихся сторонами по сделке купли-продажи пшеницы, количества и качества товара, а также базиса поставки в сделке купли-продажи пшеницы, осуществляется НКО НКЦ (АО) в порядке, предусмотренном Правилами клиринга.
		2. Объем позиции по Контракту в товаре соответствующего качества для подачи заявки и заключения договора купли-продажи на спот-рынке АО НТБ во исполнение обязательств по Контракту должен быть в объеме больше либо равным минимальной поставочной партии одного качества на одном Базисе поставке, определенных в Списке параметров.
		3. Порядок и сроки исполнения Обязательств по поставке по договорам купли-продажи на спот-рынке АО НТБ регламентируются Правилами допуска к участию в организованных торгах сельскохозяйственной продукцией и иными товарами на спот-рынке АО НТБ, Правилами организованных торгов сельскохозяйственной продукцией и иными товарами на спот-рынке АО НТБ, Правилами клиринга НКО АО НРД, условиями договора купли-продажи на спот-рынке АО НТБ.
1. Основания и порядок прекращения обязательств по Контракту
	1. Обязательства по Контракту полностью прекращаются их надлежащим исполнением.
	2. Обязательства стороны по Контракту полностью прекращаются в результате возникновения у этой стороны встречных обязательств по Контракту с тем же кодом (обозначением), то есть возникновения у Продавца обязательств Покупателя или у Покупателя – обязательств Продавца, в порядке и сроки, предусмотренные Правилами клиринга.
	3. Обязательства стороны по Контракту полностью прекращаются по основаниям, предусмотренным Правилами клиринга, в том числе в случае неисполнения Участником клиринга обязательств по Контракту, определенных в соответствии с Правилами торгов и Правилами клиринга (в том числе, в результате уплаты неустойки).
	4. Обязательства по Контракту полностью прекращаются, если Обязательства по поставке одновременно на покупку и продажу возникли у одного и того же лица в соответствии с кодом этого лица, присвоенных АО НТБ, в порядке, предусмотренном Правилами клиринга.
	5. Обязательства по Контракту могут быть прекращены по иным основаниям, указанным в Правилах клиринга, в установленном ими порядке.
2. Ответственность сторон за неисполнение обязательств по Контракту
	1. Стороны несут ответственность за неисполнение или ненадлежащее исполнение обязательств по Контракту в соответствии с законодательством Российской Федерации, Правилами торгов и Правилами клиринга.
3. Особые условия
	1. В случае приостановления/прекращения заключения Контракта на Торгах, приостановления торгов на спот-рынке АО НТБ, Биржа вправе по согласованию с Клиринговым центром принять одно или несколько из следующих решений:
		1. об изменении даты последнего дня заключения Контракта;
		2. об изменении даты дня исполнения Контракта;
		3. о прекращении Обязательства по поставке;
		4. об изменении текущей (последней) Расчетной цены и (или) определении порядка расчета и перечисления вариационной маржи;
		5. принять иные решения, предусмотренные Правилами торгов.
	2. Биржа вправе по согласованию с Клиринговым центром изменить дату последнего дня заключения и (или) дату дня исполнения Контракта с определенным кодом, если в течение срока действия указанного Контракта в соответствии с решением государственного органа Российской Федерации последний день заключения Контракта объявлен нерабочим днем.
	3. Информация о решении (решениях), принятом (принятых) Биржей в соответствии с пунктом 5.1 и (или) 5.2 Спецификации, доводится до сведения Участников торгов путем ее опубликования на сайте Биржи в сети Интернет не менее чем за 3 (три) Торговых дня до вступления в силу соответствующего решения (решений). В случае наступления оснований для принятия решений, предусмотренных пунктами 5.1. и (или) 5.2. Спецификации, менее чем за 3 (три) Торговых дня до последнего дня заключения Контракта, информация о таком решении (решениях), принятом (принятых) Биржей, доводится до сведения Участников торгов путем ее опубликования на сайте Биржи в сети Интернет не позднее вступления в силу соответствующих решений.
	4. Биржа вправе принять решение о включении в Список параметров базисов поставки спот-рынка АО НТБ, базисы которых не предусмотрены в Списке параметров (далее – дополнение базисов поставки), а также об исключении базисов поставки спот-рынка АО НТБ, базисы которых указаны в Списке параметров (далее – исключение базисов поставки) при соблюдении следующих условий:
		1. дополнение/исключение базиса поставки осуществляется не чаще 1 (одного) раза в месяц;
		2. дополнение/исключение базиса поставки осуществляется не позднее, чем за 30 (тридцать) календарных дней до последнего дня заключения Контракта;
		3. информация о принятом в соответствии с настоящим пунктом решении доводится Биржей до сведения Участников торгов путем опубликования на сайте Биржи в сети Интернет не менее чем за 1 (один) Торговый день до дополнения/исключения базисов поставки.
	5. Если иное не предусмотрено решением Биржи, с момента вступления в силу решения (решений), принятого (принятых) Биржей в соответствии с пунктом 5.1, 5.2, 5.4 Спецификации, условия существующих обязательств по ранее заключенным Контрактам считаются измененными с учетом указанного решения (решений).
4. Внесение изменений и дополнений в Спецификацию
	1. Биржа вправе по согласованию с Клиринговым центром внести изменения и дополнения в Спецификацию.
	2. Изменения и дополнения в Спецификацию вступают в силу с момента введения Биржей в действие Спецификации, содержащей указанные изменения и дополнения.
	3. Информация о введении в действие Спецификации, содержащей изменения и дополнения, доводится Биржей до сведения Участников торгов путем опубликования на сайте Биржи в сети Интернет не менее чем за 3 (три) рабочих дня до введения ее в действие.
	4. Если иное не предусмотрено решением Биржи, с момента вступления в силу изменений и дополнений в Спецификацию условия существующих обязательств по ранее заключенным Контрактам считаются измененными с учетом таких изменений и дополнений.
1. 1 Публикация списка дат, являющихся последними днями заключения и днями исполнения Контрактов на ближайший календарный год, осуществляется на сайте Биржи в сети Интернет. [↑](#footnote-ref-1)