

УТВЕРЖДЕНА

Правлением АО НТБ
от 12.11.2024, Протокол № 383

Директор АО НТБ

_____ С.А. Наумов

**МЕТОДИКА
РАСЧЕТА БИРЖЕВОГО ИНДЕКСА САХАРА В ЮФО**

АО НТБ, 2024

1. Термины и определения:

Биржа – Акционерное общество «Национальная товарная биржа» или АО НТБ.

ЮФО – Южный федеральный округ Российской Федерации.

Товар – Сахар белый кристаллический категории ТС2, упакованный в мешки емкостью по 50 кг.

Индекс – биржевой индекс сахара на условиях самовывоза с Базиса в ЮФО, краткий код – *SUGSOU*.

Базисы – перечень биржевых базисов поставки на спот-рынке АО НТБ в ЮФО, входящих в Перечень Базисов на организованных торгах товарами на спот-рынке АО НТБ, опубликованный на официальном сайте Биржи в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» www.namex.org.

Лучшие встречные заявки на Базисах - лучшая заявка на продажу и лучшая заявка на покупку на каждом из Базисов (лучшая заявка на продажу – заявка продавца с минимальной ценой, лучшая заявка на покупку – заявка покупателя с максимальной ценой).

Методика – настоящая Методика расчета биржевого индекса сахара с условием поставки - самовывоз с Базиса в ЮФО.

Спот-рынок АО НТБ - организованные торги товарами на спот-рынке Акционерного общества «Национальная товарная биржа».

Экспертный совет - Экспертный совет по индексам рынка агропродукции, являющийся действующим на постоянной основе консультативно-совещательным органом Биржи, в задачи которого входит разработка предложений в части совершенствования методик расчета ценовых индексов и раскрытия информации о ценовых индексах.

2. Общие положения

2.1. Методика определяет порядок расчёта Индекса, отражающего рассчитываемую Биржей стоимость тонны Товара с поставкой на условиях самовывоза с Базиса в ЮФО по итогам договоров, заключенных в ходе торгов на спот-рынке АО НТБ, а также с использованием заявок в соответствии с п.4.2 Методики.

2.2. Расчет Индекса осуществляется каждый торговый день. Здесь и далее по тексту Методики под торговыми днями понимаются дни, в которые Биржа проводит организованные торги на спот-рынке АО НТБ.

2.3. В случае если в торговый день торги Товаром на спот-рынке АО НТБ на Базисах в ЮФО не проводились или отсутствуют заключенные договоры, отвечающие условиям, приведенным в разделе 3 настоящей Методики, или торги проводились, но совокупный объем всех сделок на всех Базисах составил менее величины, указанной в Приложении 1, а также прошло более 5 торговых дней подряд с начала расчета Индекса в соответствии с п. 4.2 Методики, то значение Индекса считается неустановленным.

2.4. Настоящая Методика, а также изменения и дополнения к ней разрабатываются с учетом рекомендаций Экспертного совета. Методика, а также все изменения и

дополнения в Методику утверждаются Биржей и вступают в силу в дату, определяемую Биржей.

- 2.5. Термины и определения, используемые в Методике, применяются в значениях, указанных в пункте 1 Методики, а также установленных внутренними документами Биржи и действующими нормативными правовыми актами Российской Федерации.
- 2.6. Биржа производит пересмотр настоящей Методики не реже раза в год, и, при необходимости, по результатам пересмотра в Методику вносятся изменения.

3. Исходные данные

- 3.1. В расчете Индекса учитываются только договоры и заявки с объемом не менее величины, указанной в п.1 Приложения 1 к Методике.
- 3.2. В расчете Индекса участвуют договоры с Товаром, заключенные на Базисах по результатам торгов на спот-рынке АО НТБ при условии, что в день расчета Индекса совокупный объем всех договоров на всех Базисах составил не менее величины, указанной в п.2 Приложения 1 к Методике.
- 3.3. Договоры, цены которых отклоняются от предыдущего рассчитанного значения Индекса более чем на величину, указанную в п.3 Приложения 1 к Методике, исключаются из расчета Индекса.
- 3.4. Цены договоров, участвующих в расчете Индекса, учитываются с НДС.
- 3.5. В случае отсутствия договоров, заключенных в ходе торгов, проводимых в дату расчета Индекса, и удовлетворяющих условиям п.3.1, п.3.2 и п.3.3 Методики, в расчете Индекса участвуют заявки, поданные в ходе торгов, проводимых в дату расчета Индекса (в соответствии с п.4.2.1 Методики).

4. Формула расчёта Индекса

- 4.1. Расчёт Индекса производится по следующей формуле:

$$I = \frac{\sum P_i \times V_i}{\sum V_i}$$

где:

I – значение Индекса, выраженное в российских рублях на расчетную дату;

V_i – объем договора i , заключенного по результатам торгов Товаром на спот-рынке АО НТБ и отвечающего условиям, приведенным в разделе 3 настоящей Методики, выраженный в тоннах;

P_i – цена договора i , заключенного по результатам торгов Товаром на спот-рынке АО НТБ и отвечающего условиям, приведенным в разделе 3 настоящей Методики, выраженная в российских рублях и округленная с точностью до одного российского рубля по правилам математического округления.

- 4.2. В случае если расчет Индекса в соответствии с п.4.1 Методики не возможен в связи с тем, что в дату расчета Индекса отсутствуют заключенные договоры, отвечающие условиям, приведенным в разделе 3 настоящей Методики или

совокупный объем всех договоров на всех Базисах составил менее величины, указанной в п.2 Приложения 1 - значение Индекса определяется в соответствии с пунктами 4.2.1 – 4.2.2 Методики каскадным методом (при невозможности расчета по пункту 4.2.1 Методики, значение индекса определяется в соответствии с п.4.2.2 Методики), но не более 5 торговых дней подряд с момента расчета Индекса в соответствии с п.4.1 Методики:

4.2.1. При наличии встречных заявок на Базисе (заявка покупателя и заявка продавца, выставленные на отдельном Базисе) зафиксированных по итогам торгов на спот-рынке АО НТБ в дату расчета Индекса, цены которых отклоняются от значения $I_{(t-1)}$ (Индекса на расчетную дату последнего торгового дня, предшествующего дате расчета Индекса) не более, чем на величину, указанную в п.4 Приложения 1 расчет Индекса производится по формуле:

$$I = \frac{I_{(t-1)} + O_i}{2}$$

где:

I – значение Индекса, выраженное в российских рублях на расчетную дату;

$I_{(t-1)}$ – значение Индекса, выраженное в российских рублях на расчетную дату торгового дня, предшествующего дате расчета Индекса;

O_i - среднеарифметическое значение цен Лучших встречных заявок на Базисах, поданных в дату расчета Индекса, цены которых отклоняются от значения $I_{(t-1)}$ (Индекса на расчетную дату последнего торгового дня, предшествующего дате расчета Индекса) не более, чем на величину, указанную в п.4 Приложения 1. При этом договоры, совокупный объем которых на всех Базисах составил менее величины, указанной в п.2 Приложения 1, учитываются при расчете O_i как две разнонаправленные заявки (одна заявка на покупку и одна заявка на продажу), цены которых равны цене соответствующего договора.

4.2.2. При отсутствии встречных заявок на Базисе (заявка покупателя и заявка продавца, выставленные на отдельном Базисе) зафиксированных по итогам торгов на спот-рынке АО НТБ в дату расчета Индекса, цены которых отклоняются от значения $I_{(t-1)}$ (Индекса на расчетную дату последнего торгового дня, предшествующего дате расчета Индекса) не более, чем на величину, указанную в п.4 Приложения 1, расчет Индекса производится по формуле:

$$I = I_{(t-1)}$$

где:

I – значение Индекса, выраженное в российских рублях на расчетную дату;

$I_{(t-1)}$ – значение Индекса, выраженное в российских рублях на расчетную дату торгового дня, предшествующего дате расчета Индекса.

4.3. Значения Индекса определяются за тонну Товара и округляются с точностью до одного российского рубля по правилам математического округления.

4.4. Расчет Индекса осуществляется один раз в день каждый торговый день.

5. Контроль за расчётом Индекса

- 5.1. В случае наступления обстоятельств, которые могут негативно повлиять на адекватность отражения Индексом реального состояния российского биржевого товарного рынка сахара, Биржа вправе предпринять любые действия, необходимые для обеспечения адекватности Индекса по результатам торгов Товаром на спот-рынке АО НТБ, в том числе исключить отдельные договоры, заключенные по результатам торгов на спот-рынке АО НТБ, из расчета Индекса.
- 5.2. В отношении пересчета значений Индекса Биржа руководствуется Положением о пересчете значений индексов АО НТБ, утверждаемым Биржей.

6. Порядок раскрытия информации об Индексах

- 6.1. Информация о значениях Индексов раскрывается в дату расчёта соответствующего Индекса, не позднее 17:00 часов по московскому времени на официальном сайте Биржи в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», а также дополнительно может распространяться иными способами, в том числе через третьих лиц, включая официальный сайт Публичного акционерного общества «Московская Биржа ММВБ-РТС» в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет». Время раскрытия информации о значениях Индексов может быть изменено по решению Биржи.

Информация о значениях Индекса за весь период расчёта, а также иная информация, в том числе раскрытие которой требуется в соответствии с требованиями нормативных актов, публикуется на официальном сайте Биржи в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» www.namex.org.

Приложение 1
к Методике расчета
биржевого индекса сахара в ЮФО

Параметры, используемые при расчете биржевого индекса сахара в ЮФО

№	Наименование параметра	Значение	Единицы измерения
1	Объем заключенного договора или заявки, зарегистрированной на Бирже для включения в базу расчета Индекса	20 и более	тонн
2	Совокупный объем заключенных договоров на всех Базисах для включения договоров в базу расчета индекса	20 и более	тонн
3	Максимальное отклонение цены договора от предыдущего рассчитанного значения Индекса	20	%
4	Максимальное отклонение цены заявки от предыдущего рассчитанного значения Индекса	5	%