УТВЕРЖДЕНО

Советом директоров

ОАО «Санкт-Петербургская биржа»

(протокол №8 от 03 декабря 2012г.)

**СПЕЦИФИКАЦИЯ**

**ФЬЮЧЕРСНОГО КОНТРАКТА**

**на дизельное топливо летнее**

Настоящая спецификация определяет стандартные условия фьючерсного контракта на дизельное топливо летнее.

Настоящая спецификация совместно с правилами, регулирующими порядок оказания клиринговых услуг в Секции срочного рынка (далее – Правила клиринга), правилами, регулирующими порядок проведения торгов в Секции срочного рынка (далее – Правила торговли), иными документами, указанными в настоящей спецификации, определяет порядок возникновения, изменения и прекращения обязательств по фьючерсному контракту на дизельное топливо летнее (далее – Контракт).

1. **Термины и определения**
   1. Покупатель/Продавец – Покупатель/Продавец по Контракту с одним кодом.
   2. Термины и определения, прямо не указанные в настоящей спецификации, понимаются в соответствии с законодательством Российской Федерации, Правилами торговли и Правилами клиринга.
2. **Общие положения**
   1. Контракт имеет следующее наименование:

Фьючерсный контракт на дизельное топливо летнее.

* 1. Код (обозначение) Контракта, используемый для идентификации, формируется по следующим правилам:

DS-<месяц исполнения>.<год исполнения>.

Месяц и год исполнения в коде (обозначении) Контракта (далее – месяц и год исполнения Контракта соответственно) указываются арабскими цифрами и используются для определения дня исполнения Контракта.

Месяцами исполнения Контракта могут являться январь, февраль, март, апрель, май, июнь, июль, август, сентябрь, октябрь, ноябрь, декабрь.

Список дат, являющихся последними днями заключения Контрактов и днями исполнения Контрактов в ближайшие 12 (двенадцать) календарных месяцев публикуется на сайте Биржи в сети Интернет.

Пример. Код (обозначение) «DS-9.12» означает, что Контракт с указанным кодом исполняется в сентябре 2012 года.

* 1. Контракт является расчетным.
  2. Базовым активом является дизельное топливо летнее, соответствующее техническому регламенту «О требованиях к автомобильному и авиационному бензину, дизельному и судовому топливу, топливу для реактивных двигателей и топочному мазуту», а также требованиям ГОСТ 305-82, ГОСТ Р 52368-2005, ТУ 38.1011348-99 и ТУ 38.401-58-296-2005 в действующих редакциях (далее – Товар).
  3. Количество Товара, являющегося базовым активом Контракта (далее – Лот), составляет 1 (одну) метрическую тонну.

1. **Заключение Контракта**
   1. Возможность заключения Контракта на Торгах устанавливается решением ОАО «Санкт-Петербургская биржа» (далее – Биржа), которое должно содержать:

* код (обозначение) Контракта;
* начальную Расчетную цену Контракта;
* начальный лимит колебания цены Контракта;
* дату первого Торгового дня, в который может быть заключен Контракт (далее – первый день заключения Контракта).
  1. Контракт может заключаться с начала основной торговой сессии первого дня заключения Контракта.
  2. Цена Контракта в ходе Торгов при подаче заявки и заключении Контракта указывается в рублях за Лот.
  3. Минимальное изменение цены Контракта в ходе Торгов (далее – минимальный шаг цены Контракта) составляет 1 (Один) российский рубль.
  4. Стоимость минимального шага цены Контракта составляет 1 (Один) российский рубль.

1. **Обязательства по Контракту** 
   1. Стороны Контракта обязаны уплачивать друг другу денежные средства (вариационную маржу) в сумме, размер которой зависит от изменения значений базового актива.
   2. Вариационная маржа рассчитывается и уплачивается в период с первого дня заключения Контракта до дня исполнения Контракта.

Обязательство по уплате вариационной маржи, определяемое в ходе вечерней клиринговой сессии дня исполнения Контракта, является Обязательством по расчетам.

* 1. Вариационная маржа рассчитывается по следующим формулам:

ВМо = (РЦт – Цо) \* W / R,

ВМт = (РЦт – РЦп) \* W / R, где

ВМо – вариационная маржа по Контракту, расчет вариационной маржи по которой, ранее не осуществлялся;

ВМт – вариационная маржа по Контракту, расчет вариационной маржи по которой, осуществлялся ранее;

Цо – цена заключения Контракта;

РЦт – текущая (последняя) расчетная цена Контракта;

РЦп – предыдущая Расчетная цена Контракта;

W – стоимость минимального шага цены;

R – минимальный шаг цены.

* 1. Вариационная маржа по Контракту, рассчитанная по формулам, указанным в пункте 4.3. настоящей спецификации, округляется с точностью до копеек по правилам математического округления.
  2. Исполнение обязательств по уплате вариационной маржи, рассчитанной по формулам, указанным в пункте 4.3. настоящей спецификации, осуществляется в порядке и сроки, установленные Правилами клиринга. При этом если вариационная маржа положительна, то обязательство по уплате вариационной маржи возникает у Продавца, а если отрицательна, то обязательство по уплате вариационной маржи в сумме, равной абсолютной величине рассчитанной вариационной маржи, возникает у Покупателя.
  3. Расчетная цена определяется Биржей в порядке и сроки, установленные Правилами торговли и настоящей спецификацией.
  4. В целях определения Обязательства по расчетам текущая Расчетная цена (цена исполнения Контракта) считается равной среднеарифметическому значению индекса «КОРТЕС-Газойль», рассчитанному за предшествующие последнему дню заключения Контракта 2 (два) Торговых дня и за последний день заключения Контракта в совокупности на основании утвержденной методики и опубликованному на сайте ООО Информационно-аналитический центр «КОРТЕС» (далее – ООО ИАЦ КОРТЕС) в сети Интернет по адресу: [www.kortes.com](http://www.kortes.com)[[1]](#footnote-2). Значение текущей Расчетной цены округляется с точностью до рублей по правилам математического округления.
  5. Размер вариационной маржи, который рассчитан в ходе вечерней клиринговой сессии последнего дня заключения Контракта и превышает по абсолютной величине размер гарантийного обеспечения по Контракту, установленный в ходе дневной клиринговой сессии последнего дня заключения Контракта, считается равным по абсолютной величине указанному размеру гарантийного обеспечения.

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, то есть возникновения у Продавца обязательств Покупателя или у Покупателя - обязательств Продавца, с соблюдением требований, предусмотренных Правилами клиринга.
   3. Обязательства по Контракту могут быть прекращены по иным основаниям, указанным в Правилах клиринга.
2. **Ответственность.** 
   1. Стороны несут ответственность за неисполнение или ненадлежащее исполнение обязательств по Контракту в соответствии с законодательством Российской Федерации и Правилами клиринга.
3. **Особые условия.** 
   1. В случае приостановки/прекращения расчета ООО ИАЦ «КОРТЕС» индекса «КОРТЕС-Газойль» Биржа вправе изменить:

* изменить дату последнего дня заключения Контракта; и (или)
* изменить дату исполнения Контракта; и (или)
* в соответствии с пунктом 7.2. настоящей спецификации установить текущую Расчетную цену и определить порядок расчета и уплаты вариационной маржи, связанный с изменением Расчетной цены; и (или)
* принять иные решения, предусмотренные Правилами торговли.
  1. В случаях, указанных с пункте 7.1. настоящей спецификации текущая Расчетная цена в день исполнения Контракта определяется по следующей формуле:

РЦи = РЦпр \* Гт/Гп, где

РЦи – Расчетная цена в день исполнения Контракта, которая округляется с точностью до рублей по правилам математического округления;

РЦпр – Расчетная цена Контракта, полученная в последний день расчета индекса «КОРТЕС-Газойль» до момента приостановки/прекращения расчета ООО ИАЦ «КОРТЕС» индекса «КОРТЕС-Газойль»;

Гт – расчетная цена фьючерсного контракта ICE Gasoil Futures Contract (код контракта G),  торгуемого на бирже ICE Futures Europe (далее – ICE), с месяцем исполнения, который соответствует месяцу исполнения Контракта, опубликованная в день, предшествующий дню исполнения Контракта. Данная расчетная цена публикуется на официальном сайте биржи ICE в сети Интернет по адресу [www.theice.com](http://www.theice.com)[[2]](#footnote-3);

Гп – расчетная цена фьючерсного контракта ICE Gasoil Futures Contract (код контракта G),  торгуемого на бирже ICE, с месяцем исполнения, который соответствует месяцу исполнения Контракта, определенная в день приостановки/прекращения расчета ООО ИАЦ «КОРТЕС» индекса «КОРТЕС-Газойль».

* 1. Информация о решении (решениях), принятом (принятых) Биржей в соответствии с пунктом 7.1. настоящей спецификации, доводится до сведения Участников торгов путем ее опубликования на сайте Биржи в сети Интернет не менее чем за 1 (один) Торговый день до вступления в силу соответствующего решения (решений).
  2. С момента вступления в силу решения (решений), принятого (принятых) Биржей в соответствии с пунктом 7.1. настоящей спецификации, условия существующих обязательств по ранее заключенным Контрактам считаются измененными с учетом указанного решения (решений).

1. **Внесение изменений и дополнений в настоящую спецификацию.**
   1. Биржа вправе внести изменения и дополнения в настоящую спецификацию.
   2. Изменения и дополнения в настоящую спецификацию вступают в силу с момента введения Биржей в действие настоящей спецификации, содержащей указанные изменения и дополнения.
   3. Информация о введении в действие настоящей спецификации, содержащей изменения и дополнения, доводится Биржей до сведения Участников торгов путем опубликования в сети Интернет не менее чем за 1 (один) Торговый день до введения ее в действие.
   4. С момента вступления в силу изменений и дополнений в настоящую спецификацию условия существующих обязательств по ранее заключенным Контрактам считаются измененными с учетом таких изменений и дополнений.

1. Информация о значении индекса «КОРТЕС-Газойль» размещена на сайте [www.kortes.com](http://www.kortes.com) в сети Интернет в открытом (бесплатном) доступе, значение индекса выражено в рублях за одну метрическую тонну Товара. Биржа не несет ответственности за недостоверность, неполноту и несвоевременное обновление указанной информации на сайте [www.kortes.com](http://www.kortes.com), а также за сбои в работе указанного сайта. [↑](#footnote-ref-2)
2. Информация о значении расчетной цены фьючерсного контракта ICE Gasoil Futures Contract (код контракта G) размещена на сайте [www.theice.com](http://www.theice.com) в открытом (бесплатном) доступе, значение индекса выражено в долларах и центах США за 1 (одну) тонну газойля. Биржа и Клиринговый центр не несут ответственности за недостоверность, неполноту и несвоевременное обновление указанной информации сайте [www.theice.com](http://www.theice.com), а также за сбои в работе указанного сайта. [↑](#footnote-ref-3)