

ПОГОДЖЕНО НКЦПФР

ЗАТВЕРДЖЕНО

Рішення № 47

Рішенням Біржової ради ПрАТ «УМВБ»

від «17» листопада 2015 року

№ 1 від 20 січня 2015 року

Голова Комісії

Голова Біржової ради


_____ /І.Терещук Д.М./


_____ /О.Л. Гінзбург

ЗРАЗКОВІ ФОРМИ

ф'ючерсних контрактів на середній курс долара, євро та російського рубля
(без поставки)

(додаток до Правил проведення торгів у Секції строкового ринку
Приватного акціонерного товариства «Українська міжбанківська валютна біржа»)

ЗРАЗКОВА ФОРМА
Ф'ючерсний контракт на середній курс долара США
(без поставки)

1. Загальні положення

Зобов'язання учасників біржового ринку ф'ючерсних контрактів на середній курс долара США без поставки (далі - ф'ючерсні контракти) вважаються прийнятими ними після укладання біржових контрактів купівлі/продажу таких ф'ючерсних контрактів на торгах Секції строкового ринку ПрАТ "УМВБ" (далі – Біржі) згідно з «Правилами проведення торгів в Секції строкового ринку Приватного акціонерного товариства «Українська міжбанківська валютна біржа».

2. Базовий актив контракту

Базовим активом контракту є середній курс долара США до гривні.

3. Обсяг контракту

Обсяг контракту дорівнює 1 000 (одна тисяча) доларів США.

4. Термін виконання (строк обігу контракту)

Найближчі 6 (шість) місяців.

5. День виконання контракту

День виконання контракту є третя середа місяця виконання. Якщо цей день є вихідним або святковим, то днем виконання буде попередній робочий день.

6. Останній торговий день

Останнім торговим днем є робочий день, що передує дню виконання.

7. Форма задання ціни контракту

Ціна контракту вказується в гривнях за 1 долар США.

8. Мінімальна зміна ціни контракту

Мінімальна зміна ціни контракту дорівнює 0,00001 гривні.

9. Ціна пункту

Ціна пункту дорівнює 0.01 гривні.

10. Розрахункова ціна

Розрахункова ціна є ціна 1 (одного) долара США, що визначена згідно із середнім курсом долара США, розрахованим та оприлюдненим ПрАТ «УМВБ» відповідно до «Методики розрахунку середніх курсів іноземних валют за інформацією комерційних банків України» на день виконання контракту та округлена до п'яти значущих цифр після коми.

11. Розмір початкової маржі.

Розмір сукупної початкової маржі для відкриття та подальшого підтримання позицій за ф'ючерсним контрактом визначається за наступною формулою:

$$M_p = C_p \times N$$

Де, C_p - ставка початкової маржі

N - кількість відкритих позицій за відповідним ф'ючерсним контрактам

Ставки початкової маржі для кожної серії ф'ючерсного контракту визначає Біржа та вказує в Умовах торгів в Секції строкового ринку Біржі.

12. Виконання контракту

Виконання контракту здійснюється шляхом нарахування/списання в день виконання контракту варіаційної маржі, розрахованої за формулою:

$$B_M = (P_C - C_3) \times O_K$$

Де, B_M - варіаційна маржа

P_C - розрахункова ціна

C_3 - ціна закриття в останній день торгів по даному контракту

O_K - обсяг контракту

При цьому покупець контракту має отримати, а продавець виплатити варіаційну маржу, якщо вона позитивна, та навпаки - покупець контракту має виплатити, а продавець отримати її, якщо вона від'ємна.

Нарахування/списання варіаційної маржі здійснюється щоденно згідно з процедурою коригування по ринку позиції учасника торгівлі за весь період торгівлі цим контрактом з моменту укладання біржового контракту до дня виконання контракту.

13. Позначення контракту.

<валюта>-<позначка методики розрахунку курсу>/<місяць виконання> <рік виконання>.

Наприклад: **USD-s/sep07**

(ф'ючерсний контракт на середній курс долара США з виконанням у серпні 2007 року).

14. Порядок розгляду спорів, що виникають під час укладання та виконання контрактів.

Відповідальність сторін.

Порядок розгляду спорів, що виникають під час укладання та виконання контракту, а також відповідальність сторін за невиконання або неналежне виконання обов'язків, що впливають з контракту, визначається відповідно до Правил ПрАТ «УМВБ».

ЗРАЗКОВА ФОРМА
Ф'ючерсний контракт на середній курс євро
(без поставки)

1. Загальні положення

Зобов'язання учасників біржового ринку ф'ючерсних контрактів на середній курс євро без поставки (далі - ф'ючерсні контракти) вважаються прийнятими ними після укладання біржових контрактів купівлі/продажу таких ф'ючерсних контрактів на торгах Секції строкового ринку ПрАТ "УМВБ" (далі – Біржі) згідно з «Правилами проведення торгів в Секції строкового ринку Приватного акціонерного товариства «Українська міжбанківська валютна біржа».

2. Базовий актив контракту

Базовим активом контракту є середній курс євро до гривні.

3. Обсяг контракту

Обсяг контракту дорівнює 1 000 (одна тисяча) євро.

4. Термін виконання (строк обігу контракту)

Найближчі 6 (шість) місяців.

5. День виконання контракту

День виконання контракту є третя середа місяця виконання. Якщо цей день є вихідним або святковим, то днем виконання буде попередній робочий день.

6. Останній торговий день

Останнім торговим днем є робочий день, що передує дню виконання.

7. Форма задання ціни контракту

Ціна контракту вказується в гривнях за 1 євро.

8. Мінімальна зміна ціни контракту

Мінімальна зміна ціни контракту дорівнює 0,00001 гривні.

9. Ціна пункту

Ціна пункту дорівнює 0.01 гривні.

10. Розрахункова ціна

Розрахункова ціна є ціна 1 (одного) євро, що визначена згідно із середнім курсом євро, розрахованим та оприлюдненим ПрАТ «УМВБ» відповідно до «Методики розрахунку середніх курсів іноземних валют за інформацією комерційних банків України» на день виконання контракту та округлена до п'яти значущих цифр після коми.

11. Розмір початкової маржі.

Розмір сукупної початкової маржі для відкриття та подальшого підтримання позицій за ф'ючерсним контрактом визначається за наступною формулою:

$$M_p = C_p \times N$$

Де, C_p - ставка початкової маржі

N - кількість відкритих позицій за відповідним ф'ючерсним контрактам

Ставки початкової маржі для кожної серії ф'ючерсного контракту визначає Біржа та вказує в Умовах торгів в Секції строкового ринку Біржі.

12. Виконання контракту

Виконання контракту здійснюється шляхом нарахування/списання в день виконання контракту варіаційної маржі, розрахованої за формулою:

$$B_M = (P_C - C_3) \times O_K$$

Де, B_M - варіаційна маржа

P_C - розрахункова ціна

C_3 - ціна закриття в останній день торгів по даному контракту

O_K - обсяг контракту

При цьому покупець контракту має отримати, а продавець виплатити варіаційну маржу, якщо вона позитивна, та навпаки - покупець контракту має виплатити, а продавець отримати її, якщо вона від'ємна.

Нарахування/списання варіаційної маржі здійснюється щоденно згідно з процедурою коригування по ринку позиції учасника торгівлі за весь період торгівлі цим контрактом з моменту укладання біржового контракту до дня виконання контракту.

13. Позначення контракту.

<валюта>-<позначка методики розрахунку курсу>/<місяць виконання> <рік виконання>.

Наприклад: **EUR-s/сер07**

(ф'ючерсний контракт на середній курс євро з виконанням у серпні 2007 року).

14. Порядок розгляду спорів, що виникають під час укладання та виконання контрактів.

Відповідальність сторін.

Порядок розгляду спорів, що виникають під час укладання та виконання контракту, а також відповідальність сторін за невиконання або неналежне виконання обов'язків, що впливають з контракту, визначається відповідно до Правил ПрАТ «УМВБ».

ЗРАЗКОВА ФОРМА
Ф'ючерсний контракт на середній курс російського рубля
(без поставки)

1. Загальні положення

Зобов'язання учасників біржового ринку ф'ючерсних контрактів на середній курс російського рубля без поставки (далі - ф'ючерсні контракти) вважаються прийнятими ними після укладання біржових контрактів купівлі/продажу таких ф'ючерсних контрактів на торгах Секції строкового ринку ПрАТ «УМВБ» (далі – Біржі) згідно з «Правилами проведення торгів в Секції строкового ринку Приватного акціонерного товариства «Українська міжбанківська валютна біржа».

2. Базовий актив контракту

Базовим активом контракту є середній курс російського рубля до гривні.

3. Обсяг контракту

Обсяг контракту дорівнює 10 000 (десять тисяч) російських рублів.

4. Термін виконання (строк обігу контракту)

Найближчі 6 (шість) місяців.

5. День виконання контракту

День виконання контракту є третя середа місяця виконання. Якщо цей день є вихідним або святковим, то днем виконання буде попередній робочий день.

6. Останній торговий день

Останнім торговим днем є робочий день, що передує дню виконання.

7. Форма задання ціни контракту

Ціна контракту вказується в гривнях за 1 російський рубель.

8. Мінімальна зміна ціни контракту

Мінімальна зміна ціни контракту дорівнює 0,0001 гривні.

9. Ціна пункту

Ціна пункту дорівнює 1(одній) гривні.

10. Розрахункова ціна

Розрахункова ціна є ціна 1 (одного) російського рубля, що визначена згідно із середнім курсом російського рубля, розрахованим та оприлюдненим ПрАТ «УМВБ» відповідно до «Методики розрахунку середніх курсів іноземних валют за інформацією комерційних банків України» на день виконання контракту та округлена до п'яти значущих цифр після коми.

11. Розмір початкової маржі.

Розмір сукупної початкової маржі для відкриття та подальшого підтримання позицій за ф'ючерсним контрактом визначається за наступною формулою:

$$M_p = C_p \times N$$

Де, C_p - ставка початкової маржі

N - кількість відкритих позицій за відповідним ф'ючерсним контрактам

Ставки початкової маржі для кожної серії ф'ючерсного контракту визначає Біржа та вказує в Умовах торгів в Секції строкового ринку Біржі.

12. Виконання контракту

Виконання контракту здійснюється шляхом нарахування/списання в день виконання контракту варіаційної маржі, розрахованої за формулою:

$$M = (PЦ - ЦЗ) \times ОК$$

Де, VM - варіаційна маржа

$PЦ$ - розрахункова ціна

$ЦЗ$ - ціна закриття в останній день торгів по даному контракту

$ОК$ - обсяг контракту

При цьому покупець контракту має отримати, а продавець виплатити варіаційну маржу, якщо вона позитивна, та навпаки - покупець контракту має виплатити, а продавець отримати її, якщо вона від'ємна.

Нарахування/списання варіаційної маржі здійснюється щоденно згідно з процедурою коригування по ринку позиції учасника торгівлі за весь період торгівлі цим контрактом з моменту укладання біржового контракту до дня виконання контракту.

13. Позначення контракту.

<валюта>-<позначка методики розрахунку курсу>/<місяць виконання> <рік виконання>.

Наприклад: **RUR-s/sep07**

(ф'ючерсний контракт на середній курс російського рубля з виконанням у серпні 2007 року).

14. Порядок розгляду спорів, що виникають під час укладання та виконання контрактів.

Відповідальність сторін.

Порядок розгляду спорів, що виникають під час укладання та виконання контракту, а також відповідальність сторін за невиконання або неналежне виконання обов'язків, що впливають з контракту, визначається відповідно до Правил ПрАТ «УМВБ».

ЗРАЗКОВА ФОРМА
Ф'ючерсний контракт на середній курс долара США
(без поставки)

1. Загальні положення

Зобов'язання учасників біржового ринку ф'ючерсних контрактів на середній курс долара США (далі - ф'ючерсні контракти) вважаються прийнятими ними після укладання біржових контрактів купівлі/продажу таких ф'ючерсних контрактів на торгах Секції строкового ринку ПрАТ «УМВБ» (далі – Біржі) згідно з «Правилами проведення торгів в Секції строкового ринку Приватного акціонерного товариства «Українська міжбанківська валютна біржа».

2. Базовий актив контракту

Базовим активом контракту є середній курс долара США до гривні.

3. Обсяг контракту

Обсяг контракту дорівнює 1 000 (одна тисяча) доларів США.

4. Термін виконання (строк обігу контракту)

Найближчі 26 (двадцять шість) тижнів.

5. День виконання контракту

День виконання контракту є середа тижня виконання. Якщо цей день є вихідним або святковим, то днем виконання буде попередній робочий день.

6. Останній торговий день

Останнім торговим днем є робочий день, що передує дню виконання.

7. Форма задання ціни контракту

Ціна контракту вказується в гривнях за 1 долар США.

8. Мінімальна зміна ціни контракту

Мінімальна зміна ціни контракту дорівнює 0,00001 гривні.

9. Ціна пункту

Ціна пункту дорівнює 0.01 гривні.

10. Розрахункова ціна

Розрахункова ціна є ціна 1 (одного) долара США, що визначена згідно із середнім курсом долара США, розрахованим та оприлюдненим ПрАТ «УМВБ» відповідно до «Методики розрахунку середніх курсів іноземних валют за інформацією комерційних банків України» на день виконання контракту та округлена до п'яти значущих цифр після коми.

11. Розмір початкової маржі.

Розмір сукупної початкової маржі для відкриття та подальшого підтримання позицій за ф'ючерсним контрактом визначається за наступною формулою:

$$M_p = C_p \times N$$

Де, C_p - ставка початкової маржі

N - кількість відкритих позицій за відповідним ф'ючерсним контрактам

Ставки початкової маржі для кожної серії ф'ючерсного контракту визначає Біржа та вказує в Умовах торгів в Секції строкового ринку Біржі.

12. Виконання контракту

Виконання контракту здійснюється шляхом нарахування/списання в день виконання контракту варіаційної маржі, розрахованої за формулою:

$$B_M = (P_C - C_3) \times O_K$$

Де, B_M - варіаційна маржа

P_C - розрахункова ціна

C_3 - ціна закриття в останній день торгів по даному контракту

O_K - обсяг контракту

При цьому покупець контракту має отримати, а продавець виплатити варіаційну маржу, якщо вона позитивна, та навпаки - покупець контракту має виплатити, а продавець отримати її, якщо вона від'ємна.

Нарахування/списання варіаційної маржі здійснюється щоденно згідно з процедурою коригування по ринку позиції учасника торгівлі за весь період торгівлі цим контрактом з моменту укладання біржового контракту до дня виконання контракту.

13. Позначення контракту.

<валюта>-<позначка методики розрахунку курсу>/<тиждень виконання> <рік виконання>.

Наприклад: **USD-s/24w07**

(ф'ючерсний контракт на середній курс долара США з виконанням на 24-ому тижні 2007 року).

14. Порядок розгляду спорів, що виникають під час укладання та виконання контрактів. Відповідальність сторін.

Порядок розгляду спорів, що виникають під час укладання та виконання контракту, а також відповідальність сторін за невиконання або неналежне виконання обов'язків, що впливають з контракту, визначається відповідно до Правил ПрАТ «УМВБ».

ЗРАЗКОВА ФОРМА
Ф'ючерний контракт на середній курс євро
(без поставки)

1. Загальні положення

Зобов'язання учасників біржового ринку ф'ючерних контрактів на середній курс євро (далі - ф'ючерні контракти) вважаються прийнятими ними після укладання біржових контрактів купівлі/продажу таких ф'ючерних контрактів на торгах Секції строкового ринку ПрАТ «УМВБ» (далі – Біржі) згідно з «Правилами проведення торгів в Секції строкового ринку Приватного акціонерного товариства «Українська міжбанківська валютна біржа».

2. Базовий актив контракту

Базовим активом контракту є середній курс євро до гривні.

3. Обсяг контракту

Обсяг контракту дорівнює 1 000 (одна тисяча) євро.

4. Термін виконання (строк обігу контракту)

Найближчі 26 (двадцять шість) тижнів.

5. День виконання контракту

День виконання контракту є середа тижня виконання. Якщо цей день є вихідним або святковим, то днем виконання буде попередній робочий день.

6. Останній торговий день

Останнім торговим днем є робочий день, що передує дню виконання.

7. Форма задання ціни контракту

Ціна контракту вказується в гривнях за 1 євро.

8. Мінімальна зміна ціни контракту

Мінімальна зміна ціни контракту дорівнює 0,00001 гривні.

9. Ціна пункту

Ціна пункту дорівнює 0.01 гривні.

10. Розрахункова ціна

Розрахункова ціна є ціна 1 (одного) євро, що визначена згідно із середнім курсом євро, розрахованим та оприлюдненим ПрАТ «УМВБ» відповідно до «Методики розрахунку середніх курсів іноземних валют за інформацією комерційних банків України» на день виконання контракту та округлена до п'яти значущих цифр після коми.

11. Розмір початкової маржі.

Розмір сукупної початкової маржі для відкриття та подальшого підтримання позицій за ф'ючерним контрактом визначається за наступною формулою:

$$M_p = C_p \times N$$

Де, C_p - ставка початкової маржі

N - кількість відкритих позицій за відповідним ф'ючерним контрактам

Ставки початкової маржі для кожної серії ф'ючерного контракту визначає Біржа та вказує в Умовах торгів в Секції строкового ринку Біржі.

12. Виконання контракту

Виконання контракту здійснюється шляхом нарахування/списання в день виконання контракту варіаційної маржі, розрахованої за формулою:

$$B_M = (P_C - C_3) \times O_K$$

Де, B_M - варіаційна маржа

P_C - розрахункова ціна

C_3 - ціна закриття в останній день торгів по даному контракту

O_K - обсяг контракту

При цьому покупець контракту має отримати, а продавець виплатити варіаційну маржу, якщо вона позитивна, та навпаки - покупець контракту має виплатити, а продавець отримати її, якщо вона від'ємна.

Нарахування/списання варіаційної маржі здійснюється щоденно згідно з процедурою коригування по ринку позиції учасника торгівлі за весь період торгівлі цим контрактом з моменту укладання біржового контракту до дня виконання контракту.

13. Позначення контракту.

<валюта>-<позначка методики розрахунку курсу>/<тиждень виконання> <рік виконання>.

Наприклад: **EUR-s/24w07**

(ф'ючерний контракт на середній курс євро з виконанням на 24-ому тижні 2007 року).

14. Порядок розгляду спорів, що виникають під час укладання та виконання контрактів.

Відповідальність сторін.

Порядок розгляду спорів, що виникають під час укладання та виконання контракту, а також відповідальність сторін за невиконання або неналежне виконання обов'язків, що впливають з контракту, визначається відповідно до Правил ПрАТ «УМВБ».