

ЗАРЕЄСТРОВАНО
рішенням Національної комісії з цінних
паперів та фондового ринку

від «26» серпня 2013р. № 1123



Голова Комісії

Д.М. Тевелєв

ЗАТВЕРДЖЕНО
рішенням Біржової ради
ПАТ «Українська біржа»

Протокол № 8 від «29» травня 2013р.



Голова Біржової ради

І.О. Мазєпа

**ПРАВИЛА ТОРГІВЛІ В СЕКЦІЇ СТРОКОВОГО РИНКУ
Публічного акціонерного товариства «Українська біржа»**

м. Київ, 2013

Розділ I.	ЗАГАЛЬНІ ПОЛОЖЕННЯ
Стаття 1.	Загальні положення
Стаття 2.	Загальні терміни та визначення
Розділ II	ПОРЯДОК ДОПУСКУ ДО БІРЖОВИХ ТОРГІВ
Стаття 3.	Учасники біржових торгів на строковому ринку
Стаття 4.	Уповноважені представники Учасників біржових торгів на строковому ринку
Стаття 5.	Відповідальність
РОЗДІЛ III	ПОРЯДОК ОРГАНІЗАЦІЇ ТА ПРОВЕДЕННЯ БІРЖОВИХ ТОРГІВ
Стаття 6.	Торговельний день
Стаття 7.	Зразкова форма Строкового контракту
Стаття 8.	Заявки
Стаття 9.	Види Заявок
Стаття 10.	Зміст Заявки
Стаття 11.	Подання Заявок
Стаття 12.	Строк дії Заявок
Стаття 13.	Порядок формування Реєстру Заявок
Стаття 14.	Укладання Строкових контрактів на Торгах
Стаття 15.	Порядок формування Реєстру контракту
Стаття 16.	Визначення ціни укладених Строкових контрактів
Стаття 17.	Порядок дій у випадках виникнення технічних збоїв в ETS
Стаття 18.	Запобігання маніпулюванню цінами
Стаття 19.	Дії Біржі при виникненні особливих обставин
Стаття 20.	Розміри платежів за послуги Біржі та порядок їх стягнення
Стаття 21.	Порядок вирішення спорів
Стаття 22.	Додатковий функціонал Робочої станції
РОЗДІЛ IV.	ПРАВИЛА ЗДІЙСНЕННЯ КЛІРИНГУ ТА РОЗРАХУНКІВ ЗА СТРОКОВИМИ КОНТРАКТАМИ
Стаття 23.	Клірингові реєстри
Стаття 24.	Облік зобов'язань за Строковими контрактами
Стаття 25.	Облік зобов'язань по перерахуванню грошових коштів
Стаття 26.	Облік зобов'язань по поверненню коштів Страхового фонду
Стаття 27.	Порядок проведення клірингових сесій
Стаття 28.	Порядок виконання Опціонів
Стаття 29.	Порядок виконання розрахункових Ф'ючерсних контрактів в Дату виконання
Стаття 30.	Порядок виконання Ф'ючерсних контрактів з поставкою, базовим активом яких є цінні папери, в Дату виконання
Стаття 31.	Порядок включення зобов'язань за Ф'ючерсними контрактами з поставкою з Датою виконання, що наступила, до складу зобов'язань по оплаті/перереєстрації цінних паперів, що підлягають виконанню
Стаття 32.	Порядок оплати послуг за організацію торгівлі та сплати штрафів
Стаття 33.	Звіти, що надаються Учасникам біржових торгів на строковому ринку
Стаття 34.	Резервний фонд
Стаття 35.	Страховий фонд
Стаття 36.	Контроль за дотриманням Правил торгівлі в Секції строкового ринку
Стаття 37.	Проведення заходів щодо фінансового моніторингу
Стаття 38.	Порядок розкриття інформації про діяльність Біржі та її оприлюднення

Розділ I. ЗАГАЛЬНІ ПОЛОЖЕННЯ

Стаття 1. Загальні положення

- 1.1. Правила торгівлі в Секції строкового ринку Публічного акціонерного товариства «Українська біржа» (далі – Правила торгівлі в Секції строкового ринку) розроблені відповідно до Податкового кодексу України, Законів України "Про цінні папери та фондовий ринок", "Про державне регулювання ринку цінних паперів в Україні", "Про Національну депозитарну систему та особливості електронного обігу цінних паперів в Україні", "Про акціонерні товариства", "Про банки і банківську діяльність", "Про захист інформації в автоматизованих системах", а також Положення про функціонування фондових бірж, затвердженого рішенням Національної комісії з цінних паперів і фондового ринку від 22.11.2012 р. № 1688 та зареєстрованого в Міністерстві юстиції України 14.12.2012 р. за № 2082/22394, Положення про вимоги до стандартної (типової) форми деривативів, затвердженого постановою Кабінету Міністрів України від 19.04.1999 № 632, Положення про порядок реєстрації змін до правил фондової біржі щодо запровадження в обіг на фондовій біржі деривативів, затвердженого рішенням Державної комісії з цінних паперів і фондового ринку від 04.08.2009 № 884 та зареєстрованого в Міністерстві юстиції України 31.08.2009 за № 818/16834, нормативними документами Національної/Державної комісії з цінних паперів і фондового ринку (далі - Комісія), що регламентують діяльність фондових бірж, а також Статутом ПАТ «Українська біржа».
- 1.2. Правила торгівлі в Секції строкового ринку є частиною Правил Публічного акціонерного товариства «Українська біржа» (надалі – Правила Біржі). Питання, які не врегульовані цими Правилами торгівлі в Секції строкового ринку, регулюються Правилами Біржі.
- 1.3. Правила торгівлі в Секції строкового ринку встановлюють:
- особливості організації і проведення біржових торгів з метою укладання строкових контрактів,
 - правила реєстрації строкових контрактів,
 - порядок клірингу за строковим контрактам, що проводиться Біржею,
 - заходи по обмеженню маніпулювання цінами,
 - розклад надання послуг Біржею в Секції строкового ринку Біржі,
 - порядок розгляду спорів, пов'язаних з укладанням і виконання строкових контрактів.
- 1.4. Правила торгівлі в Секції строкового ринку, а також зміни і доповнення, до них затверджуються Біржовою радою ПАТ "Українська біржа" і набирають чинності після їх реєстрації в Комісії.
- 1.5. Вимоги Правил торгівлі в Секції строкового ринку обов'язкові для виконання членами Біржі-Учасниками біржових торгів на строковому ринку.
- 1.6. Всі додатки до Правил торгівлі в Секції строкового ринку є їх невід'ємною частиною.

Стаття 2. Загальні терміни та визначення

В Правилах торгівлі в Секції строкового ринку застосовуються наступні терміни та визначення:

Біржа - Публічне акціонерне товариство «Українська біржа».

Верхній/нижній ліміт коливань цін - встановлені для строкового контракту обмеження на ціну, що указується в поданих Заявках.

Вид опціону – Опціон на купівлю (Call-опціон) або Опціон на продаж (Put-опціон).

Внесок до Страхового фонду - кошти, внесені Учасником біржових торгів на строковому ринку до Страхового фонду відповідно до Положення про страховий і резервний фонди, що є додатком до Угоди про систему заходів щодо зниження ризиків.

Група об'єднаних розділів - група розділів клірингових реєстрів Учасника біржових торгів на строковому ринку, об'єднаних в обліку Біржі.

Дата виконання - дата, в яку мають бути виконані зобов'язання за Строковим контрактом.

Депозитарій - депозитарій, з яким Біржа уклала договір про кліринг та розрахунки за договорами щодо цінних паперів.

Електронна торговельна система (ЕТС) - сукупність організаційних, технологічних та технічних засобів, що використовуються Біржею для забезпечення укладання та виконання Строкових контрактів.

Заявка - сукупність ofert на укладання Строкових контрактів з Центральним контрагентом відповідно до Правил торгівлі в Секції строкового ринку. Кожна оферта, що входить до складу Заявки, є офертою на укладання одного Строкового контракту.

Зразкова форма Строкового контракту - документ Біржі, що містить типові умови Строкового контракту і зобов'язання сторін Строкового контракту.

Категорія опціону - Американський опціон (Опціон, за яким здійснення права Утримувача можливе в будь-який Торговельний день протягом строку дії даного Опціону) або Європейський опціон (Опціон, по якому здійснення права Утримувача можливе тільки в останній день строку дії даного Опціону).

Клас опціонів - сукупність Опціонів одного виду, умови яких визначаються однією Зразковою формою Опціонів.

Клієнт - особа, за дорученням і за рахунок якого Учасником біржових торгів на строковому ринку укладаються Строкові контракти на Торгах.

Клірингова сесія - частина Торговельного дня (період часу), під час якої Біржа проводить визначення взаємних зобов'язань з урахуванням їх заліку (збір, звірку, корегування інформації по Строкових контрактах), і розрахунки за ними.

Код (позначення) Строкового контракту – встановлене рішенням Біржі умовне позначення, з вказівкою якого в ЕТС подаються Заявки, спрямовані на укладання певного Строкового контракту і з використанням якого Біржею розкривається інформація про укладені на Торгах Строкові контракти.

Оператор ЕТС - штатний працівник Біржі, уповноважений на виконання адміністративних функцій в ЕТС.

Опціон на купівлю (Call-опціон) - фінансовий інструмент (контракт), відповідно до якого одна сторона (продавець Опціону) продає іншій стороні (покупцеві Опціону) право купити базовий актив Опціону (придбати зобов'язання покупця за Ф'ючерсним контрактом що є базовим активом Опціону) за обумовленою ціною в майбутньому на умовах, узгоджених Зразковою формою Опціону. Продавець Опціону бере на себе зобов'язання, а покупець набуває права. Зразкова форма опціону може передбачати для сторін опціону додаткові зобов'язання по періодичній або одноразовій сплаті грошових сум залежно від зміни цін на базовий актив.

Опціон на продаж (Put-опціон) - фінансовий інструмент (контракт), відповідно до якого одна сторона (продавець Опціону) продає іншій стороні (покупцеві Опціону) право продати базовий актив Опціону (отримати зобов'язання продавця за Ф'ючерсним контрактом, що є базовим активом Опціону) за обумовленою ціною в майбутньому на умовах, визначених Зразковою формою Опціону. Продавець Опціону бере на себе зобов'язання, а покупець набуває права. Зразкова форма опціону може передбачати для сторін опціону додаткові зобов'язання по періодичній або одноразовій сплаті грошових сум залежно від зміни цін на базовий актив.

Опціон - Опціон на купівлю або Опціон на продаж.

Підписчик - Продавець Опціону.

Премія – ціна Опціону, що є винагородою, яку сплачує покупець Опціону продавцеві Опціону.

Робоча станція - сукупність програмних та апаратних засобів, яка забезпечує віддалений доступ Учасника біржових торгів на строковому ринку до ЕТС, що дозволяє Уповноваженому представникові Учасника біржових торгів на строковому ринку подавати, змінювати або видаляти Заявки, укладати контракти, отримувати інформацію, яку розкриває Біржа, і здійснювати інші дії, необхідні для участі в Торгах, у відповідності до Правил торгівлі в Секції строкового ринку і інших документів Біржі

Резервний фонд - фонд, який Біржа формує за рахунок власних коштів відповідно до Правил торгівлі в Секції строкового ринку.

Сайт Біржі - сайт в мережі Інтернет за адресою www.ux.ua.

Серія опціонів – сукупність Опціонів відповідного класу з однаковими Цінами виконання і Строками дії.

Страховий фонд - фонд, який формується за рахунок внесків Учасників біржових торгів на строковому ринку, відповідно до Правил торгівлі в Секції строкового ринку.

Строк дії Опціону – період часу, протягом якого Утримувач має право вимагати виконання зобов'язань відповідно до своїх прав по Опціону.

Строковий контракт - Ф'ючерсний контракт або Опціон.

Торговельний день - визначений Біржею робочий день, протягом якого здійснюються Біржові торги.

Торгівельна сесія - визначений Біржею період часу Торговельного дня, протягом якого на Біржі здійснюється укладання Строкових контрактів.

Угода про систему заходів щодо зниження ризиків – Угода про систему заходів щодо зниження ризиків невиконання операцій – документ Центрального контрагента, який набирає чинності після узгодження з Біржею.

Уповноважений представник Учасника біржових торгів на строковому ринку - фізична особа, яка від імені Учасника біржових торгів на строковому ринку подає Заявки та укладає Строкові контракти.

Утримувач - покупець Опціону.

Учасник біржових торгів на строковому ринку – член Біржі, а також у випадках, передбачених законодавством України, інша особа чи державний орган, який відповідно до Правил торгівлі в Секції строкового ринку отримав право подавати Заявки і укладати Строкові контракти.

Ф'ючерсний контракт – фінансовий інструмент (контракт), покупець (або продавець) якого бере на себе зобов'язання після закінчення певного строку купити (або продати) базовий актив відповідно до стандартних умов, встановлених Зразковою формою Ф'ючерсного контракту.

Ціна виконання Опціону (страйк) – встановлена при укладанні Опціону ціна, за якою Утримувач Опціону має право купити або продати базовий актив Опціону (отримати зобов'язання покупця або продавця за Ф'ючерсним контрактом, що є базовим активом Опціону).

Центральний контрагент - юридична особа, яка для забезпечення режиму повної анонімності в процесі Торгів і розрахунків, та для зниження ризиків невиконання Строкових контрактів стає покупцем відносно кожного продавця та продавцем відносно кожного покупця за кожним Строковим контрактом, що укладається на Торгах. Функції Центрального контрагента виконує член Біржі, який має ліцензію на провадження професійної діяльності на фондовому ринку – депозитарної діяльності зберігача цінних паперів та зобов'язався укладати контракти виключно на ПАТ «Українська біржа» та ПАТ «Фондова біржа ПФТС» (без права укладати контракти на інших фондових біржах та позабіржовому ринку) відповідно до функцій Центрального контрагента на Біржі та уклавши з Біржею відповідний договір.

Шлюз - вид Робочої станції, який надає Учаснику біржових торгів на строковому ринку інтерфейс прикладного програмування.

Інші терміни, що вживаються в Правилах торгівлі в Секції строкового ринку, використовуються відповідно до законодавства України, Правил Біржі, Зразкових форм Строкових контрактів.

Розділ II ПОРЯДОК ДОПУСКУ ДО БІРЖОВИХ ТОРГІВ

Стаття 3. Учасники біржових торгів на строковому ринку

- 3.1. До Біржових торгів допускаються виключно Учасники біржових торгів на строковому ринку.
- 3.2. Статус Учасника біржових торгів на строковому ринку може отримати член Біржі, а також у випадках, передбачених законодавством України, інша особа або державний орган, інформація про яких внесена до переліку учасників біржових торгів відповідно до Правил Біржі.
- 3.3. Умови і порядок отримання статусу члена Біржі, права та обов'язки членів Біржі, порядок тимчасового зупинення і припинення членства на Біржі, порядок ведення Біржею переліків учасників торгів та їх уповноважених представників визначаються Правилами Біржі.
- 3.4. Для отримання статусу Учасника біржових торгів на строковому ринку членові Біржі необхідно:
 - а) надати заяву за формою А01, згідно додатка № 1 до Правил торгівлі в Секції строкового ринку;
 - б) оплатити отримання статусу Учасника біржових торгів на строковому ринку в розмірі, встановленому Біржею;
 - в) надати два примірники підписаного зі свого боку договору на проведення операцій на строковому ринку (типова форма приведена в додатку № 2 до Правил торгівлі в Секції строкового ринку);
 - г) надати Повідомлення про приєднання до Угоди про систему заходів щодо зниження ризиків;
 - д) внести Внесок до Страхового фонду в порядку і розмірі, встановленим Угодою про систему заходів щодо зниження ризиків;
 - е) мати технічну можливість брати участь в Торгах.
- 3.5. При наданні члену Біржі статусу Учасника біржових торгів на строковому ринку Біржа встановлює йому код Учасника біржових торгів на строковому ринку і відкриває розділи клірингових реєстрів, вказаних в статті 23 Правил торгівлі в Секції строкового ринку.
- 3.5.1. Інформація про надання членові Біржі статусу Учасника біржових торгів на строковому ринку і про встановлений йому код доводиться до відома члена Біржі.
- 3.6. Анулювання статусу Учасників біржових торгів на строковому ринку здійснюється за рішенням Правління Біржі.
- 3.7. Якщо на момент прийняття Біржею рішення про анулювання статусу Учасника біржових торгів на строковому ринку у Учасника біржових торгів на строковому ринку існують невиконані (неприпинені) зобов'язання за Строковими контрактами, Біржа припиняє доступ даного Учасника біржових торгів на строковому ринку до Торгів в Секції строкового ринку і направляє Центральному контрагенту повідомлення про необхідність застосування до Учасника біржових торгів на строковому ринку процедури примусового закриття позицій в порядку, встановленому Угодою про систему заходів щодо зниження ризиків.
- 3.8. Анулювання статусу Учасників біржових торгів на строковому ринку здійснюється Біржею після закриття всіх розділів клірингових реєстрів, відкритих Біржею для обліку взаємних зобов'язань, що виникають між цим Учасником біржових торгів на строковому ринку і Центральним контрагентом.
- 3.9. Доступ Учасників біржових торгів на строковому ринку в ЕТС здійснюється Біржею за умови підписання договору про інформаційно-технічне забезпечення відповідно до порядку, визначеного Правилами Біржі.
- 3.10. При проведенні Біржових торгів Біржа забезпечує в режимі спостерігача доступ до ЕТС державному представнику Комісії.

- 3.11. Учасник біржових торгів на строковому ринку має право укладати Строкові контракти:
- а) від свого імені і за свій рахунок;
 - б) від свого імені і за рахунок Клієнта.
- 3.12. У випадках, встановлених Правилами Біржі, Правилами торгівлі в Секції строкового ринку, а також на підставі повідомлень, отриманих від Центрального контрагента, які направляються Біржі у випадках, встановлених Угодою про систему заходів щодо зниження ризиків, Біржа припиняє або поновлює доступ Учасника біржових торгів на строковому ринку до Біржових торгів.

Стаття 4. Уповноважені представники Учасників біржових торгів на строковому ринку

- 4.1. Учасник біржових торгів на строковому ринку бере участь в Торгах через своїх Уповноважених представників, зареєстрованих в Переліку Уповноважених представників Учасників торгів, і несе відповідальність за їх дії.
- 4.2. Порядок ведення переліку Уповноважених представників Учасників біржових торгів на строковому ринку встановлюються Правилами Біржі.
- 4.3. Учасник біржових торгів на строковому ринку зобов'язаний негайно повідомити Біржу про припинення повноважень Уповноваженого представника Учасника біржових торгів на строковому ринку і несе ризик несприятливих наслідків порушення цього обов'язку.

Стаття 5. Відповідальність

- 5.1. Учасник біржових торгів на строковому ринку несе відповідальність перед Біржею, Центральним контрагентом і своїми Клієнтами за дії своїх Уповноважених представників, що здійснюються в ЕТС.
- 5.2. Біржа контролює діяльність Учасників біржових торгів на строковому ринку, пов'язану з їх участю в Торгах, дотримання ними внутрішніх документів Біржі і законодавства України.
- 5.3. Заходи дисциплінарної дії до Учасників біржових торгів на строковому ринку у випадках порушення ними документів Біржі і вимог законодавства України визначаються Дисциплінарним кодексом Біржі.

РОЗДІЛ III ПОРЯДОК ОРГАНІЗАЦІЇ ТА ПРОВЕДЕННЯ БІРЖОВИХ ТОРГІВ

Стаття 6. Торговельний день

- 6.1. Торговельні дні встановлюються Біржовою Радою з урахуванням вимог чинного законодавства.
- 6.2. Початок торговельного дня – 10:30, закінчення торговельного дня – 17:30, якщо інше не визначено Біржовою Радою.
- 6.3. Протягом Торговельного дня може відбуватися декілька Торговельних сесій. Момент початку і закінчення Торговельних сесій в межах одного Торговельного дня визначаються Головою Правління Біржі або уповноваженою ним особою.
- 6.4. Біржова рада за погодженням з державним представником на Біржі має право змінювати час початку та/або закінчення Торговельного дня з урахуванням вимог законодавства України. Інформація про рішення, які прийняті Біржовою радою відповідно з цим пунктом, доводяться до відома Учасників торгів на строковому ринку не пізніше ніж за 3 (три) робочих дні до дати набуття ними чинності. Повідомлення здійснюється за допомогою ЕТС, а також шляхом розміщення відповідної інформації на веб-сайті Біржі.
- 6.5. У Секції строкового ринку Торги проводяться в наступному порядку:
 - 6.5.1. Торговельна сесія. Протягом Торговельної сесії Учасники біржових торгів на строковому ринку мають право подавати Заявки, передбачені статтею 9 Правил торгівлі в Секції строкового ринку. Виконання Заявок здійснюється на принципах безперервного подвійного аукціону зустрічних Заявок.
 - 6.5.2. Якщо Угодою про систему заходів щодо зниження ризиків передбачено проведення процедури розрахунку ринкових ризиків і визначення зобов'язань по перерахуванню Варіаційної маржі двічі в день, то Біржа проводить в ході Торговельної сесії денну клірингову сесію. На час її проведення Біржа призупиняє Торги. Час початку та закінчення періоду призупинення Торгів в цілях проведення денної клірингової сесії визначається рішенням Правління Біржі.
 - 6.5.3. У випадку, якщо відповідно до Угоди про систему заходів щодо зниження ризиків в ході Торговельної сесії виникає необхідність зміни Верхнього і Нижнього лімітів коливань цін Строкового контракту, Біржа призупиняє можливість укладання такого Строкового контракту на Торгах для зміни вказаних лімітів.

Стаття 7. Зразкова форма Строкового контракту

- 7.1. На Торгах можуть укладатись Ф'ючерсні контракти та Опціони.
- 7.2. Біржа затверджує Зразкову форму Строкового контракту, яка є частиною Правил торгівлі в Секції строкового ринку ПАТ «Українська біржа», та реєструє її в Комісії.
- 7.3. Зразкова форма Строкового контракту вводиться в дію після реєстрації її в Комісії з дати, встановленої рішенням Біржі.
- 7.4. Інформація про введення в дію Зразкової форми Строкового контракту доводиться Біржею до відома Учасників біржових торгів на строковому ринку, зокрема Центрального контрагента, шляхом публікації на Сайті Біржі не раніше ніж за 1 (один) Торговельний день до введення її в дію.
- 7.5. На умовах введеної в дію Зразкової форми Ф'ючерсних контрактів можуть укладатись Ф'ючерсні контракти з різними Датами виконання.
- 7.6. На умовах введеної в дію Зразкової форми Опціонів можуть укладатись Опціони з різним Видом опціонів і Серією опціонів.

- 7.7. Біржа має право за узгодженням з Комісією внести зміни і доповнення в Зразкову форму Строкового контракту.
- 7.7.1. Наслідки внесення змін і доповнень в Зразкову форму Строкового контракту встановлюються цією Зразковою формою Строкового контракту.
- 7.7.2. Порядок повідомлення Учасників біржових торгів на строковому ринку про внесення змін і доповнень до Зразкової форми Строкового контракту встановлюються такою Зразковою формою Строкового контракту.
- 7.8. Можливість укладання Строкового контракту на умовах введеної в дію Зразкової форми Строкового контракту встановлюється рішенням Біржі.
- 7.8.1. Рішення Біржі про можливість укладання Ф'ючерсних контрактів повинно містити:
- Посилання на Зразкову форму Ф'ючерсного контракту;
 - Дату виконання Ф'ючерсного контракту;
 - Код (позначення) Ф'ючерсного контракту;
 - короткий Код (позначення) Ф'ючерсного контракту;
 - дату першого і останнього Торговельного дня, в ході якого може бути укладений Ф'ючерсний контракт з даною Датою виконання;
 - мінімальна можлива зміна ціни при подачі Заявки на укладання Ф'ючерсного контракту в ході Торгів (мінімальний крок ціни).
- 7.8.2. Рішення Біржі про можливість укладання Опціонів повинно містити:
- Посилання на Зразкову форму Опціону;
 - Вид опціону;
 - дату закінчення Строку дії;
 - Ціну виконання опціону (страйк);
 - Код (позначення) Опціону;
 - короткий Код (позначення) Опціону;
 - Код (позначення) Ф'ючерсного контракту, який є базовим активом Опціону (вказується лише для Опціонів, базовим активом яких є Ф'ючерсний контракт);
 - дату першого і останнього Торговельного дня, в ході якого може бути укладений Опціон з даним Видом опціонів і Серією опціонів.
 - мінімальна можлива зміна ціни при подачі Заявки на укладання Опціону в ході Торгів (мінімальний крок ціни).
- 7.9. Рішенням Біржі про можливість укладання Строкового контракту може встановлюватись особливості порядку виконання Строкових контрактів згідно статті 19 цих Правил.

Стаття 8. Заявки

- 8.1. Строкові контракти на Торгах укладаються на підставі Заявок.
- 8.2. Дві Заявки на укладання Строкового контракту вважаються зустрічними, а одна з них зустрічною по відношенню до іншої згідно Правил торгівлі в Секції строкового ринку, якщо одночасно виконуються наступні умови:
- одна із Заявок є Заявкою на купівлю, а інша - Заявкою на продаж;
 - вказані Заявки відносяться до одного і тогож виду (адресні / безадресні);
 - вказані Заявки містять однаковий Код (позначення) Строкового контракту;
 - ціна в Заявці на купівлю перевищує або дорівнює ціні в Заявці на продаж.
- 8.2.1. Для адресних Заявок додатковою умовою визнання їх зустрічними є збіг для кожної Заявки з пари Заявок Учасника біржових торгів на строковому ринку, що подав цю Заявку, з Учасником біржових торгів на строковому ринку, якому адресована інша Заявка.

Стаття 9. Види Заявок

9.1. Адресні і безадресні Заявки. Заявки, адресовані (інформація про які розкривається) всім Учасникам біржових торгів на строковому ринку, визнаються безадресними. Усі інші Заявки визнаються адресними.

Інформація про подану адресну Заявку доводиться лише до Учасника біржових торгів на строковому ринку, якому адресована Заявка.

Стаття 10. Зміст Заявки

10.1. Заявка повинна містити наступні реквізити:

- a) код розділу реєстра обліку позицій, що містить код Учасника біржових торгів на строковому ринку, що подав Заявку;
- b) вид Заявки (адресна / безадресна);
- c) код Учасника біржових торгів на строковому ринку, якому адресована Заявка (вказується, якщо Заявка є адресною);
- d) напрямок Заявки (Заявка на купівлю або Заявка на продаж);
- e) Код (позначення) Строкового контракту;
- f) ціну;
- g) кількість Строкових контрактів, які можуть бути укладені на підставі Заявки (кількість оферт на укладання Строкових контрактів).

10.2. Заявка може також містити дату закінчення строку дії Заявки (строку, встановленого для акцепту оферт, складових Заявки).

10.3. Невиконана Заявка може бути відкликана Учасником біржових торгів на строковому ринку в порядку, встановленому Правилами торгівлі в Секції строкового ринку.

10.4. Ціна, вказана в Заявці, є пропозицією укласти Строкові контракти за ціною, вказаною в Заявці, або за вигіднішою ціною, яка визначається відповідно до статті 16 Правил торгівлі в Секції строкового ринку.

Стаття 11. Подання Заявок

11.1. Учасники біржових торгів на строковому ринку подають Заявки з використанням Робочої станції (Шлюзу) шляхом заповнення Уповноваженим представником Учасника біржових торгів на строковому ринку форми (реквізитів) Заявки і відправки її в ЕТС.

11.2. Біржа негайно реєструє подану Учасником біржових торгів на строковому ринку Заявку в Реєстрі Заявок, за винятком наступних випадків:

- a) припинений доступ Учасника біржових торгів на строковому ринку до Торгів в Секції строкового ринку;
- b) Заявка подана з порушенням вимог до змісту Заявки, встановлених Правилами торгівлі в Секції строкового ринку;
- c) Заявка є зустрічною по відношенню до раніше поданої Заявки, поданої з вказівкою такого ж коду розділу реєстра обліку позицій;
- d) Ціна, вказана в Заявці, поданий з метою укладання Строкового контракту, вища за Верхній ліміт коливань цін або нижча за Нижній ліміт коливань цін, встановлених для даного Строкового контракту;
- e) Заявка подана в період призупинення Торгів;
- f) не дотримується визначена Угодою про систему заходів щодо зниження ризиків умова забезпеченості зобов'язань за Строковими контрактами, які враховуватимуться на розділі реєстру обліку позицій, код якого вказаний в Заявці, після укладання Строкових контрактів на підставі даної Заявки і раніше поданих Заявок. Перевірка дотримання вказаної умови здійснюється для Групи об'єднаних розділів грошового реєстра, код якої визначається кодом розділу реєстра обліку позицій, вказаним в Заявці, і для Учасника біржових торгів на строковому ринку в цілому.

- 11.3. Заявка вважається поданою з моменту її реєстрації в Реєстрі Заявок.
- 11.4. Зареєстрована Біржею Заявка Учасника біржових торгів на строковому ринку є згодою цього Учасника біржових торгів на строковому ринку укласти і виконати Строкові контракти відповідно до Правил торгівлі в Секції строкового ринку.
- 11.5. Вилучення Заявки (вилучення оферт, складових Заявки) здійснюється Учасником біржових торгів на строковому ринку з використанням Робочої станції (Шлюзу) шляхом заповнення відповідної Заявки і відправки її в ЕТС.
- 11.6. В разі призупинення Торгів Учасники біржових торгів на строковому ринку мають можливість вилучати раніше подані Заявки.

Стаття 12. Строк дії Заявок

- 12.1. Заявка, що не містить дату закінчення строку дії Заявки, діє до її повного (або часткового) виконання, або до її вилучення, або до закінчення Торговельної сесії поточного Торговельного дня.
- 12.2. Заявка, що містить дату закінчення строку дії Заявки, що припадає на день до дати Торговельного дня, що є останнім днем укладання вказаного в Заявці Строкового контракту, діє до її повного (або часткового) виконання, або до її вилучення, або до закінчення Торговельної сесії, що проводиться у вказану дату.
- 12.3. Заявка, що містить дату закінчення строку дії Заявки, що припадає на дату Торговельного дня, що є останнім днем укладання вказаного в Заявці Строкового контракту, або на дату після такого Торговельного дня, діє до її повного (або часткового) виконання, або до її вилучення, або до закінчення Торговельної сесії в дату, що є останнім днем укладання даного Строкового контракту.
- 12.4. Заявка перестає діяти, якщо призупинений доступ Учасника біржових торгів на строковому ринку до Торгів в Секції строкового ринку.
- 12.5. Заявка, подана з метою укладання Строкового контракту, перестає діяти в разі, якщо після закінчення клірингової сесії ціна, вказана в Заявці на купівлю, вища за Верхній ліміт коливань цін, встановлений для такого Строкового контракту або ціна, вказана в Заявці на продаж, нижча за Нижній ліміт коливань цін, встановлених для такого Строкового контракту.
- 12.6. Заявка перестає діяти, якщо після закінчення клірингової сесії не дотримується визначена Угодою про систему заходів щодо зниження ризиків умова забезпеченості зобов'язань за Строковими контрактами, які враховуватимуться на розділі реєстра обліку позицій, код якого вказаний в Заявці, після укладання Строкових контрактів на підставі даної Заявки і раніше поданих Заявок.

Перевірка дотримання вказаної умови здійснюється для Групи об'єднаних розділів грошового реєстра, код якої визначається кодом розділу реєстра обліку позицій, вказаних в Заявці, і для Учасника біржових торгів на строковому ринку в цілому.

Стаття 13. Порядок формування Реєстру Заявок

- 13.1. Біржа формує і веде Реєстр Заявок.
- 13.2. Реєстр Заявок містить:
 - а) ідентифікаційний номер Заявки;
 - б) відомості, що містяться в поданій Заявці, перераховані в пункті 10.1 Правил торгівлі в Секції строкового ринку;
 - в) дату і час реєстрації Заявки;
 - г) дату закінчення строку дії Заявки (в разі, якщо вона вказана в Заявці);
 - д) дату і час виконання (повного або часткового), вилучення або призупинення дії Заявки;

- f) результат подання Заявки (виконана повністю, виконана частково, вилучена, закінчився строк дії, перестала діяти).

13.3. У випадку, якщо Заявка виконана частково, її невиконана частина залишається в Реєстрі Заявок з тим самим ідентифікаційним номером Заявки, ціною, датою і часом реєстрації Заявки.

Стаття 14. Укладання Строкових контрактів на Торгах

14.1. Подання Учасником біржових торгів на строковому ринку заявки означає, що Учасник торгів подав, а Центральний контрагент отримав оферту на укладення контракту відповідно до цих Правил.

14.2. В момент подання зустрічної Заявки по відношенню до поданої Заявки, Центральний контрагент зобов'язаний прийняти (акцептувати) оферти, зроблені шляхом подання вказаних Заявок.

14.3. Центральний контрагент акцептує оферти, які зробили Учасники біржових торгів на строковому ринку, шляхом направлення їм відповідного повідомлення (акцептів) з вказівкою кількості оферт, що акцептуються та ціною укладених Строкових контрактів. Вказані повідомлення не є заявками. При цьому кількість оферт (укладених Строкових контрактів), що акцептуються, вказана в повідомленнях, що направляються Центральним контрагентом Учасникам біржових торгів на строковому ринку, що подали зустрічні Заявки, дорівнює меншій кількості Строкових контрактів з вказаних в таких Заявках. Ціна Строкових контрактів, укладених на підставі зустрічних Заявок, визначається в порядку, встановленому статтею 16 Правил торгівлі в Секції строкового ринку.

14.4. Повідомлення Центрального контрагента про акцептування оферт, зроблених Учасниками біржових торгів на строковому ринку, направляються Учасникам біржових торгів на строковому ринку через Робочу станцію ЕТС Біржі. Момент надходження такого повідомлення вважається моментом укладання контракту Центрального контрагента з ними.

14.5. В ході проведення процедури примусового закриття позицій Учасника біржових торгів на строковому ринку, Центральний контрагент має право прийняти (акцептувати) усі або частину оферт, зроблених за допомогою подання Заявки, відносно якої відсутня зустрічна Заявка. При цьому Строкові контракти укладаються за ціною, вказаною в Заявці, кількість укладених Строкових контрактів дорівнює кількості оферт, що акцептуються.

Порядок проведення процедури примусового закриття позицій визначений Угодою про систему заходів щодо зниження ризиків.

14.6. Центральний контрагент укладає Строкові контракти з Учасниками біржових торгів на строковому ринку виключно для цілей:

- забезпечення режиму повної анонімності в процесі Торгів і розрахунків за Строковими контрактами, укладеними на Торгах;
- зниження ризиків невиконання Строкових контрактів, укладених на Торгах.

14.7. Усі Строкові контракти, укладені, на Торгах вважаються укладеними в м. Києві.

Стаття 15. Порядок формування Реєстру контрактів

15.1. Біржа реєструє Строкові контракти, укладені на Торгах, в Реєстрі контрактів.

15.2. Реєстрація Строкових контрактів здійснюється Біржею по мірі їх укладання.

15.3. Реєстр контрактів містить:

- a) ідентифікаційний номер запису Реєстру контракту;
- b) ідентифікаційний номер Заявки, на підставі якої укладені Строкові контракти;
- c) дату та час реєстрації Строкових контрактів;

- d) код розділу реєстру обліку позицій, що містить код Учасника біржових торгів на строковому ринку, що уклав Строкові контракти;
- e) Код (позначення) Строкового контракту;
- f) Інформацію про те, що Строкові контракти укладені на підставі адресної або безадресної Заявки;
- g) ціну укладених Строкових контрактів;
- h) кількість укладених Строкових контрактів.

15.4. Біржа має право включати в Реєстр контрактів інші відомості, окрім передбачених пунктом 15.3 цієї статті.

Стаття 16. Визначення ціни укладених Строкових контрактів

- 16.1. При укладанні Строкових контрактів на підставі зустрічних Заявок, Строкові контракти укладають за ціною, вказаною в раніше поданій Заявці.
- 16.2. За наявності в Реєстрі Заявок декількох поданих Заявок, зустрічних по відношенню до нової Заявки, Строкові контракти укладаються на підставі Заявки (Заявок), що містять найбільш вигідну для нової Заявки ціну.
- 16.2.1. Найбільш вигідною ціною для нової Заявки на продаж є найбільша з цін в раніше поданих Заявках на купівлю.
- 16.2.2. Найбільш вигідною ціною для нової Заявки на купівлю є найменша з цін в раніше поданих Заявках на продаж.
- 16.3. Якщо зустрічні по відношенню до новоподаної Заявки містять однакові ціни, вони виконуються в порядку їх реєстрації в Реєстрі Заявок.

Стаття 17. Порядок дій у випадках виникнення технічних збоїв в ЕТС

- 17.1. Біржа, діючи розумно і передбачливо, приймає заходи, необхідні для профілактики і недопущення виникнення технічних збоїв в ЕТС.
- 17.2. В разі виявлення Біржею обставин, що з'явилися в результаті технічного збою і що роблять неможливим продовження надання послуг, пов'язаних з організацією торгівлі, Біржа фіксує факт і час технічного збою в Журналі технічних збоїв, припиняє Торги і негайно приймає заходи, направлені на:
- виявлення і усунення причин, що викликали технічний збій;
 - усунення технічних наслідків збоїв;
 - забезпечення збереження інформації, що знаходиться в ЕТС, і відновлення інформації, втраченої в результаті технічного збою.
- 17.3. В разі технічного збою, що робить неможливим роботу окремого Уповноваженого представника Учасника біржових торгів на строковому ринку, причини збою усуваються силами і засобами Учасника біржових торгів на строковому ринку, якщо збої виникли по незалежних від Біржі причинах, в інших випадках – силами і засобами Біржі.
- 17.4. При неможливості оперативного усунення збоїв Уповноважений представник Учасника біржових торгів на строковому ринку за допомогою телефонного зв'язку може надати Біржі заяву на вилучення поданих ним Заявок. Не пізніше ніж на наступний день, після дня надання заявки по телефону, вказана заява спрямовується на Біржу в письмовій або електронній формі. Оператор ЕТС протягом 5 (п'яти) хвилин після отримання заяви по телефону здійснює вилучення Заявок, поданих цим Уповноваженим представником Учасника біржових торгів на строковому ринку, з ЕТС.
- 17.5. При виявленні збоїв в ЕТС Оператор ЕТС має право прийняти рішення про призупинення Торгів, про що Уповноважені представники Учасників біржових торгів на строковому ринку сповіщаються з використанням ЕТС або іншого доступного способу. Після відновлення працездатності ЕТС Торги поновлюються.

- 17.6. Якщо протягом 20 (двадцяти) хвилин відновити працездатність ЕТС не представляється можливим, Оператор ЕТС має право прийняти рішення про дострокове припинення Торгів. Дане рішення доводиться до відому всіх Учасників біржових торгів на строковому ринку з використанням ЕТС або іншого доступного способу.
- 17.7. Незважаючи на наявність технічного збою, Біржа не несе відповідальності перед Учасником біржових торгів на строковому ринку і його Клієнтами за упущену вигоду і інші витрати Учасника біржових торгів на строковому ринку і його Клієнтів.

Стаття 18. Запобігання маніпулюванню цінами

- 18.1. Учасник біржових торгів на строковому ринку не має права маніпулювати цінами, що складаються на Торгах.
- 18.2. Біржа приймає заходи по обмеженню маніпулювання цінами на Біржі в цілях:
- попередження і запобігання різкому денному підвищенню або пониженню рівня цін;
 - попередження і запобігання штучному завищенню або заниженню цін, змови або поширення неправдивих чуток з метою дії на ціни.
- 18.3. З метою запобігання штучному завищенню або заниженню цін, змови або поширення неправдивих чуток, які можуть впливати на ціни Біржа здійснює наступні заходи:
- здійснює контроль за поданими Заявками і Строковими контрактами, що укладаються на Торгах;
 - здійснює аналіз поданих Заявок і укладених Строкових контрактів за підсумками Торгів в цілях визначення фактів можливого штучного завищення або заниження цін, змови з метою штучного завищення або заниження цін;
 - проводить перевірки фактів можливого штучного завищення або заниження цін, можливої змови з метою штучного завищення або заниження цін, можливого поширення неправдивих чуток з метою дії на ціни Строкових контрактів, що укладаються на Торгах;
 - припиняє або зупиняє Торги у випадках, встановлених законодавством України і Правилами торгівлі в Секції строкового ринку;
 - проводить дисциплінарні розслідування і застосовує до Учасників біржових торгів на строковому ринку дисциплінарні заходи, передбачені Дисциплінарним кодексом Біржі.
- 18.4. При проведенні перевірок фактів можливого штучного завищення або заниження цін, можливої змови з метою штучного завищення або заниження цін, можливого поширення неправдивих чуток з метою дії на ціни Строкових контрактів, що укладаються на Торгах, Біржа має право вимагати від Учасників біржових торгів на строковому ринку надати інформацію і документи, які прямо або опосередковано стосуються відповідних Заявок або укладених Строкових контрактів, зокрема:
- пояснення Уповноважених представників Учасників біржових торгів на строковому ринку у зв'язку з поданням відповідних Заявок і укладанням відповідних Строкових контрактів;
 - копії доручень Клієнта, на підставі яких були подані відповідні Заявки і укладені Строкові контракти (якщо відповідні Заявки були подані за дорученням Клієнта);
 - копію договору з Клієнтом, на підставі якого подані відповідні доручення (якщо відповідні Заявки були подані за дорученням Клієнта);
 - пояснення Клієнта у зв'язку з подачею доручень на укладання відповідних Строкових контрактів (якщо відповідні Заявки були подані за дорученням Клієнта);
 - завірені в установленому порядку копії документів, підтверджуючих повноваження посадових осіб Учасника біржових торгів на строковому ринку на підпис від його імені запитуваних документів, а також документи, підтверджуючі зразки підписів таких посадових осіб.

Стаття 19. Дії Біржі при виникненні особливих обставин

- 19.1. Можливість укладання Строкових контрактів на Торгах припиняється / зупиняється у випадках, передбачених нормативними актами Комісії і Правилами торгівлі в Секції строкового ринку.
- 19.2. При виникненні обставин непереборної сили, а також обставин, які призводять до суттєвої зміни умов, що впливають на можливість укладання і виконання певних Строкових контрактів, Біржа має право прийняти рішення про:
- про зупинення можливості укладання на Торгах цих Строкових контрактів на строк не більше 3 (трьох) Торговельних днів;
 - про зміну умов цих Строкових контрактів, перерахованих в пункті 19.3.
- 19.3. Біржа має право змінити наступні умови Строкових контрактів:
- дату останнього Торговельного дня, в ході якого може бути укладений Строковий контракт;
 - Дату виконання Ф'ючерсного контракту;
 - дату закінчення Строку дії Опціону;
 - встановити Ціну виконання Ф'ючерсного контракту в порядку, відмінному від порядку, який встановлений Зразковою формою Ф'ючерсного контракту.
- 19.3.1. Наслідки внесення змін в умови Строкових контрактів встановлюються Зразковою формою Строкового контракту.
- 19.4. Біржа не пізніше ніж за 3 (три) робочі дні з моменту зупинення можливості укладання на Торгах Строкових контрактів проводить перевірку наявності обставин вказаних в пункті 19.2 цієї статті, достовірність джерел інформації, підтверджуючих дію цих обставин, і приймає рішення:
- про зупинення можливості укладання на Торгах даних Строкових контрактів на триваліший строк;
 - про поновлення або про припинення можливості укладання на Торгах вказаних Строкових контрактів;
 - про зміну умов цих Строкових контрактів, перерахованих в пункті 19.3.
- 19.5. Інформація про рішення, прийняті Біржею відповідно до пунктів 19.2 і 19.4 цієї статті, спрямовується до Комісії та доводиться до відома Центрального контрагента і Учасників біржових торгів на строковому ринку шляхом публікації на Сайті Біржі не менш, ніж за 1 (один) Торговельний день до набрання чинності вказаних рішень.

Стаття 20. Розміри платежів за послуги Біржі та порядок їх стягнення

- 20.1. Розмір біржового збору за реєстрацію Строкових контрактів встановлюється Тарифами, які затверджує Правління Біржі.
- 20.2. Порядок сплати біржового збору за реєстрацію Строкових контрактів визначений статтею 32 Правил торгівлі в Секції строкового ринку.

Стаття 21. Порядок вирішення спорів

- 21.1. Спори, пов'язані з укладанням і виконанням Строкових контрактів, підлягають розгляду в Арбітражній комісії Біржі.
- 21.2. Порядок діяльності Арбітражної комісії Біржі визначається Арбітражним кодексом Біржі.

Стаття 22. Додатковий функціонал Робочої станції

- 22.1. З використанням Робочої станції Учасники біржових торгів на строковому ринку можуть подавати Заяви на повернення грошових коштів.

- 22.2. Учасники біржових торгів на строковому ринку мають право з використанням Робочої станції встановлювати ліміти по розділах реєстра обліку позицій (клієнтські ліміти) в ЕТС. Учасник біржових торгів на строковому ринку з використанням даного функціонала Робочої станції здійснює контроль за дотриманням клієнтських лімітів при подачі Заявок.

РОЗДІЛ IV. ПРАВИЛА ЗДІЙСНЕННЯ КЛІРИНГУ ТА РОЗРАХУНКІВ ЗА СТРОКОВИМИ КОНТРАКТАМИ

Стаття 23. Клірингові реєстри

- 23.1. Для обліку зобов'язань, що виникають між Учасниками біржових торгів на строковому ринку і Центральним контрагентом з укладених Строкових контрактів та Угоди про систему заходів щодо зниження ризиків, Біржа використовує наступні клірингові реєстри:
- реєстр обліку позицій;
 - грошовий реєстр;
 - реєстр обліку Внесків до Страхового фонду.
- 23.2. Реєстр обліку позицій - кліринговий реєстр, на якому враховуються Строкові контракти, укладені між Учасниками біржових торгів на строковому ринку та Центральним контрагентом і не припинені в порядку, що передбачений Угодою про систему заходів щодо зниження ризиків.
- 23.3. Грошовий реєстр - кліринговий реєстр, на якому у випадках, встановлених Правилами торгівлі в Секції строкового ринку і Угодою про систему заходів щодо зниження ризиків, враховуються зобов'язання по перерахуванню грошових коштів, що виникають між Учасниками біржових торгів на строковому ринку і Центральним контрагентом.
- 23.4. Реєстр обліку Внесків до Страхового фонду - кліринговий реєстр, на якому враховується зобов'язання Центрального контрагента по перерахуванню (поверненню) Учасникам біржових торгів на строковому ринку грошових коштів - Внесків до Страхового фонду.
- 23.5. Для ведення додаткового аналітичного обліку взаємних зобов'язань Центрального контрагента і певного Учасника біржових торгів на строковому ринку Біржа відкриває розділи клірингових реєстрів.
- 23.6. Порядок відкриття і закриття розділів клірингових реєстрів визначений в додатку № 3 до Правил торгівлі в Секції строкового ринку.
- 23.7. Під закриттям розділу клірингового реєстра розуміється припинення ведення Біржею аналітичного обліку взаємних зобов'язань Центрального контрагента і певного Учасника біржових торгів на строковому ринку.
- 23.8. Значення, що враховуються на розділах клірингових реєстрів, підлягають відображенню в звітах Біржі, які надаються Учасникам біржових торгів на строковому ринку відповідно до Правил торгівлі в Секції строкового ринку.
- 23.9. Біржа в режимі реального часу надає Центральному контрагенту інформацію про значення, що враховуються на розділах клірингових реєстрів, в цілях функціонування системи заходів зниження ризиків щодо невиконання Строкових контрактів, створеною Центральним контрагентом відповідно до Угоди про систему заходів щодо зниження ризиків.

Стаття 24. Облік зобов'язань за Строковими контрактами

- 24.1. На розділі реєстру обліку позицій Біржею враховуються:
- код (позначення) Строкового контракту;
 - кількість Строкових контрактів, що мають цей код (позначення).
- 24.2. Кількість Строкових контрактів враховується із знаком, який визначається в залежності від того покупцем або продавцем за даними Строковим контрактам є Учасник біржових торгів на строковому ринку, для обліку зобов'язань якого по відношенню до Центрального контрагента Біржею відкритий розділ реєстра обліку позицій.
- Кількість Строкових контрактів враховується із знаком «мінус», якщо Учасник біржових торгів на строковому ринку є продавцем, із знаком «плюс» - якщо покупцем.

- 24.3. Укладені Строкові контракти підлягають обліку на розділі реєстра обліку позицій, код якого був вказаний Учасником біржових торгів на строковому ринку в Заявці на укладання вказаного Строкового контракту.
- 24.4. Ф'ючерсні контракти, які укладені в результаті виконання Опціону, базовим активом якого є цей Ф'ючерсний контракт, підлягають обліку на розділі реєстра обліку позицій, на якому враховувалися відповідні Опціони.
- 24.5. При укладанні Строкового контракту, за яким Учасник біржових торгів на строковому ринку є покупцем (продавцем), Біржа враховує Строковий контракт на розділі реєстру обліку позицій таким чином:
- якщо на розділі реєстру обліку позицій не враховуються Строкові контракти з таким самим кодом, то Біржа починає враховувати такі Строкові контракти, за якими Учасник біржових торгів на строковому ринку є покупцем (продавцем) на відповідному розділі реєстру обліку позицій;
 - якщо на розділі реєстру обліку позицій враховуються Строкові контракти, за якими Учасник біржових торгів на строковому ринку є покупцем (продавцем), з таким самим кодом, як код Строкових контрактів, укладених раніше, то кількість Строкових контрактів, що враховуються на розділі реєстра обліку позицій, збільшується на кількість укладених Строкових контрактів;
 - якщо на розділі реєстру обліку позицій враховуються Строкові контракти, за якими Учасник біржових торгів на строковому ринку є продавцем (покупцем), з таким самим кодом, як код Строкових контрактів, укладених раніше, то Строкові контракти, який вже враховується на розділі реєстра обліку позицій, і укладений Строковий контракт достроково припиняються в порядку, визначеному Угодою про систему заходів щодо зниження ризиків.
- 24.5.1. При обліку на розділі реєстру обліку позицій Строкового контракту, за яким Учасник біржових торгів на строковому ринку є покупцем, значення, що враховується на розділі реєстра обліку позицій, збільшується на одиницю.
- 24.5.2. При обліку на розділі реєстра обліку позицій Строкового контракту, за яким Учасник біржових торгів на строковому ринку є продавцем, значення, що враховується на розділі реєстра обліку позицій, зменшується на одиницю.
- 24.6. Біржа може змінити облік Строкових контрактів на розділах реєстра обліку позицій, відкритих для обліку Строкових контрактів Учасника біржових торгів на строковому ринку по відношенню до Центрального контрагента, на підставі заяви Учасника біржових торгів на строковому ринку за формою F05, передбаченою додатком № 1 до Правил торгівлі в Секції строкового ринку або при застосуванні до Учасника біржових торгів на строковому ринку процедури примусового закриття позицій в порядку, визначеному Угодою про систему заходів щодо зниження ризиків.
- Зміна обліку Строкових контрактів на розділах реєстра обліку позицій на підставі заяви Учасника біржових торгів на строковому ринку здійснюється Біржею, якщо така зміна не приведе до недотримання визначеного Угодою про систему заходів щодо зниження ризиків умови забезпеченості зобов'язань за Строковими контрактами даного Учасника біржових торгів на строковому ринку.
- Для виконання вказаної зміни обліку, Строкові контракти знімаються Біржею з обліку з одного розділу реєстра обліку позицій і ставляться на облік на інший розділ реєстра обліку позицій в порядку, визначеному цією статтею для зобов'язань що виникли за Строковим контрактом.

Стаття 25. Облік зобов'язань по перерахуванню грошових коштів

- 25.1. На розділах грошового реєстра Біржею враховується або кредиторська заборгованість Центрального контрагента перед Учасником біржових торгів на строковому ринку, що відображає зобов'язання Центрального контрагента по перерахуванню грошових коштів Учасникові біржових торгів на строковому ринку, або дебіторська заборгованість Учасника біржових торгів на строковому ринку перед Центральним контрагентом, що відображає зобов'язання Учасника біржових торгів на строковому ринку по перерахуванню грошових коштів Центральному контрагентові. Кредиторська заборгованість враховується із знаком «плюс», дебіторська – із знаком «мінус».

25.2. Біржа враховує зобов'язання Центрального контрагента по перерахуванню грошових коштів Учасникові біржових торгів на строковому ринку (зобов'язання Учасника біржових торгів на строковому ринку по перерахуванню грошових коштів Центральному контрагенту) на розділі грошового реєстра, що виникло за Строковим контрактом або з Угоди про систему заходів щодо зниження ризиків таким чином:

- якщо на розділі грошового реєстра враховується нульове значення, то Біржа починає враховувати кредиторську (дебіторську) заборгованість на розділі грошового реєстра в об'ємі зобов'язання що виникло;
- якщо на розділі грошового реєстра враховується кредиторська (дебіторська) заборгованість, то розмір даної кредиторської (дебіторською) заборгованості збільшується на об'єм зобов'язання що виникло;
- якщо на розділі грошового реєстра враховується дебіторська (кредиторська) заборгованість, зобов'язання що виникло Центрального контрагента по перерахуванню грошових коштів Учасникові біржових торгів на строковому ринку (зобов'язання Учасника біржових торгів на строковому ринку по перерахуванню грошових коштів Центральному контрагенту) взаємозаліковується з вимогою Центрального контрагента до Учасника біржових торгів на строковому ринку (Учасника біржових торгів на строковому ринку до Центрального контрагента) про перерахування грошових коштів, що враховується на даному розділі грошового реєстра, в порядку, визначеному Угодою про систему заходів щодо зниження ризиків.

25.2.1. При обліку на розділі грошового реєстра зобов'язання Центрального контрагента по перерахуванню грошових коштів Учасникові біржових торгів на строковому ринку значення, що враховується на розділі грошового реєстра, збільшується на об'єм вказаного зобов'язання.

25.2.2. При обліку на розділі грошового реєстра зобов'язання Учасника біржових торгів на строковому ринку по перерахуванню грошових коштів Центральному контрагенту значення, що враховується на розділі грошового реєстра, зменшується на об'єм вказаного зобов'язання.

25.3. Біржа може змінити облік зобов'язань по перерахуванню грошових коштів на розділах грошового реєстра, на підставі заяви Учасника біржових торгів на строковому ринку за формою G03, передбаченою додатком № 1 до Правил торгівлі в Секції строкового ринку.

Зміна обліку зобов'язань по перерахуванню грошових коштів на розділах грошового реєстра на підставі заяви Учасника біржових торгів на строковому ринку здійснюється Біржею, якщо така зміна не приведе до недотримання визначеного Угодою про систему заходів щодо зниження ризиків умови забезпеченості зобов'язань за Строковими контрактами даного Учасника біржових торгів на строковому ринку.

Для виконання вказаної зміни обліку, зобов'язання по перерахуванню грошових коштів знімаються Біржею з обліку з одного розділу грошового реєстра і ставляться на облік на інший розділ грошового реєстра в порядку, визначеному цією статтею для зобов'язання що виникло по перерахуванню грошових коштів.

Стаття 26. Облік зобов'язань по поверненню коштів Страхового фонду

26.1. На розділах реєстра обліку Внесків до Страхового фонду Біржею враховується кредиторська заборгованість Центрального контрагента перед Учасником біржових торгів на строковому ринку, що відображає зобов'язання Центрального контрагента по перерахуванню (поверненню) Учасникові біржових торгів на строковому ринку грошових коштів, які є Внеском до Страхового фонду цього Учасника біржових торгів на строковому ринку. Кредиторська заборгованість враховується із знаком «плюс».

26.2. Порядок виникнення і припинення (виконань) зобов'язань по перерахуванню (поверненню) Учасникам біржових торгів на строковому ринку грошових коштів, які є Внеском до Страхового фонду даних Учасників біржових торгів на строковому ринку, визначений Положенням про страховий і резервний фонди, яке є додатком до Угоди про систему заходів щодо зниження ризиків.

- 26.3. Біржа враховує зобов'язання, яке виникло у Центрального контрагента по перерахуванню (поверненню) Учасникові біржових торгів на строковому ринку грошових коштів, які є Внеском до Страхового фонду даного Учасника біржових торгів на строковому ринку, на розділі реєстра обліку Внесків до Страхового фонду таким чином:
- якщо на даному розділі враховується нульове значення, то Біржа починає враховувати кредиторську заборгованість Центрального контрагента перед Учасником біржових торгів на строковому ринку в об'ємі зобов'язання яке виникло;
 - якщо на даному розділі грошового реєстра враховується кредиторська заборгованість Центрального контрагента перед Учасником біржових торгів на строковому ринку, то розмір даної кредиторської заборгованості збільшується на об'єм зобов'язання яке виникло.
- 26.3.1. Значення, що враховується на розділі реєстра обліку Внесків до Страхового фонду, збільшується на об'єм зобов'язання яке виникло у Центрального контрагента по перерахуванню (поверненню) Учасникові біржових торгів на строковому ринку грошових коштів, які є Внеском до Страхового фонду цього Учасника біржових торгів на строковому ринку.

Стаття 27. Порядок проведення клірингових сесій

- 27.1. У кожен Торговельний день Біржа проводить вечірню клірингову сесію і може проводити денну клірингову сесію у випадку, якщо Угодою про систему заходів щодо зниження ризиків передбачено проведення процедури розрахунку ринкових ризиків і визначення зобов'язань по перерахуванню Варіаційної маржі двічі в день.
- 27.2. Вечірня клірингова сесія проводиться Біржею відразу після закінчення Торгів в Секції строкового ринку.
- 27.3. Денна клірингова сесія проводиться в ході Торговельної сесії в Секції строкового ринку в строк, встановлений рішенням Біржі.
- 27.4. В ході денної клірингової сесії Біржа:
- 1) здійснює облік на розділах реєстра обліку позицій зобов'язань, що виникли в результаті виконання Опціонів, по яким здійснена вимога прав їх Утримувача
 - 2) змінює облік зобов'язань за Строковими контрактами на розділах реєстра обліку позицій при проведенні процедури примусового закриття позицій;
 - 3) змінює облік зобов'язань за Строковими контрактами на розділах реєстра обліку позицій на підставі заяв Учасників біржових торгів на строковому ринку;
 - 4) визначає нові значення параметрів системи заходів щодо зниження ризиків невиконання Строкових контрактів;
 - 5) визначає зобов'язання по перерахуванню Варіаційної маржі і враховує їх на розділах грошового реєстра;
 - 6) за Опціонами, укладеними в період часу з моменту закінчення попередньої і до моменту початку поточної клірингової сесії, враховує зобов'язання по перерахуванню Премії на розділах грошового реєстра;
 - 7) враховує на розділах реєстра обліку позицій Строкові контракти, укладені в період часу з моменту закінчення попередньої і до моменту початку поточної клірингової сесії і достроково припиняє Строкові контракти в порядку передбаченому Угодою про систему заходів щодо зниження ризиків;
 - 8) враховує на розділах грошового реєстра інші, окрім вказаних в підпунктах 5), 6) цього пункту, зобов'язання по перерахуванню грошових коштів, які передбачені Правилами торгівлі в Секції строкового ринку, Угодою про систему заходів щодо зниження ризиків та укладеними з Учасниками біржових торгів на строковому ринку договорами;
 - 9) змінює облік зобов'язань по перерахуванню грошових коштів на розділах грошового реєстра на підставі заяв Учасників біржових торгів на строковому ринку;
 - 10) розраховує Початкову маржу;
 - 11) перевіряє дотримання умови забезпеченості зобов'язань за Строковими контрактами по кожному Учасникові біржових торгів на строковому ринку і, в разі недотримання, згідно з Угодою про систему заходів щодо зниження ризиків, направляє Учасникові

біржових торгів на строковому ринку звіт, який містить Маржинальну вимогу Центрального контрагента;

12) формує звіти для Учасників біржових торгів на строковому ринку.

27.5. В ході вечірньої клірингової сесії Біржа крім дій, перерахованих в пункті 27.4 цієї статті:

- 1) припиняє на розділах реєстра обліку позицій облік Опціонних контрактів, які припинені внаслідок того, що право вимоги за ними не було реалізовано їх Утримувачами та у даних Опціонів закінчився Строк дії;
- 2) здійснює облік на розділах грошового реєстра зобов'язань, що виникли в результаті виконання розрахункових Ф'ючерсних контрактів з Датою виконання, що настала;
- 3) здійснює реєстрацію і анулювання реєстрації Учасників біржових торгів на строковому ринку і їх Клієнтів;
- 4) здійснює відкриття і закриття розділів клірингових реєстрів.

27.6. Кліринг за Строковими контрактами здійснюється на підставі Реєстру контрактів.

Стаття 28. Порядок виконання Опціонів

28.1. Виконання Опціонів проводиться при отриманні Центральним контрагентом, що є Підписчиком, від Учасника біржових торгів на строковому ринку, що є Утримувачем, заяви про вимогу прав за Опціоном. Якщо виконання Опціону призводить до виникнення у Учасника біржових торгів на строковому ринку Маржинальної вимоги, Центральний контрагент має право не приймати від Учасника біржових торгів на строковому ринку заяву про вимогу прав за Опціоном.

28.1.1. Заява про вимогу прав за Опціоном подається Учасниками біржових торгів на строковому ринку з використанням ЕТС. Біржа передає Центральному контрагенту інформацію про подані заяви про вимогу прав за Опціоном.

28.2. При отриманні від Біржі інформації про подану заяву про вимогу прав за Опціоном, Центральний контрагент здійснює вимогу прав за Опціоном такої ж серії, по якому Центральний контрагент є Утримувачем.

28.2.1. Вибір Підписчика здійснюється Центральним контрагентом по даті та часу укладання Опціонів, починаючи з самих ранніх.

28.3. В результаті виконання Опціону, базовим активом якого є Ф'ючерсний контракт, між Учасником біржових торгів на строковому ринку та Центральним контрагентом укладається Ф'ючерсний контракт що є базовим активом Опціону. Укладання Ф'ючерсного контракту здійснюється в порядку, що передбачений Угодою про систему заходів щодо зниження ризиків (ст.16).

З метою визначення, відповідно до Угоди про систему заходів щодо зниження ризиків, зобов'язань по перерахуванню Варіаційної маржі за Ф'ючерсним контрактом, який був укладений в результаті виконання Опціону, ціна виконання Опціону (ціна страйк) вважається Ціною укладання Ф'ючерсного контракту.

28.3.1. Облік Ф'ючерсних контрактів, що були укладені в результаті виконання Опціону, здійснюється відповідно до статті 24 Правил торгівлі в Секції строкового ринку за відповідним Ф'ючерсним контрактом.

Облік виконаного Опціону на розділі реєстра обліку позицій припиняється.

28.3.2. Якщо Ф'ючерсні контракти, що були укладені в результаті виконання Опціону, не були припинені в порядку, визначеному Угодою про систему заходів щодо зниження ризиків, за даним Ф'ючерсним контрактом розраховується Варіаційна маржа в порядку, визначеному Угодою про систему заходів щодо зниження ризиків.

28.3.3. Припинення зобов'язань за Ф'ючерсними контрактами, що були укладені в результаті виконання Опціону, здійснюється в порядку, встановленому Угодою про систему заходів щодо зниження ризиків.

Стаття 29. Порядок виконання розрахункових Ф'ючерсних контрактів в Дату виконання

- 29.1. В Дату виконання розрахункового Ф'ючерсного контракту настає строк виконання зобов'язань за Ф'ючерсним контрактом, та виникають зобов'язання з датою виконання, що наступила, встановлені Зразковою формою Ф'ючерсного контракту.

Стаття 30. Порядок виконання Ф'ючерсних контрактів з поставкою, базовим активом яких є цінні папери, в Дату виконання

- 30.1. Особливості виконання зобов'язань за Ф'ючерсними контрактами з поставкою, базовим активом яких є цінні папери, можуть встановлюватися рішенням Біржі про можливість укладання вказаного Ф'ючерсного контракту на Торгах.
- 30.2. В Дату виконання Біржа включає зобов'язання за Ф'ючерсними контрактами з поставкою, базовим активом яких є цінні папери, з Датою виконання, що настала, до складу зобов'язань по оплаті/перереєстрації цінних паперів, що підлягають виконанню, в порядку, визначеному статтею 31 Правил торгівлі в Секції строкового ринку.
- 30.3. Виконання (припинення), підлягаючих виконанню зобов'язань по оплаті/перереєстрації цінних паперів за Ф'ючерсними контрактами з поставкою, базовим активом яких є цінні папери, з Датою виконання, що наступила, здійснюється в порядку, визначеному Правилами Біржі для розрахунків за контрактами з цінними паперами, укладеними за участю Центрального контрагента.
- 30.4. Кожне зобов'язання за Ф'ючерсним контрактом з поставкою, базовим активом якого є цінні папери, з Датою виконання, що настала, не включене до складу зобов'язань по оплаті/перереєстрації цінних паперів, що підлягають виконанню, є невиконаним і припиняється.
- 30.4.1. За кожним зобов'язанням за Ф'ючерсним контрактом з поставкою, базовим активом якого є цінні папери, з Датою виконання, що настала, не включеному до складу зобов'язань по оплаті/перереєстрації цінних паперів, що підлягають виконанню, в зв'язку з недостатністю активів для його виконання на рахунках Учасника біржових торгів на строковому ринку, вказаний Учасник біржових торгів на строковому ринку є стороною, що не виконала, і, відповідно до Зразкової форми Ф'ючерсного контракту, зобов'язана сплатити Центральному контрагенту та Біржі штраф.
- 30.4.2. За кожним зобов'язанням за Ф'ючерсним контрактом з поставкою, базовим активом якого є цінні папери, з Датою виконання, що наступила, не включеному до складу зобов'язань по оплаті/перереєстрації цінних паперів, що підлягають виконанню, в зв'язку з недостатністю активів для його виконання на рахунках Центрального контрагента, Центральний контрагент є стороною, що не виконала, і, відповідно до Зразкової форми Ф'ючерсного контракту, зобов'язана сплатити Учаснику біржових торгів на строковому ринку штраф.
- 30.4.3. Порядок визначення розміру штрафу встановлений Угодою про систему заходів щодо зниження ризиків.
- 30.4.4. Зобов'язання по перерахуванню штрафу враховується на розділі грошового реєстра в порядку, встановленому статтею 25 Правил торгівлі в Секції строкового ринку для обліку зобов'язань по перерахуванню грошових коштів.

Стаття 31. Порядок включення зобов'язань за Ф'ючерсними контрактами з поставкою з Датою виконання, що наступила, до складу зобов'язань по оплаті/перереєстрації цінних паперів, що підлягають виконанню

- 31.1. Необхідними умовами включення зобов'язань за Ф'ючерсними контрактами з поставкою з Датою виконання, що настала, до складу зобов'язань по оплаті / перереєстрації цінних паперів, що підлягають виконанню, є:
- 1) наявність у Біржі по кожному розділу реєстра обліку позицій, на якому враховуються зобов'язання за Ф'ючерсними контрактами з поставкою з Датою виконання, що настала інформації про номер рахунку зберігача в Депозитарії, призначеного для

поставки та оплати цінних паперів за контрактами, укладеними на Біржі (далі – рахунок, закріплений за розділом), з використанням якого здійснюватиметься виконання вказаних зобов'язань. Дана інформація надається Учасником біржових торгів на строковому ринку Біржі або при відкритті розділу клірингових реєстрів, або шляхом подачі заяви за формою F02, передбаченою додатком № 1 до Правил торгівлі в Секції строкового ринку;

- 2) рахунок, закріплений за розділом, повинен бути зареєстрований на Біржі відповідно до вимог Правил Біржі, та у Біржі має бути інформація про надання зберігачем Депозитарію повноважень на здійснення операцій списання/зарахування цінних паперів по цьому рахунку на підставі інформації, отриманої Депозитарієм від Біржі.

Вказані умови повинні виконуватися на момент початку процедури визначення зобов'язань по оплаті/перереєстрації цінних паперів, що підлягають виконанню.

- 31.1.1. Зобов'язання за Ф'ючерсними контрактами з поставкою з Датою, що наступила, які не відповідають умовам, вказаним в пункті 31.1 цієї статті, не включаються до складу зобов'язань по оплаті/перереєстрації цінних паперів, що підлягають виконанню.
- 31.2. Біржа включає до складу зобов'язань по оплаті/перереєстрації цінних паперів, що підлягають виконанню зобов'язання за Ф'ючерсними контрактами з поставкою з Датою виконання, що наступила, разом із зобов'язаннями по поверненню раніше перерахованої Варіаційної маржі за вказаними Ф'ючерсними контрактами у випадку, якщо вказані зобов'язання задовольняють умовам пункту 31.1 цієї статті, і для їх виконання достатньо активів на рахунках Учасників біржових торгів на строковому ринку та на рахунку Центрального контрагента.

Стаття 32. Порядок оплати послуг за організацію торгівлі та сплати штрафів

- 32.1. Зобов'язання по сплаті біржового збору за реєстрацію Строкових контрактів і зобов'язання по сплаті штрафів, встановлених Зразковими формами Строкових контрактів та Угодою про систему заходів щодо зниження ризиків, враховуються Біржею на розділах грошового реєстра в ході клірингової сесії в порядку, встановленому статтею 25 Правил торгівлі в Секції строкового ринку для обліку зобов'язань по перерахуванню грошових коштів.
Зобов'язання по сплаті штрафу за невиконання зобов'язань за Ф'ючерсними контрактами з поставкою враховується на розділі грошового реєстра, код якого збігається з кодом розділу реєстра обліку позицій, на якому враховувалися припинені виплатою штрафу зобов'язання за Ф'ючерсними контрактами з поставкою.
Зобов'язання по сплаті штрафу за застосування до Учасника біржових торгів на строковому ринку процедури примусового закриття позицій враховується на розділі грошового реєстра, код якого збігається з кодом розділу реєстра обліку позицій, на якому враховувалися зобов'язання за Строковими контрактами, що припинені в ході процедури примусового закриття позицій.
Зобов'язання по сплаті біржового збору за реєстрацію Строкових контрактів враховується на розділі грошового реєстра, код якого збігається з кодом розділу реєстра обліку позицій, вказаного при укладанні Строкового контракту.
Припинення всіх вказаних зобов'язань за ліком або виконанням здійснюється в порядку, встановленому Угодою про систему заходів щодо зниження ризиків для зобов'язань по перерахуванню грошових коштів.
- 32.2. Центральный контрагент за рахунок коштів Учасника, що обліковуються на відповідному розділі клірингового реєстру та зберігаються на банківському рахунку Центрального контрагента, здійснює оплату біржового збору за операції на строковому ринку, проведені Учасником. Утримання суми біржового збору та перерахування біржового збору Біржі здійснюється Центральним контрагентом на підставі інформації отриманої від Біржі.

Стаття 33. Звіти, що надаються Учасникам біржових торгів на строковому ринку

- 33.1. Біржа формує і надає Учасникам біржових торгів на строковому ринку звіти за підсумками денної і вечірньої клірингової сесії.
Специфікація форматів звітів, що надаються Учасникам біржових торгів на Строковому ринку, затверджується Біржею і публікується на Сайті Біржі.
Звіти надаються в електронному вигляді.

- 33.2. Звіти можуть бути надані в паперовому вигляді Учаснику біржових торгів на строковому ринку за його запитом протягом 3 (трьох) робочих днів після отримання запиту.
- 33.3. В разі виявлення помилок Біржа має право сформувати і направити Учасникам біржових торгів на строковому ринку виправлені звіти. При цьому за дійсний вважається останній звіт.

Стаття 34. Резервний фонд

- 34.1. В цілях зниження ризиків невиконання Строкових контрактів Біржа створює Резервний фонд.
- 34.2. Порядок формування, використання та відшкодування коштів Резервного фонду визначений Положенням про страховий та резервний фонди, що є додатком до Угоди про систему заходів щодо зниження ризиків.

Стаття 35. Страховий фонд

- 35.1. В цілях зниження ризиків невиконання Строкових контрактів створюється Страховий фонд. Страховий фонд створюється Центральним контрагентом за рахунок внесків Учасників біржових торгів на строковому ринку.
- 35.2. Порядок формування, використання та відшкодування коштів Страхового фонду визначений Положенням про страховий та резервний фонди, що є додатком до Угоди про систему заходів щодо зниження ризиків.

Стаття 36. Контроль за дотриманням Правил торгівлі в Секції строкового ринку

- 36.1. Біржа здійснює контроль за дотриманням Учасниками біржових торгів на строковому ринку Правил торгівлі в Секції строкового ринку шляхом здійснення заходів, передбачених статтею 18 Правил торгівлі в Секції строкового ринку, а також заходів, передбачених Правилами Біржі, з урахуванням особливостей проведення операцій на строковому ринку.

Стаття 37. Проведення заходів щодо фінансового моніторингу

- 37.1. Фінансовий моніторинг операцій на строковому ринку здійснюється відповідно до Правил Біржі.

Стаття 38. Порядок розкриття інформації про діяльність Біржі та її оприлюднення

- 38.1. Розкриття інформації про діяльність Біржі на строковому ринку здійснюється відповідно до Правил Біржі з урахуванням особливостей проведення операцій на строковому ринку.