

ЗАРЕЄСТРОВАНО

рішенням Національної комісії з цінних паперів та фондового ринку

від «01» жовтня 2013р. № 2084

ЗАТВЕРДЖЕНО

рішенням Біржової ради ПАТ «Українська біржа»

Протокол №11 від 16 вересня 2013р.



Голова Комісії
Д.М. Тевелєв



Голова Біржової ради
І.О. Мазепа

ЗРАЗКОВА ФОРМА

Ф'ЮЧЕРСНОГО КОНТРАКТУ

на Індекс українських акцій (Індекс UХ)

1. Терміни і визначення

Біржа –

Публічне акціонерне товариство «Українська біржа», яке здійснює організацію торгівлі на строковому ринку, включаючи здійснення клірингу та розрахунків щодо фінансових інструментів (крім цінних паперів), які укладаються на ній. Для забезпечення режиму повної анонімності в процесі Торгів і розрахунків, та для зниження ризиків невиконання Строкових контрактів Біржа стає покупцем відносно кожного продавця та продавцем відносно кожного покупця за кожним Строковим контрактом, що укладається на Торгах.

Зразкова форма –

Зразкова форма ф'ючерсного контракту на Індекс українських акцій (Індекс UХ).

Індекс українських акцій (Індекс UХ)

індекс, який розраховує Публічне акціонерне товариство «Українська біржа» згідно затвердженої Біржовою радою Методики розрахунку Індексу українських акцій.

Покупець, Продавець –

сторони укладеного Ф'ючерсного контракту.

Правила торгівлі в Секції строкового ринку

Правила торгівлі в Секції строкового ринку Публічного акціонерного товариства «Українська біржа».

Ф'ючерсний контракт –

ф'ючерсний контракт на Індекс українських акцій (Індекс UХ), умови якого визначаються Зразковою формою.

Терміни, прямо не вказані в Зразковій формі, розуміються відповідно до Правил торгівлі в Секції строкового ринку, Методики розрахунку Індексу українських акцій та законодавства України.

2. Загальні положення

- 2.1. Ця Зразкова форма є типовими умовами договору відповідно до частини 1 статті 630 Цивільного кодексу України та підлягає оприлюдненню на Сайті Біржі.
- 2.2. На умовах, визначених Зразковою формою, Ф'ючерсний контракт може бути укладений між Учасником торгів та Біржею виключно на Торгах, що проводяться Біржею, в порядку, встановленому Правилами торгівлі в Секції строкового ринку.
- 2.3. Адреси, реквізити банківських рахунків (для юридичних осіб) та паспортні дані (для фізичних осіб) Учасника торгів, що уклав Ф'ючерсний контракт, містяться в Переліку учасників біржових торгів, який веде Біржа.
- 2.4. Ф'ючерсний контракт, що укладається на Торгах, сторонами якого є Учасник торгів та Біржа, підписується Аналогом власноручного підпису відповідно до Угоди про використання аналога власноручного підпису в електронній торговельній системі (ЕТС) ПАТ «Українська біржа».
- 2.5. Вид ф'ючерсного контракту, укладеного на умовах, визначених Зразковою формою, є без поставки базового активу (розрахунковим).
- 2.6. Базовим активом Контракту є Індекс UX, що розраховується Біржею відповідно до методики, затверджені Біржею Радою.
- 2.7. Обсяг Ф'ючерсного контракту складає 1 Лот.
- 2.8. Лот Контракту дорівнює кількості Пунктів Індeksu UX, що становить значення Індeksu UX.
- 2.9. Вартість одного Пункту Індeksu UX складає 1 (одну) українську гривню .
- 2.10. Ф'ючерсний контракт укладається за ціною, яка дорівнює добутку кількості Пунктів Індeksu UX на Вартість одного пункту (далі - Ціна укладання Ф'ючерсного контракту).
- 2.10.1. Ціна укладання Ф'ючерсного контракту вказується в гривнях з точністю до 0,1 (однієї десятої) гривні, що відповідає мінімально допустимій зміні ціни укладання Ф'ючерсного контракту на Торгах.
- 2.11. Ціною виконання Ф'ючерсного контракту є Підсумкова ціна Ф'ючерсного контракту, яка визначається в порядку визначеному цією Зразковою формою.
- 2.12. Код (позначення) Ф'ючерсного контракту і короткий код (позначення) Ф'ючерсного контракту встановлюється рішенням Біржі про можливість укладення даного Ф'ючерсного контракту на Торгах. Вказане рішення ухвалюється в порядку, встановленому Правилами торгівлі в Секції строкового ринку.
- 2.12.1. Код (позначення) Ф'ючерсного контракту формується за наступними правилами:
UX-<місяць виконання>.<рік виконань>.
Місяць та рік виконання вказуються арабськими цифрами і використовуються для визначення Дати виконання Ф'ючерсного контракту.
Приклад. Код (позначення) «UX-3.10» означає, що Ф'ючерсний контракт на Індекс UX підлягає виконання в березні 2010 року.
- 2.12.2. Короткий код (позначення) Ф'ючерсного контракту формується за наступними правилами:
UX<місяць виконання><рік виконання>.

Місяць виконання кодується одним латинським символом таким чином:

| Місяць | Код |
|----------|-----|
| січень | F |
| лютий | G |
| березень | H |
| квітень | J |
| травень | K |
| червень | M |

| Місяць | Код |
|----------|-----|
| липень | N |
| серпень | Q |
| вересень | U |
| жовтень | V |
| листопад | X |
| грудень | Z |

Рік виконання вказується однією арабською цифрою, яка визначає останню цифру року виконання Ф'ючерсного контракту.

Приклад. Короткий код (позначення) «УХН0» означає, що Ф'ючерсний контракт на Індекс УХ підлягає виконання в березні 2010 року.

- 2.13. Термін виконання - дата виконання Ф'ючерсного контракту є 15 (п'ятнадцяте) число місяця і року виконання Ф'ючерсного контракту, якщо ця дата припадає на Робочий день, або найближча наступна за 15 (п'ятнадцятим) числом місяця та року виконання Ф'ючерсного контракту дата, що припадає на Робочий день.
- 2.14. Рішенням Біржі про можливість укладення Ф'ючерсного контракту на Торгах може бути встановлена інша Дата виконання Ф'ючерсного контракту.
- 2.15. Останнім Торговельним днем, в ході якого може бути укладений Ф'ючерсний контракт, є Дата виконання Ф'ючерсного контракту.
Рішенням Біржі про можливість укладання Ф'ючерсного контракту на Торгах може бути встановлений інший останній Торговельний день, в ході якого може бути укладений Ф'ючерсний контракт.
- 2.16. Розмір Початкової маржі за Ф'ючерсним контрактом визначається відповідно до Правил торгівлі в Секції строкового ринку.

3. Зобов'язання за Ф'ючерсним контрактом

- 3.1. Сторони Ф'ючерсного контракту зобов'язані сплачувати один одному грошові кошти (Варіаційну маржу, Підсумкову варіаційну маржу) в сумі, розмір якої залежить від зміни значень базового активу.
- 3.2. Варіаційна маржа розраховується та сплачується в період з першого дня укладення Контракту до дня виконання Ф'ючерсного контракту включно в порядку визначеному Правилами торгівлі в Секції строкового ринку.
- 3.3. Варіаційна маржа, Підсумкова варіаційна маржа за Ф'ючерсним контрактом, розраховані за формулами, визначеними Правилами торгівлі в Секції строкового ринку та цією Зразковою формою, виплачується в гривнях та округлюється з точністю до копійок за правилами математичного округлення.
- 3.4. Зобов'язання зі сплати Варіаційної маржі, Підсумкової варіаційної маржі є Зобов'язанням по розрахунках.
- 3.5. Підсумкова варіаційна маржа підлягає визначенню за наступними формулами:

| | |
|---|---|
| $VM_{nc} = (C_{fix} - C_{fut}) \times L,$ $VM = (C_{fix} - C_{prev}) \times L, \text{ де:}$ | |
| VM_{nc} | Підсумкова варіаційна маржа за Ф'ючерсним контрактом, за яким розрахунок Варіаційної маржі Біржею ще не проводився; |
| VM | Підсумкова варіаційна маржа за Ф'ючерсними контрактами, за яким розрахунок Варіаційної маржі Біржею вже проводився; |
| C_{fix} | Підсумкова ціна Ф'ючерсного контракту, округлена з точністю до 0,01 гривні за правилами математичного округлення; |
| C_{prev} | Розрахункова ціна Ф'ючерсного контракту, яка визначена підчас попередньої Клірингової сесії; |
| C_{fut} | Ціна укладання Ф'ючерсного контракту; |
| L | Відношення обсягу Лота до обсягу базового лота (кількість одиниць базового активу, ціна за який виставляється в торговельну систему). Для цього Контракту $L = 1$; |

Підсумкова ціна Ф'ючерсного контракту визначається у такому порядку:

- якщо на Дату виконання Розрахункове значення (п. 3.6 Зразкової форми) виявляється більше суми Розрахункової ціни та Ліміту зміни Розрахункової ціни, встановлених Біржею в порядку, визначеному Правилами торгівлі в Секції строкового ринку, за Ф'ючерсними контрактами з цією

Датою виконання, то Підсумкова ціна Ф'ючерного контракту приймається рівною зазначеній сумі Розрахункової ціни та Ліміту зміни Розрахункової ціни;

- якщо на Дату виконання Розрахункове значення (п. 3.6 Зразкової форми) виявляється меншим різниці Розрахункової ціни та Ліміту зміни Розрахункової ціни, встановлених Біржею в порядку, визначеному Правилами торгівлі в Секції строкового ринку, за Ф'ючерсними контрактами з цією Датою виконання, то Підсумкова ціна Ф'ючерного контракту приймається рівною зазначеній різниці Розрахункової ціни та Ліміту зміни Розрахункової ціни;

- в інших випадках Підсумкова ціна Ф'ючерного контракту приймається рівною Розрахунковому значенню.

3.6. Розрахункове значення визначається в наступному порядку:

3.6.1. Розрахункове значення Ф'ючерного контракту приймається рівним середньому значенню Індекса UX за останні 3 (три) години торгів на Ринку заявок ПАТ «Українська біржа» в Дату виконання, помноженому на 1 гривню. Вказаний порядок визначення Розрахункового значення Ф'ючерного контракту застосовується у випадку, якщо протягом всього вказаного періоду на Біржі проводилися Торги цінними паперами, включеними в список для розрахунку Індексу UX, сумарна вага яких у складі Індекса UX складала не менше 75% (сімдесяти п'яти відсотків) протягом всього вказаного періоду.

3.6.2. Якщо в результаті припинення Торгів цінними паперами, включеними в список для розрахунку Індексу UX, умова, передбачена п. 3.6.1, в Дату виконання не дотримується, то:

- Розрахункове значення в цей день не визначається;

- Датой виконання стає найближчий наступний Торговельний день, протягом якого сумарний час Торгів цінними паперами, включеними в список для розрахунку Індексу UX, сумарна вага яких у складі Індекса UX складає не менше 75% (сімдесяти п'яти відсотків), в період з 12 годин 00 хвилин до закінчення Торговельної сесії, визначеної відповідно до Правил Біржі (далі – Торговельна сесія), склало не менше 3 (трьох) годин (далі – Розрахунковий час). В цьому випадку Розрахункова ціна Ф'ючерного контракту приймається рівною середньому значенню Індекса UX за перші 3 (три) години Розрахункового часу, помноженому на 1 гривню;

- Розрахункове значення Ф'ючерного контракту визначається на Дату виконання в порядку визначеному Правилами біржі.

В цілях цього підпункту для розрахунку сумарної ваги цінних паперів, включених в список для розрахунку Індексу UX, в складі Індексе UX використовуються ваги цінних паперів на момент закінчення Торговельної сесії в Торговельний день, передуючий дню розрахунку сумарної ваги.

3.7. Якщо сума Підсумкової варіаційної маржі позитивна, то Продавець Ф'ючерного контракту зобов'язаний перерахувати суму Підсумкової варіаційної маржі Покупцю Ф'ючерного контракту.

3.8. Якщо сума Підсумкової варіаційної маржі негативна, то Покупець Ф'ючерного контракту зобов'язаний перерахувати з суму Підсумкової варіаційної маржі Продавцю Ф'ючерного контракту.

3.9. Часткового виконання зобов'язань за Ф'ючерсним контрактом не допускається.

3.10. Порядок виконання (припинення) зобов'язань за Ф'ючерсним контрактом визначається Правилами торгівлі в Секції строкового ринку.

4. Відповідальність сторін та порядок розгляду спорів

4.1. Сторони несуть відповідальність за невиконання або неналежне виконання зобов'язань за Ф'ючерсним контрактом відповідно до законодавства України та Правил торгівлі в Секції строкового ринку.

4.2. Порядок розгляду спорів, що виникають під час укладання та виконання Ф'ючерного контракту, визначений Правилами торгівлі в Секції строкового ринку.

5. Особливі умови

- 5.1. Згідно до Правил торгівлі в Секції строкового ринку Біржа має право прийняти рішення про зміну умов укладання та умов укладених Ф'ючерсних контрактів. Вказане рішення набирає чинності в порядку, визначеному Правилами торгівлі в Секції строкового ринку.
- 5.2. З моменту набрання чинності рішення, прийнятого Біржею відповідно до пункту 5.1. Зразкової форми, умови існуючих зобов'язань за раніше укладеними Ф'ючерсними контрактами вважаються зміненими з врахуванням вказаного рішення.

6. Внесення змін та доповнень до Зразкової форми

- 6.1. Біржа має право внести зміни та доповнення до Зразкової форми, та зобов'язана зареєструвати такі зміни в Національній комісії з цінних паперів та фондового ринку.
- 6.2. Зміни та доповнення до Зразкової форми набирають чинності після реєстрації в Національній комісії з цінних паперів та фондового ринку з моменту вступу в дію Зразкової форми, що містить вказані зміни та доповнення.
- 6.3. Інформація про вступ в дію Зразкової форми, що містить зміни та доповнення, оприлюднюється шляхом публікації на Сайті Біржі не менш ніж за 1 (один) Торговельний день до вступу її в дію.
- 6.4. З моменту вступу в дію Зразкової форми, що містить зміни та доповнення, умови існуючих зобов'язань за раніше укладеними Ф'ючерсними контрактами вважаються зміненими з врахуванням таких змін та доповнень.