

ЗАРЕЄСТРОВАНО

рішенням Національної комісії з цінних паперів та фондового ринку

від «10» березня 2016р. № 244



Голова Комісії
Т.З. Хромаєв

ЗАТВЕРДЖЕНО

рішенням Біржової ради
ПАТ «Українська біржа»

Протокол №15 від 15.02.2016 р.



Голова Біржової ради
І.О. Мазепа

ЗРАЗКОВА ФОРМА

ОПЦІОНА НА Ф'ЮЧЕРСНИЙ КОНТРАКТ

на Індекс українських акцій (Індекс UX)

1. Терміни та 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 опціона на ф'ючерсний контракт на Індекс українських акцій (Індекс UX)

Індекс українських акцій (Індекс UX) -

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

Сторони опціонного контракту –

Утримувач/Підписчик за Опціонним контрактом з одним кодом.

Правила торгівлі в Секції строкового ринку –

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

Опціонний контракт –

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

Ф'ючерсний контракт –

ф'ючерсний контракт на Індекс українських акцій (Індекс UX)

Терміни, прямо не вказані в Зразковій формі, використовуються у значенні відповідно до Правил торгівлі в Секції строкового ринку, Методики розрахунку Індeksu 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, Опціонний контракт (далі по тексту - Контракт) може бути укладений між Учасником біржових 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 біржових торгів, що уклав Контракт, містяться в Переліку учасників біржових торгів, який веде Біржа.
- 2.4. Контракт, що укладається на торгах, сторонами якого є Учасник біржових 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. Найменування Контракту :
Опціон на ф'ючерсний контракт на Індекс українських акцій (Індекс УХ).
- 2.6. Базовим активом Контракту є ф'ючерсний контракт на Індекс українських акцій (Індекс УХ) (далі - Ф'ючерсний контракт).
- 2.7. Код (позначення) Контракту формується за наступними правилами:
УХ-<Код опціонного контракту>М<останній день укладення Контракту><тип Контракту><категорія Контракту><><ціна виконання>¹.
 - символ "М" означає, що Контракт є маржируємим, що означає наявність Зобов'язання по варіаційній маржі, визначеного відповідно до пункту 4.2 Специфікацій;
 - останній день укладення Контракту вказується арабськими цифрами у форматі ДДММРР (наприклад, 151216 - 15 грудня 2016 року);
 - тип Контракту означає Контракт на купівлю - "С" або Контракт на продаж - "Р";
 - категорія Контракту означає американський опціон - "А".Останнім днем укладення Контракту є останній Торговельний день, в який може бути укладений Контракт. Дата останнього дня укладення Контракту, що вказується в коді Контракту, визначається відповідно до пункту 3.3. Зразкової форми.
Приклад. Код (позначення) "УХ-12.16М151216СА 2500" означає, що базовим активом цього Контракту є Ф'ючерсний контракт з кодом "УХ-12.16", Контракт є маржируємим, останній день укладання Контракту - 15 грудня 2016 року, тип Контракту - на купівлю, Контракт є американським, ціна виконання дорівнює 2500 пунктів.
- 2.8. Вид Контракту, який укладений на умовах, визначених Зразковою формою, є з поставкою базового активу (поставочним).

¹ Для опціонного контракту з базовим активом ф'ючерсним контрактом з виконанням у вересні 2016 року вводиться особливий код (позначення) УХ - <Код опціонного контракту>М<останній день укладення Контракту><тип Контракту><категорія Контракту><><ціна виконання>.

- 2.9. Кількість Ф'ючерських контрактів, що є базовим активом Контракту (далі - Лот), складає 1 (один) Ф'ючерський контракт.
- 2.10. Контракт є маржируємым, що означає наявність Зобов'язання по варіаційній маржі, визначеного відповідно до пункту 4.2 Зразкової форми.
- 2.11. Розмір Початкової маржі за контрактом визначається відповідно до Правил торгівлі в Секції строкового ринку.

3. Укладення Контракту

- 3.1. Можливість укладання Контракту на Торгах встановлюється рішенням Біржі, яке повинне містити:
 - код (позначення) Контракту;
 - дату першого Торговельного дня, в який може бути укладений Контракт (далі - перший день укладання Контракту);
 - час, починаючи з якого може бути укладений Контракт (далі - момент початку Торгів Контрактом).
- 3.2. Термін дії Контракту складає період з моменту початку Торгів Контрактом до початку останньої клірингової сесії останнього дня укладення Контракту.
- 3.3. Дата останнього дня укладення Контракту, що вказується в коді Контракту, визначається в наступному порядку (якщо інший день не встановлений рішенням Біржі, вказаним в пункті 3.1 Зразкової форми) :
 - 3.3.1. у разі, якщо місяць та рік закінчення терміну дії Контракту співпадають з місяцем та роком виконання Ф'ючерського контракту, останнім днем укладення Контракту є останній день укладення Ф'ючерського контракту;
 - 3.3.2. у разі, якщо місяць та рік закінчення терміну дії Контракту не співпадають з місяцем та роком виконання Ф'ючерського контракту, останнім днем укладення Контракту є 15 (п'ятнадцяте) число місяця та року закінчення терміну дії Контракту, а якщо 15 (п'ятнадцяте) число місяця та року виконання Контракту не є Торговельним днем – наступний за 15 (п'ятнадцятим) числом місяця та року закінчення терміну дії Контракту Торговельний день.

4. Зобов'язання за контрактом

- 4.1. Премія (ціна Контракту).
 - 4.1.1. Премія (ціна Контракту) в ході Торгів при подачі заявки та укладанні Контракту вказується в пунктах за Лот.
 - 4.1.2. Мінімальна зміна ціни Контракту в ході Торгів (далі - мінімальний крок ціни Контракту) складає 0,1 (одну десяту) пункту.
 - 4.1.3. Вартість одного пункту складає 10 (десять) гривень.
- 4.2. Зобов'язання по варіаційній маржі.
 - 4.2.1. Сторони Контракту зобов'язані сплачувати один одному грошові кошти (варіаційну маржу) в порядку та на умовах передбачених Правилами торгівлі в Секції строкового ринку.
- 4.3. Виконання зобов'язання по укладенню Ф'ючерського контракту.

4.3.1. Підписчик зобов'язаний на вимогу Утримувача укласти Ф'ючерсний контракт із дотриманням наступних умов :

- код Учасника біржових торгів та код (коди) Клієнта (Клієнтів), вказані при укладенні Ф'ючерсного контракту, співпадають з кодом Учасника біржових торгів та кодом (кодами) Клієнта (Клієнтів), вказаними при укладенні Контракту;
- Підписчик стає Продавцем за Ф'ючерсним контрактом, а Утримувач стає Покупцем за Ф'ючерсним контрактом, якщо Контракт є опціоном на купівлю, або Підписчик стає Покупцем за Ф'ючерсним контрактом, а Утримувач стає Продавцем за Ф'ючерсним контрактом, якщо Контракт є опціоном на продаж;
- ціна укладення Ф'ючерсного контракту дорівнює ціні виконання Контракту.

4.3.2. Утримувач може заявити вимогу про укладення Ф'ючерсного контракту шляхом подачі заявки на Біржу.

4.3.3. В ході останньої клірингової сесії останнього дня укладення Контракту вимога Утримувача про укладення Ф'ючерсного контракту вважається заявленою при дотриманні наступних умов :

- останній день укладення Контракту не співпадає з останнім днем укладення Ф'ючерсного контракту (у тому числі у разі, коли відповідно до Специфікації Ф'ючерсного контракту змінився останній день укладення Ф'ючерсного контракту);
- Контракт є опціоном на купівлю, ціна виконання якого менше нижнього ліміту коливань цін угод Ф'ючерсного контракту, встановленого в ході останньої клірингової сесії після закінчення останнього дня укладення Контракту, або Контракт є опціоном на продаж, ціна виконання якого більше верхнього ліміту коливань цін угод Ф'ючерсного контракту, встановленого в ході вечірньої клірингової сесії після закінчення останнього дня укладення Контракту.

4.3.4. В ході останньої клірингової сесії останнього дня укладення Контракту вимога Утримувача про укладення Ф'ючерсного контракту вважається заявленою при дотриманні наступних умов :

- останній день укладення Контракту співпадає з останнім днем укладення Ф'ючерсного контракту;
- Контракт є опціоном на купівлю, ціна виконання якого менше середнього значення Індексу UX за період з 14 годин 00 хвилин до 17 годин 00 хвилин² в останній день укладення Ф'ючерсного контракту (далі - середнє значення Індексу UX), або Контракт є опціоном на продаж, ціна виконання якого більше середнього значення Індексу UX.

В цілях цього пункту середнє значення Індексу UX розраховується як середньоарифметичне усіх розрахованих значень Індексу UX за період часу, за який визначається середнє значення Індексу UX.

4.3.5. Укладення Ф'ючерсного контракту здійснюється відповідно до Правил торгівлі в Секції строкового ринку та Зразкової форми ф'ючерсного контракту.

² В розрахунок середнього значення Індексу UX не включається значення на 14 годин 00 хвилин та включається значення на 17 годин 00 хвилин.

5. Підстави та порядок припинення зобов'язань за контрактом

- 5.1. Підстави припинення зобов'язань за контрактом:
 - 5.1.1. Зобов'язання за контрактом повністю припиняються внаслідок Виконання Контракту.
 - 5.1.2. Зобов'язання сторони за Контрактом повністю припиняються внаслідок виникнення у цієї сторони зустрічних зобов'язань за Контрактом з тим же кодом (позначенням), тобто виникнення у Підписчика зобов'язань Утримувача або у Утримувача - зобов'язань Підписчика, з дотриманням вимог, передбачених Правилами торгівлі в секції Строкового ринку.
 - 5.1.3. Зобов'язання за контрактом можуть бути припинені з інших підстав, вказаних в Правилах торгівлі.
 - 5.1.4. Зобов'язання за контрактом повністю припиняються після закінчення терміну дії Контракту.
- 5.2. На підставах, вказаних в пункті 5.1 Зразкової форми, зобов'язання за Контрактом припиняються в порядку, встановленому Правилами торгівлі.

6. Відповідальність

- 6.1. Сторони несуть відповідальність за невиконання або неналежне виконання зобов'язань за Контрактом відповідно до законодавства України та Правил торгівлі в Секції строкового ринку.
- 6.2. Порядок розгляду суперечок, що виникають при укладенні та виконанні Контракту, визначений Правилами торгівлі в Секції строкового ринку.

7. Особливі умови

- 7.1. Згідно з Правилами торгівлі в Секції строкового ринку Біржа має право прийняти рішення про зміну умов укладання та умов укладених Контрактів. Вказане рішення набуває чинності в порядку, визначеному Правилами торгівлі в Секції строкового ринку.
- 7.2. З моменту набрання чинності рішення, прийнятого Біржею відповідно до пункту 5.1. Зразкової форми, умов існуючих зобов'язань по раніше укладеними Контрактами вважаються зміненими з урахуванням вказаного рішення.

8. Внесення змін та доповнень до Зразкової форми

- 8.1. 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.
- 8.2. Зміни до Зразкової форми набувають 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.
- 8.3. Інформація про вступ в дію Зразкової форми, що містить зміни та доповнення, оприлюднюється шляхом публікації на Сайті Біржі не менше ніж за 1 (один) Торговельний день до вступу її в дію.
- 8.4. З моменту вступу в дію Зразкової форми, що містить зміни та доповнення, умов існуючих зобов'язань по раніше укладеними опціонними контрактами вважаються зміненими з урахуванням таких змін та доповнень.