

# Опцион на фьючерсный контракт на индекс украинских акций

Спецификация контракта и  
отчеты биржи по итогам торгов



# СПЕЦИФИКАЦІЯ КОНТРАКТА

<b>Полный код контракта</b>	<b>UX-6.11M150611CA 2800</b>
Код в торговой системе	<b>UX2800BF1</b>
Код базового актива	UXH1
Шаг страйка	100 п.
Расшифровка контракта	Маржируемый Опцион колл на фьючерсный контракт на Индекс Украинских акций
Категория опциона	Американский
Базового актива в контракте	1
Начало обращения	07.04.2011
Последний день обращения	15.06.2011
Дата исполнения	15.06.2011
Шаг премии	0,05 грн.
Стоимость шага премии	0,05 грн.

# ИСПОЛНЕНИЕ КОНТРАКТА

---

- ▶ Исполнение в течение срока действия опциона - по заявлению покупателя опциона
- ▶ Автоматическое исполнение опциона "в деньгах" в последний день обращения
- ▶ Исполнение - заключение фьючерсного контракта, являющегося базовым активом опциона
- ▶ При исполнении опциона заключается фьючерс, по цене, равной цене исполнения опциона (страйк)

# ТАРИФЫ

Тариф	Размер тарифа
Сбор за регистрацию сделки	0,20 грн.
Сбор за скальперскую сделку	0,10 грн.
Сбор за адресную сделку	0,20 грн.
Сбор за исполнение контракта	0,40 грн.

- ▶ Биржевая комиссия удерживается из средств ГО в момент заключения сделки и списывается с денежного регистра участника торгов
- ▶ Для опционов скальперскими являются безадресные сделки, которые могут привести к открытию противоположных позиций по базовому активу в случае исполнения опционов в течение одного Торгового дня. Скальперские пары для опционов (покупка базового актива - продажа базового актива):
  - Покупка CALL - продажа CALL
  - Покупка CALL - покупка PUT
  - Продажа PUT - покупка PUT
  - Продажа PUT - продажа CALL

# ФОРМАТ ОТЧЕТОВ

---

- ▶ Отчеты предоставляются в виде файлов в форматах FoxPro 2.x.(dbf) и Microsoft Office Excel (xls)
- ▶ По окончании торгов все “не пустые” отчеты отсылаются по электронной почте на заявленные адреса
- ▶ Спецификации отчетов в открытом доступе на сайте «Украинской биржи»
- ▶ Ежемесячные отчеты и отчеты для клиентов-физических лиц в бумажном виде

## Отчет о заключенных Опционных контрактах

Имя файла - **o08\_XX00.dbf**

Имя файла - **o04\_XXYY.dbf** (для группы объединенных разделов, «субброкерский отчет»)

## Отчет об итогах Торгов Опционными контрактами

При предоставлении отчета по итогам дневной клиринговой сессии имя файла - **dayo07.dbf**.

При предоставлении отчета по итогам вечерней клиринговой сессии имя файла - **o07.dbf**.

## Отчет об обязательствах по Опционным контрактам

При предоставлении отчета по Участнику биржевых торгов на срочном рынке имя файла - **oposXXYY.dbf**.

При предоставлении отчета по разделам регистра учета позиций Участника биржевых торгов на срочном рынке, по которым установлен признак обособленного учета, имя файла - **oposciXXYYZZZ.dbf**.

## Отчет о действиях с опционными заявками Участника торгов на срочном рынке

При предоставлении отчета по Участнику биржевых торгов на срочном рынке имя файла - **oordlogXXYY.dbf**

## Отчет о всех опционных рыночных сделках Участников торгов

Имя файла – **opt\_deal.dbf**

---

# Отчет о заключенных контрактах

## o04\_XXYY.dbf

- ▶ Номер сделки преобразуется добавлением литер S или B
- ▶ Сделка между двумя клиентами одного брокера отображается одной строкой

ID_DEAL	ISIN	PRICE	VOL	KOD_SELL	KOD_BUY	TYPE	FEE_BUY	FEE_SELL	VAR_MARG_B	VAR_MARG_S
1000251807	UX-6.11M150611CA 2800	250,00	3		9900000	0	0,60	0,00	1159,80	0,00
1000251808	UX-6.11M150611PA 2800	220,00	3		9900000	0	0,00	0,00	49,80	0,00
1000251809	UX-6.11M150611CA 2800	220,00	1	9900000		0	0,00	0,20	0,00	-416,60
1000251810	UX-6.11M150611PA 2800	250,00	1	9900000		0	0,00	0,00	0,00	13,40
1000251815	UX-6.11M150611CA 2800	0,00	1	9900000		1	0,00	0,00	0,00	-636,60

# Отчет об итогах торгов опционами

---

**o07.dbf** – формируется в разрезе инструментов

- ▶ Количество (заключенных контрактов, открытых позиций)
- ▶ Объем обязательств (по заключенным контрактам, общий)
- ▶ Цены (min, max, open, close, settl, avrg)
- ▶ Параметры контракта (лимит колебаний, шаг цены, биржевой сбор, и пр.)
- ▶ Волатильность, теоретическая цена
  
- ▶ 3 ставки ГО:  
dero\_unsov - Базовое ГО под 1 непокрытую позицию  
dero\_sov - Базовое ГО под 1 синтетическую позицию  
basegobuy- Базовое ГО под покупку 1 маржируемого опциона



# Отчет об обязательствах по Опционным контрактам

**oposXXYY.dbf** – отчет по участнику торгов

**oposXXYYZZZ.dbf** – отчет по разделам (обособленный учет)

KOD	ACCO UNT	ISIN	POS_ BEG	POS_ END	PREM	SBOR	GO	POS_EX EC	POS_E NDCIR	SBOR_ EXEC	SBOR_ NOSYS	VAR_M ARG_P	VAR_M ARG_D
9900000	RF	UX-6.11M150611CA 2800	0	1	0,00	0,40	634,41	-1	0	0,40	0,00	0,00	106,60
9900000	RF	UX-6.11M150611PA 2800	0	2	0,00	0,00	473,06	0	0	0,00	0,00	0,00	63,20

RF – учасник торгов на срочном рынке

BF – субброкер или группа объединенных разделов

CL – клиентский уровень

**Спасибо за внимание**

**www.ux.ua**

**+38 (044) 495-74-74**

**help@ux.ua, trade@ux.ua**