

ЗАРЕЄСТРОВАНО
рішенням Національної комісії з цінних
паперів та фондового ринку

від «20» 01 2015 р. № 35

Голова Комісії
Д. М. Шевцов

ЗАТВЕРДЖЕНО
рішенням Біржової ради
ПАТ «Українська біржа»

Протокол №25 від «01» грудня 2014 р.

Голова Біржової ради
І. О. Мазепа

ЗРАЗКОВА ФОРМА
Ф'ЮЧЕРСНОГО КОНТРАКТУ
на курс долар США – українська гривня
(курс ЕМТА)

1. Терміни і визначення

- Біржа –** Публічне акціонерне товариство «Українська біржа», яке здійснює організацію торгівлі на строковому ринку, включаючи здійснення клірингу та розрахунків щодо Ф'ючерсних контрактів, які укладаються на ній. Для забезпечення режиму повної анонімності в процесі Торгів і розрахунків, та для зниження ризиків невиконання Ф'ючерсних контрактів Біржа стає покупцем відносно кожного продавця та продавцем відносно кожного покупця за кожним Ф'ючерсним контрактом, що укладається на Торгах.
- Зразкова форма –** зразкова форма ф'ючерсного контракту на курс долар США – українська гривня
- Покупець, Продавець –** сторони укладеного Ф'ючерсного контракту.
- Правила торгівлі в Секції строкового ринку –** Правила торгівлі в Секції строкового ринку Біржі.
- Ф'ючерсний контракт –** ф'ючерсний контракт на курс долар США – українська гривня, умови якого визначаються Зразковою формою.

Терміни, прямо не вказані в Зразковій формі, розуміються відповідно до Правил торгівлі в Секції строкового ринку 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 Учасника торгів, що уклав Ф'ючерний контракт, містяться в Переліку учасників біржових торгів, який веде Біржа.
- 2.4. Ф'ючерний 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) Біржі.
- 2.5. Вид Ф'ючерного контракту, укладеного на умовах, визначених Зразковою формою, є без поставки базового активу (розрахунковим).
- 2.6. Базовим активом Ф'ючерного контракту є курс доллара США по відношенню до української гривні.
- 2.7. Обсяг Ф'ючерного контракту складає 1000 (одну тисячу) доларів США.
- 2.8. Ціна Ф'ючерного контракту в ході торгів при поданні заявок та виконанні контракту вказується в українських гривнях за 1 (один) долар США.
- 2.9. Мінімальна зміна ціни Ф'ючерного контракту в ході торгів (надалі – мінімальний крок ціни) складає 0,005 (п'ять тисячних) української гривні.
- 2.10. Ціною виконання Ф'ючерного контракту є Підсумкова ціна Ф'ючерного контракту.
- 2.11. Код (позначення) Ф'ючерного контракту та короткий код (позначення) Ф'ючерного контракту встановлюється рішенням Біржі про можливість укладення даного Ф'ючерного контракту на Торгах. Вказане рішення ухвалюється в порядку, встановленому Правилами торгівлі в Секції строкового ринку.

- 2.11.1. Код (позначення) Ф'ючерного контракту формується за наступними правилами:

DХ-<місяць виконання>.<рік виконань>.

Місяць та рік виконання вказуються арабськими цифрами і використовуються для визначення Дати виконання Ф'ючерного контракту.

Приклад. Код (позначення) «DХ-6.15» означає, що Ф'ючерний контракт на курс долара США підлягає виконанню в червні 2015 року.

- 2.11.2. Короткий код (позначення) Ф'ючерного контракту формується за наступними правилами:

DХ<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'ючерного контракту.

Приклад. Короткий код (позначення) «DXM5» означає, що Ф'ючерсний контракт на курс долара США підлягає виконання в червні 2015 року.

- 2.12. 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.
- 2.13. Рішенням Біржі про можливість укладення Ф'ючерсного контракту на Торгах може бути встановлена інша Дата виконання Ф'ючерсного контракту.
- 2.14. Останнім Торговельним днем, в ході якого може бути укладений Ф'ючерсний контракт, є день 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.
- 2.15. Розмір Початкової маржі за Ф'ючерсним контрактом визначається в гривнях за один ф'ючерсний контракт 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 0,0001 гривні за правилами математичного округлення; |
| C_{prev} | Розрахункова ціна Ф'ючерсного контракту, яка визначена під час попередньої Клірингової сесії; |
| C_{fut} | Ціна укладання Ф'ючерсного контракту,; |
| L | Відношення обсягу Ф'ючерсного контракту до кількості одиниць базового активу, ціна за який виставляється в торговельну систему. Для цього Контракту $L = 1000$; |

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'ючерсного 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'ючерсного контракту приймається рівною зазначеній різниці Розрахункової ціни та Ліміту зміни Розрахункової ціни;
- в інших випадках Підсумкова ціна приймається рівною Розрахунковому значенню Ф'ючерсного контракту.

3.6. Розрахункове значення Ф'ючерсного контракту визначається в наступному порядку:

- Розрахункове значення Ф'ючерсного контракту приймається рівним оприлюдненому інформаційним агенством Thomson Reuters та асоціацією ЕМТА курсу долара США по відношенню до української гривні (надалі – ЕМТА), який визначений в Дату виконання контракта та округлений з точністю до 0,0001 гривні за правилами математичного округлення;
- Якщо в день виконання Контракту курс ЕМТА не визначався, то за Розрахункове значення приймається опублікований Національним банком України середньозважений курс долара США по відношенню до української гривні, який визначений на підставі даних міжбанківського валютного ринку (надалі – МБК) станом на 16-00 в Дату виконання контракта та округлений з точністю до 0,0001 гривні за правилами математичного округлення;
- Якщо в день виконання Контракту курси МБК та ЕМТА не визначалися, то Розрахункове значення Ф'ючерсного контракту приймається рівним останньому оприлюдненому Національним банком України в Дату виконання офіційному курсу долара США по відношенню до української гривні приведенному до курсу за 1 долар США та, округлений з точністю до 0,0001 гривні за правилами математичного округлення.

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

3.8. Якщо сума Підсумкової варіаційної маржі негативна, то Покупець Ф'ючерсного контракту зобов'язаний перерахувати суму Підсумкової варіаційної маржі Продавцю Ф'ючерсного 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 Правилами торгівлі в Секції строкового ринку.
- 4.2. Порядок розгляду спорів, що виникають під час укладання та виконання Ф'ючерсного 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, умов 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 цієї Зразкової форми, та зобов'язана погодити ці зміни з Національним банком України та зареєструвати такі зміни в Національній комісії з цінних паперів та фондового ринку.
- 6.2. Зміни та доповнення до Зразкової форми набирають чинності після погодження з Національним банком України та 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, умов існуючих зобов'язань за раніше укладеними Ф'ючерсними контрактами вважаються зміненими з врахуванням таких змін та доповнень.