

ЗАРЕЄСТРОВАНО
рішенням Національної комісії з цінних
паперів та фондового ринку

від «26» грудня 2021 р. № 48

Голова Комісії

Т.З. Хромаєв

ЗАТВЕРДЖЕНО
рішенням Біржової ради
АТ «Українська біржа»

Протокол № 31 від 21 грудня 2020 р.

Голова Біржової ради

С.М. Оксаніч

**СПЕЦИФІКАЦІЯ
(ЗРАЗКОВА ФОРМА)
Ф'ЮЧЕРСНОГО КОНТРАКТУ
на індекс UONIA**

1. Терміни та визначення

Біржа – Акціонерне товариство «Українська біржа», яке здійснює організацію торгівлі на строковому ринку, включаючи здійснення клірингу та розрахунків щодо Контрактів, які укладаються на ній. Для забезпечення режиму повної анонімності в процесі Торгів і розрахунків, та для зниження ризиків невиконання Контрактів Біржа стає Покупцем відносно кожного Продавця та Продавцем відносно кожного Покупця за кожним Контрактом, що укладається на Торгах.

Контракт – ф'ючерсний контракт на індекс UONIA, умови якого визначаються Специфікацією.

Специфікація - Специфікація (зразкова форма) Контракту на індекс UONIA.

Покупець, Продавець – сторони укладеного Контракту, які мають зобов'язання за Контрактом у якості Покупця або Продавця.

Правила – Правила торгівлі в Секції строкового ринку Біржі.

Терміни, прямо не вказані в Специфікації, розуміються відповідно до Правил та законодавства України.

2. Загальні положення

- 2.1. Ця Специфікація є типовими умовами договору відповідно до частини 1 статті 630 Цивільного кодексу України та підлягає оприлюдненню на Сайті Біржі.
- 2.2. На умовах, визначених Специфікацією, Контракт може бути укладений між Учасником торгів та Біржею виключно на Торгах, що проводяться Біржею, в порядку, встановленому Правилами.
- 2.3. Адреси, реквізити банківських рахунків Учасника торгів, що уклав Контракт, містяться в Переліку учасників біржових торгів, який веде Біржа.
- 2.4. 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 Контракту, укладеного на умовах, визначених Специфікацією, є без поставки базового активу (розрахунковим).

- 2.6. Базовим активом Контракту є середньомісячне значення індексу UONIA.
- 2.7. Обсяг Контракту дорівнює 1 000 000 (один мільйон) українських гривень.
- 2.8. Ціна Контракту в ході Торгів при поданні заявок та укладенні Контракту вказується у відсоткових пунктах як 100% (сто відсотків) мінус очікувана середньомісячна ставка овернайт.
- 2.9. Мінімальна зміна ціни Контракту в ході Торгів (далі - мінімальний крок ціни) складає 0,01 (одну соту) відсоткового пункту.
- 2.10. Вартість мінімального кроку ціни визначається в українських гривнях та розраховується за формулою:

$$P = \frac{T}{365} * \frac{N * S}{100\%}$$

де,

P – вартість мінімального кроку ціни;

T – кількість днів в розрахунковому місяці (розрахунковим місяцем є проміжок часу між останнім торговельним днем місяця, що передує місяцю виконання, до передостаннього торговельного дня місяця виконання);

N – обсяг контракту (1 000 000 грн);

S – мінімальний крок ціни.

Вартість мінімального кроку ціни округлюється з точністю до 0,00001 (однієї стотисячної) гривні за правилами математичного округлення.

- 2.11. Ціною виконання Контракту є Підсумкова ціна Контракту.
- 2.12. Код (позначення) Контракту і короткий код (позначення) Контракту встановлюється рішенням Біржі про можливість укладення цього Контракту на Торгах. Вказане рішення ухвалюється в порядку, встановленому Правилами.
- 2.12.1. Код (позначення) Контракту формується за наступними правилами:

UON <місяць виконання>.<рік виконання>.

Місяць та рік виконання вказуються арабськими цифрами та використовуються для визначення Дати виконання Контракту.

Приклад: Код «UON-3.21» позначає Контракт на індекс UONIA, що підлягає виконанню в березні 2021 року.

- 2.12.2. Короткий код (позначення) Контракту формується за наступними правилами:

UON<місяць виконання><рік виконання>.

Місяць виконання кодується одним латинським символом таким чином:

Місяць	Код	Місяць	Код	Місяць	Код
січень	F	травень	K	вересень	U
лютий	G	червень	M	жовтень	V
березень	H	липень	N	листопад	X
квітень	J	серпень	Q	грудень	Z

Рік виконання вказується однією арабською цифрою, що означає останню цифру року виконання Контракту.

Приклад. Короткий код «UONH1» позначає Контракт на індекс UONIA, що підлягає виконанню в березні 2021 року.

- 2.13. Термін виконання, що є датою виконання - останній торговельний день місяця виконання.
- 2.14. Рішенням Біржі може бути встановлена інша Дата виконання Контракту.
- 2.15. Останнім Торговельним днем, в ході якого може бути укладений Контракт, є день виконання Контракту.
Рішенням Біржі може бути встановлений інший останній Торговельний день, в ході якого може бути укладений Контракт.
- 2.16. Розмір Початкової маржі за Контрактом визначається в гривнях за один Контракт відповідно до Правил.

3. Зобов'язання за Контрактом

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

$VM_{nc} = (C_{fix} - C_{fut}) \times P / S,$ $VM = (C_{fix} - C_{prev}) \times P / S:$	
VM_{nc}	Підсумкова варіаційна маржа за Контрактом, за яким розрахунок Варіаційної маржі Біржею ще не проводився;
VM	Підсумкова варіаційна маржа за Контрактами, за яким розрахунок Варіаційної маржі Біржею вже проводився;
C_{fix}	Підсумкова ціна Контракту;
C_{prev}	Розрахункова ціна Контракту, яка визначена під час попередньої Клірингової сесії;
C_{fut}	Ціна укладання Контракту;
P	Вартість мінімального кроку ціни;
S	Мінімальний крок ціни;

Підсумкова ціна Контракту визначається у такому порядку:

- якщо на Дату виконання Розрахункове значення (п. 3.6 Специфікації) виявляється більше суми Розрахункової ціни та Ліміту зміни Розрахункової ціни, встановлених Біржею в порядку, визначеному Правилами, за Контрактами з цією Датою виконання, то Підсумкова ціна Контракту приймається рівною зазначеній сумі Розрахункової ціни та Ліміту зміни Розрахункової ціни;
- якщо на Дату виконання Розрахункове значення (п. 3.6 Специфікації) виявляється меншим різниці Розрахункової ціни та Ліміту зміни Розрахункової ціни, встановлених Біржею в порядку, визначеному Правилами, за Контрактами з цією

Датою виконання, то Підсумкова ціна Контракту приймається рівною зазначеній різниці Розрахункової ціни та Ліміту зміни Розрахункової ціни;

- в інших випадках Підсумкова ціна Контракту приймається рівною Розрахунковому значенню.

3.6. Розрахункове значення визначається у такому порядку:

$$C_{\text{sett}} = 100\% - \left(\sum_{i=1}^T UONIA_i \right) / T$$

де:

C_{sett} - Розрахункове значення Контракту;

$UONIA_i$ – значення Українського індексу міжбанківських ставок овернайт в i -тий день розрахункового місяця, опублікований на сайті Національного банку України <https://bank.gov.ua>¹. В разі, якщо для i -того дня значення індексу UONIA не було опубліковано, воно вважається рівним останньому попередньому опублікованому значенню.

T – кількість днів в розрахунковому місяці (розрахунковим місяцем є проміжок часу між останнім торговельним днем місяця, що передує місяцю виконання, до передостаннього торговельного дня місяця виконання).

Розрахункове значення округлюється з точністю до 0,00001 (однієї стотисячної) гривні за правилами математичного округлення.

- 3.7. Якщо сума Підсумкової варіаційної маржі додатна, то Продавець Контракту зобов'язаний перерахувати суму Підсумкової варіаційної маржі Покупцю Контракту.
- 3.8. Якщо сума Підсумкової варіаційної маржі від'ємна, то Покупець Контракту зобов'язаний перерахувати суму Підсумкової варіаційної маржі Продавцю Контракту.
- 3.9. Часткове виконання зобов'язань за Контрактами не допускається.
- 3.10. Порядок виконання (припинення) зобов'язань за Контрактом визначається Правилами

4. Відповідальність сторін та порядок розгляду спорів

- 4.1. Сторони несуть відповідальність за невиконання або неналежне виконання зобов'язань за Контрактом відповідно до законодавства України та Правил.
- 4.2. Порядок розгляду спорів, що виникають під час укладання та виконання Контракту, визначений Правилами.

5. Особливі умови

- 5.1. Відповідно до Правил, Біржа має право прийняти рішення про зміну умов укладання та умов укладених Контрактів. Вказане рішення набирає чинності в порядку, визначеному Правилами.
- 5.2. З моменту набрання чинності рішення, прийнятого Біржею відповідно до пункту 5.1. Специфікації, умови існуючих зобов'язань за раніше укладеними Контрактами вважаються зміненими з урахуванням вказаного рішення.

¹ Значення Українського індексу міжбанківських ставок овернайт (UONIA) надається у відкритому (безоплатному) доступі на сайті Національного банку України <https://bank.gov.ua>, АТ «Українська біржа» не несе відповідальності за достовірність, своєчасність оновлення інформації та збої в роботі відповідного сайту.

6. Внесення змін та доповнень до Специфікації

- 6.1. Біржа має право внести зміни та доповнення до цієї Специфікації, 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 Специфікації набирають чинності після погодження з Національним банком України та реєстрації в Національній комісії з цінних паперів та фондового ринку з моменту вступу в дію Специфікації, що містить вказані зміни та доповнення.
 - 6.3. Інформація про вступ в дію Специфікації, 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 Специфікації, що містить зміни та доповнення, умови існуючих зобов'язань за раніше укладеними Контрактами вважаються зміненими з врахуванням таких змін та доповнень.
-