

4

«ЗАТВЕРДЖЕНО»  
Біржовою Радою  
ПАТ «ФБ «ПЕРСПЕКТИВА»  
Протокол № 14/05/30-01  
від 30.05.2014 р.



«ЗАРЕЄСТРОВАНО»  
Національною комісією з цінних  
паперів та фондового ринку  
Рішення № 867  
з. 2014 р.



**ПРАВИЛА  
ПУБЛІЧНОГО АКЦІОНЕРНОГО ТОВАРИСТВА  
«ФОНДОВА БІРЖА «ПЕРСПЕКТИВА»  
ЩОДО ТОРГІВЛІ НА СТРОКОВОМУ РИНКУ  
(РИНКУ ДЕРИВАТИВІВ)**

м. Дніпропетровськ  
2014 р.

## ЗМІСТ

Розділ 1. ВИЗНАЧЕННЯ ТЕРМІНІВ ТА ПОНЯТЬ	3
Розділ 2. ЗАГАЛЬНІ ПОЛОЖЕННЯ	6
Розділ 3. ДОСТУП ДО ТОРГІВ НА СТРОКОВОМУ РИНКУ (РИНКУ ДЕРИВАТИВІВ)	7
Розділ 4. ТОРГОВИЙ ТЕРМІНАЛ ВІТ eTRADE FUTURE	7
Розділ 5. СИСТЕМА УПРАВЛІННЯ РИЗИКАМИ НА СТРОКОВОМУ РИНКУ (РИНКУ ДЕРИВАТИВІВ)	8
Розділ 6. ЗАБЕЗПЕЧЕННЯ ВИКОНАННЯ ЗОБОВ'ЯЗАНЬ УЧАСНИКІВ БІРЖОВИХ ТОРГІВ НА СТРОКОВОМУ РИНКУ (РИНКУ ДЕРИВАТИВІВ) ПРИ ВИКОНАННІ КЛІРИНГУ БІРЖЕЮ	9
Розділ 7. ПОРЯДОК ОРГАНІЗАЦІЇ ТА ПРОВЕДЕННЯ ТОРГІВ НА СТРОКОВОМУ РИНКУ (РИНКУ ДЕРИВАТИВІВ)	10
7.1. Строковий контракт (Дериватив)	10
7.2. Подання та реєстрація Заявки	10
7.3. Види Заявок	10
7.4. Зміст Заявок	10
7.5. Укладання Ф'ючерсних контрактів (Ф'ючерсів)	11
7.6. Укладання Опціонів	11
7.7. Особливості визначення Розрахункової ціни	11
7.8. Запобігання маніпулюванню цінами	12
Розділ 8. ПОРЯДОК ЗДІЙСНЕННЯ БІРЖЕЮ КЛІРИНГУ, ЗАКРИТТЯ ПОЗИЦІЙ ТА ВИКОНАННЯ СТРОКОВИХ КОНТРАКТІВ (ДЕРИВАТИВІВ)	12
8.1. Клірингові сесії	12
8.2. Відкриття Позицій	13
8.3. Коригування Позицій та розрахунок Варіаційної маржі	13
8.4. Розрахунок зобов'язань щодо переказу коштів	13
8.5. Маржинальна вимога	14
8.6. Закриття Позицій	14
8.7. Порядок виконання Строкових контрактів (Деривативів) в Дату виконання	15
8.8. Грошові розрахунки (переказ коштів) на виконання зобов'язань за Строковими контрактами (Деривативами)	16
8.9. Особливості виконання Строкових контрактів (Деривативів) з поставкою Базового активу, який складають цінні папери	16
8.10. Документування, система обробки інформації та внутрішній облік Клірингових операцій на Біржі	16
Розділ 9. УМОВИ ВЗАЄМОДІЇ БІРЖІ З РОЗРАХУНКОВИМ ЦЕНТРОМ, КОЛИ КЛІРИНГ ТА РОЗРАХУНКИ ЗА СТРОКОВИМИ КОНТРАКТАМИ (ДЕРИВАТИВАМИ) ВИКОНУЄ РОЗРАХУНКОВИЙ ЦЕНТР	19
Розділ 10. РОЗКРИТТЯ ІНФОРМАЦІЇ	20

## РОЗДІЛ 1. ВИЗНАЧЕННЯ ТЕРМІНІВ ТА ПОНЯТЬ

- 1.1. *Базовий актив Строкового контракту (Деривативу) (далі - Базовий актив)* - матеріальний, нематеріальний, фінансовий або інший актив, щодо якого укладається та виконується Строковий контракт (Дериватив).
- 1.2. *Базовий показник Строкового контракту (Деривативу) (далі - Базовий показник)* - ціна Базового активу (в тому числі курс відповідної валюти), ціна послуги, процентна ставка, індекс (в тому числі біржовий індекс), показники статистичної інформації (що визначається незалежно від сторін Строкового контракту (Деривативу)), фізичні, біологічні, хімічні показники стану навколишнього середовища, інші показники, які визначаються Базовими показниками у нормативно-правових актах. Базовий показник може розраховуватися як Біржею, так і іншими організаціями, органами державної влади або іншими особами.
- 1.3. *Біржовий Строковий контракт (далі - Строковий контракт (Дериватив))* - стандартизований Договір купівлі-продажу Базового активу на строк (з поставкою в майбутньому), укладений у відповідності з цими Правилами, а також Договір виконання зобов'язань за яким залежить від зміни ціни по Базових активах, що є предметом цього Договору, або від зміни значень Базових показників. Строковий контракт (Дериватив) є Електронним документом, що укладається за Правилами Біржі та підписується ЕЦП Біржі.
- 1.4. *Варіаційна маржа* - сума коштів, що розраховується внаслідок Коригування Позиції на Строковому ринку (Ринку деривативів). Варіаційна маржа за відкритими Позиціями списується/зараховується з/на рахунки Учасників Біржових торгів з метою зниження ризиків не виконання зобов'язань за Строковим контрактом (Деривативом).
- 1.5. *Вид Строкового контракту (Деривативу)* - Строковий контракт (Дериватив) може бути з поставкою або без поставки Базового активу (розрахунковий).
- 1.6. *Виконання Строкового контракту (Деривативу):*
  - для Строкових контрактів (Деривативів) без поставки Базового активу (розрахункового Строкового контракту (Деривативу)) - виплата різниці між Ціною виконання та Ціною укладання (для Ф'ючерсного контракту (Ф'ючерсу)) або між Ціною виконання та фактичною ціною Базового активу чи ціною, визначеною в залежності від значення Базового показника (для Опціону);
  - для Строкових контрактів (Деривативів) з поставкою Базового активу - здійснення поставки Базового активу та його оплата за Ціною виконання.
- 1.7. *Граничне значення ціни* - максимальне/мінімальне значення ціни Ф'ючерсного контракту (Ф'ючерсу), за якою можуть подаватися Заявки до ЕТС Біржі. Максимальне (мінімальне) Граничне значення ціни визначається шляхом додавання (віднімання) до (від) ціни відкриття/ціни закриття/Розрахункової ціни ліміту зміни ціни, що встановлюється рішенням Біржової Ради або директора Біржі.
- 1.8. *Дата виконання* - день виконання поставки Базового активу за Строковим контрактом (Деривативом) з поставкою Базового активу або виконання кінцевих розрахунків за розрахунковим Строковим контрактом (Деривативом), в порядку, визначеному цими Правилами та Специфікацією.
- 1.9. *Заявка* - Електронний документ, який поданий Учасником Біржових торгів до ЕТС Біржі та підписаний його ЕЦП, що містить безумовну пропозицію (оферту) на укладання Строкового контракту (Деривативу) згідно умов поданої Заявки відповідно до цих Правил.
- 1.10. *Інформація Біржі щодо формування розрахункових документів* - Електронний документ, що формується АС Біржі та містить реквізити для формування всіх документів на переказ коштів за наслідками Біржових торгів.
- 1.11. *Кліринг* - визначення взаємних зобов'язань за Строковими контрактами (Деривативами), у тому числі шляхом Неттінгу. У разі якщо Кліринг виконується Біржею, зобов'язання за Строковими контрактами (Деривативами) контрагентів всіх Учасників Біржових торгів обліковуються в Кліринговому реєстрі на центральному Позиційному рахунку, який відкривається Біржею.
- 1.12. *Клірингова операція* - послідовність дій Біржі або Розрахункового центру, які забезпечують проведення Клірингу за цими Правилами.

- 1.13. *Клірингова сесія* - визначений Біржею або Розрахунковим центром проміжок часу в межах Операційного часу Біржі або Розрахункового центру відповідно, коли здійснюється Кліринг.
- 1.14. *Кліринговий пул* - визначена Біржею сукупність зобов'язань за Строковими контрактами, що допущені до Клірингу та припиняються під час проведення Клірингової сесії.
- 1.15. *Кліринговий реєстр* - аналітичний реєстр, що формується Біржею (у разі, якщо Кліринг виконується Біржею) для обліку Клірингових операцій.
- 1.16. *Код Строкового контракту (Деривативу)* - встановлена Специфікацією умовна позначка Строкового контракту (Деривативу), що використовується в документах Біржі та з використанням якої Біржею розкривається інформація про результати Біржових торгів на Строковому ринку (Ринку деривативів).
- 1.17. *Коригування Позицій* - процедура переоцінки Позицій, в результаті якої розраховується Варіаційна маржа за кожною Позицією.
- 1.18. *Маржинальна вимога* - вимога Біржі або Розрахункового центру Учаснику Біржових торгів щодо збільшення розміру та/або ініціювання іншого способу забезпечення виконання зобов'язань щодо переказу Варіаційної маржі за Строковим контрактом (Деривативом) та/або його виконання в Дату виконання.
- 1.19. *Мінімальна зміна ціни (далі - Тік)* - мінімальний крок зміни ціни Ф'ючерсного контракту (Ф'ючерсу) або розміру Премії за Опціоном, що встановлюється Специфікацією. Ціна виконання, Ціна укладання, Премія та Розрахункова ціна кратні Тіку.
- 1.20. *Неплатоспроможність* - неспроможність Учасника Біржових торгів своєчасно та в повному обсязі виконати свої зобов'язання.
- 1.21. *Неттінг* - повне або часткове припинення зобов'язань за Строковими контрактами (Деривативами) шляхом заліку зобов'язань або іншим способом. На момент здійснення Неттінгу строк виконання зобов'язань, за якими здійснюється Неттінг, вважається таким, що настав.
- 1.22. *Novation (англ. «новейшн»)* - заміна сторони Строкового контракту (Деривативу) Центральним контрагентом у відповідності з Правилами клірингу Розрахункового центру (у разі, якщо Кліринг виконується Розрахунковим центром).
- 1.23. *Операційний час Біржі* - встановлена Біржею частина Торговельного дня, протягом якої приймаються Заявки, укладаються Строкові контракти (Деривативи) та здійснюється Кліринг (у разі, якщо Кліринг виконується Біржею), що мають бути оброблені, передані та виконані протягом цього ж робочого дня.
- 1.24. *Опціон* - Строковий контракт (Дериватив), який засвідчує
- право, але не обов'язок Покупця Опціону (та обов'язок Продавця Опціону) придбати (продати) (*Опціон колл*) або продати (придбати) (*Опціон пут*) певну кількість Базового активу в Дату виконання (для Опціону з поставкою Базового активу),
  - право, але не обов'язок Покупця Опціону (та обов'язок Продавця Опціону) отримати (сплатити) винагороду (у разі наявності) в розмірі різниці між Ціною виконання Опціону та фактичною ціною Базового активу або ціною, визначеною в залежності від значення Базового показника в Дату виконання (для розрахункового Опціону).
- 1.25. *Офсетний (зворотній) Строковий контракт (Дериватив)* - Строковий контракт (Дериватив), при укладанні якого закривається Позиція у зв'язку з виникненням протилежної Позиції по тій самій Серії Строкового контракту (Деривативу).
- 1.26. *Позиція* - параметр обліку зобов'язань за Строковим контрактом (Деривативом) однієї Серії, що виникає за укладеним Учасником Біржових торгів (його Клієнтом) Строковим контрактом (Деривативом).
- 1.27. *Позиційний рахунок* - аналітичний рахунок, за яким Біржею (у разі, якщо Кліринг виконується Біржею) обліковуються відкриті Позиції Учасників Біржових торгів (їх Клієнтів) за укладеними Строковими контрактами (Деривативами). Позиційний рахунок ведеться в розрізі Учасників Біржових торгів (їх Клієнтів).
- 1.28. *Покупець Опціону* - Учасник Біржових торгів-сторона Опціону, що набула право, але не обов'язок купити або продати певну кількість Базового активу, що є предметом Опціону, за Ціною виконання (для Опціону з поставкою Базового активу) або право отримати винагороду в розмірі різниці (якщо така різниця на користь Покупця Опціону) між Ціною виконання та фактичною ціною Базового активу або ціною, визначеною в

- залежності від значення Базового показника в Дату виконання (для розрахункового Опціону).
- 1.29. *Початкова маржа* - параметр забезпечення виконання зобов'язань за Строковими контрактами (Деривативами). Розмір Початкової маржі встановлюється Біржею або, у випадках обумовлених цими Правилами, Розрахунковим центром та забезпечує виконання зобов'язань Учасника Біржових торгів щодо сплати Варіаційної маржі та/або Премії, виконання Строкових контрактів (Деривативів), покриття всіх можливих витрат Учасника Біржових торгів (Біржі), пов'язані з проведенням примусового закриття Позичій, та компенсації невиконання зобов'язань Учасника Біржових торгів щодо поставки/оплати Базового активу.
  - 1.30. *Правила ПАТ «Фондова біржа «Перспектива» (далі - Правила Біржі)* - документ Біржі, зареєстрований Національною комісією з цінних паперів та фондового ринку (далі - Комісія) у відповідності до законодавства.
  - 1.31. *Премія Опціону (далі - Премія)* - сума коштів, що сплачується Покупцем Опціону Продавцю Опціону в якості винагороди при укладанні Опціону.
  - 1.32. *Продавець Опціону* - Учасник Біржових торгів-сторона Опціону, що набула обов'язок купити або продати певну кількість Базового активу, що є предметом Опціону, за Ціною виконання (для Опціону з поставкою Базового активу) або обов'язок сплатити винагороду в розмірі різниці (якщо така різниця не на користь Продавця Опціону) між Ціною виконання та фактичною ціною Базового активу або ціною, визначеною в залежності від значення Базового показника в Дату виконання (для розрахункового Опціону).
  - 1.33. *Реєстр Грошових лімітів* - Електронний документ, що формується Платіжною організацією та містить перелік Грошових лімітів усіх Учасників Біржових торгів на Строковому ринку (Ринку деривативів).
  - 1.34. *Реєстр обліку зобов'язань* - Кліринговий реєстр, який кореспондується з Реєстром обліку Позичій, формується Біржею та містить перелік усіх аналітичних рахунків для обліку зобов'язань щодо переказу коштів або поставки Базового активу кожного Учасників Біржових торгів та операцій на них.
  - 1.35. *Реєстр обліку Позичій* - Кліринговий реєстр, який містить центральний Позичійний рахунок та усі Позичійні рахунки, які відкриті Учасникам Біржових торгів (їх Клієнтам) на Строковому ринку (Ринку деривативів), та операції на них.
  - 1.36. *Реєстр Строкових контрактів (Деривативів)* - Електронний документ, що формується АС Біржі та містить перелік усіх Строкових контрактів (Деривативів), які укладені Учасниками Біржових торгів (їх Клієнтами) протягом Торговельної сесії на Строковому ринку (Ринку деривативів). Реєстр Строкових контрактів (Деривативів) містить усі визначені цими Правилами реквізити Строкових контрактів (Деривативів), а також відомості про Заявки, на підставі яких ці Строкові контракти (Деривативи) були укладені.
  - 1.37. *Різновид Опціону* - Опціон може бути на купівлю (*Опціон колл*) або продаж (*Опціон пут*) Базового активу.
  - 1.38. *Розрахункова ціна* - ціна Ф'ючерсних контрактів (Ф'ючерсів) визначеної Серії Ф'ючерсних контрактів (Ф'ючерсів) у визначений момент часу протягом Біржових торгів на Строковому ринку, що розраховується Біржею на Строковому ринку (Ринку деривативів) відповідно до Специфікації Ф'ючерсного контракту (Ф'ючерсу).
  - 1.39. *Розрахунковий депозитарій* - Центральний депозитарій цінних паперів або НБУ, в якому Учасником Біржових торгів заблоковані цінні папери, що складають Додаткове забезпечення, та/або у якому відбуваються розрахунки в цінних паперах, якщо Базовим активом Строкового контракту (Деривативу) є цінні папери.
  - 1.40. *Серія Опціону* - сукупність Опціонів однієї Специфікації та одного Різновиду Опціону з однаковими Цінами виконання, що позначаються Кодом Опціону.
  - 1.41. *Серія Ф'ючерсного контракту (Ф'ючерсу)* - сукупність Ф'ючерсних контрактів (Ф'ючерсів) однієї Специфікації та одної Дати виконання, що позначаються Кодом Строкового контракту (Деривативу).
  - 1.42. *Специфікація Строкового контракту (Деривативу) (далі - Специфікація)* - документ Біржі, що є зразковою формою Строкового контракту (Деривативу) та надає конкретні визначення стандартизованих параметрів Строкового контракту (Деривативу) та порядок його виконання. Специфікації є невід'ємною частиною цих Правил.

- 1.43.** Термін дії Опціону - період часу, протягом якого Покупець Опціону має право вимоги за Опціоном, якщо інше не визначено Специфікацією.
- 1.44.** Торговий термінал Учасника Біржових торгів на Строковому ринку (Ринку деривативів) (далі - Торговий термінал BIT eTrade Future) - програмно-апаратний комплекс Учасника Біржових торгів на Строковому ринку (Ринку деривативів) з програмним забезпеченням, що дає змогу Учасникам Біржових торгів на Строковому ринку (Ринку деривативів) отримати доступ до Біржових торгів з метою виставлення Заявок та укладання Строкових контрактів (Деривативів), ініціювати, створювати, приймати, передавати, зберігати, перевіряти цілісність Електронних документів, отримувати довідкову інформацію та друкувати документи.
- 1.45.** Ф'ючерсний контракт (Ф'ючерс) - Строковий контракт (Дериватив), який засвідчує зобов'язання поставити або отримати певну кількість Базового активу у майбутньому та оплатити такий Базовий актив за Ціною виконання Ф'ючерсного контракту (Ф'ючерсу) з поставкою Базового активу або сплатити винагороду в залежності від Ціни виконання Ф'ючерсного контракту (Ф'ючерсу) (розрахунковий Ф'ючерсний контракт (Ф'ючерс)).
- 1.46.** Ціна виконання Опціону - ціна, за якою укладається Опціон.
- 1.47.** Ціна виконання Ф'ючерсного контракту (Ф'ючерсу) - фактична ціна Базового активу або ціна, визначена в залежності від значення Базового показника в Дату виконання.
- 1.48.** Ціна укладання Ф'ючерсного контракту (Ф'ючерсу) - ціна, за якою укладається Ф'ючерсний контракт (Ф'ючерс).
- 1.49.** Центральний Позичийний рахунок - аналітичний рахунок, за яким Біржею (у разі, якщо Кліринг виконується Біржею) обліковуються Позичії, протилежні за напрямом відкритим Позичіям Учасників Біржових торгів (їх Клієнтів) за укладеними Строковими контрактами (Деривативами).
- Інші терміни та поняття, які вживаються в цих Правилах, використовуються згідно з чинним законодавством України, Правилами Біржі та Правилам клірингу Розрахункового центру.

## РОЗДІЛ 2. ЗАГАЛЬНІ ПОЛОЖЕННЯ

2.1. Ці Правила є практичним твором, авторські майнові права на який належать ПУБЛІЧНОМУ АКЦІОНЕРНОМУ ТОВАРИСТВУ «ФОНДОВА БІРЖА «ПЕРСПЕКТИВА», та охороняються відповідно до норм чинного законодавства України.

2.2. Ці Правила є частиною Правил Біржі, викладеною у формі окремого документа, що регулює правила торгівлі та Клірингу на Строковому ринку (Ринку деривативів).

2.3. Ці Правила розроблено у відповідності до Законів України «Про цінні папери та фондовий ринок», «Про державне регулювання ринку цінних паперів в Україні», «Про платіжні системи та переказ коштів в Україні», «Про фінансові послуги та державне регулювання ринків фінансових послуг», «Про депозитарну систему України», «Про електронні документи та електронний документообіг», «Про електронний цифровий підпис», «Про інформацію», «Про захист інформації в інформаційно-телекомунікаційних системах», «Про запобігання та протидію легалізації (відмивання) доходів, одержаних злочинним шляхом», інших законодавчих актів України, в тому числі нормативно-правових актів Національного банку України (далі - НБУ) та Комісії, рекомендацій міжнародних фінансових організацій (Рекомендації для систем розрахунків за цінними паперами, Банк міжнародних розрахунків, Міжнародна організація комісій з цінних паперів, 2001 р.; Поставка проти оплати в системах розрахунків за цінними паперами, Комітет по платіжним та розрахунковим системам, Банк міжнародних розрахунків, 1992; Принципи для інфраструктур фінансових ринків, Банк міжнародних розрахунків, Міжнародна організація комісій з цінних паперів, березень 2011 р.; Принципи для інфраструктури фінансового ринку, Банк міжнародних розрахунків, Міжнародна організація комісій з цінних паперів, травень 2012 р.) та Правил Біржі.

2.4. Строковий ринок (Ринок деривативів) - це окремий Ринок Біржі, організований для Біржових торгів Ф'ючерсними контрактами (Ф'ючерсами) та Опціонами. Біржа організовує Біржові торги на Строковому ринку (Ринку деривативів) та забезпечує виконання Учасниками Біржових торгів своїх зобов'язань за укладеними Строковими контрактами (Деривативами) в порядку, встановленому цими Правилами.

2.5. Правила визначають загальні принципи функціонування Строкового ринку (Ринку деривативів), його організаційне та технологічне забезпечення, порядок отримання доступу до Строкового ринку (Ринку деривативів), взаємовідносини між Біржею, Платіжною організацією або Розрахунковим центром, Розрахунковим депозитарієм та Учасниками Біржових торгів, загальну технологію операційної діяльності Біржі при забезпеченні виконання зобов'язань за Строковими контрактами (Деривативами), правила документообігу, управління Ризиками, розкриття інформації тощо. Ці Правила також регламентують проведення Клірингу у разі, якщо Кліринг виконується Біржею.

2.6. Шляхом впровадження на Строковому ринку (Ринку деривативів) системи управління Ризиками (відповідно до Правил Біржі) та користування Біржею та Учасниками Біржових торгів для Клірингу та розрахунків щодо Строкових контрактів (Деривативів) послугами Платіжної організації або Розрахункового центру забезпечується виконання зобов'язань Учасників Біржових торгів на Строковому ринку (Ринку деривативів).

2.7. Клірингові процедури щодо Коригування Позичій знижують Ризик не виконання зобов'язань за укладеними Строковими контрактами (Деривативами) до Дати виконання Строкового контракту (Деривативу) включно. Припинення зобов'язань за укладеними Строковими контрактами (Деривативами) забезпечується шляхом виконання Строкового контракту (Деривативу) або укладення Офсетних Строкових контрактів (Деривативів).

### **РОЗДІЛ 3. ДОСТУП ДО ТОРГІВ НА СТРОКОВОМУ РИНКУ (РИНКУ ДЕРИВАТИВІВ)**

3.1. Участь у Біржових торгах на Строковому ринку (Ринку деривативів) можуть брати Учасники Біржових торгів.

Учасник Біржових торгів, що підписав Договір доступу до ЕТС Біржі, погоджується з тим, що усі Строкові контракти (Деривативи) укладаються на Біржі виключно на умовах, викладених у цих Правилах, та приєднується до цих Правил.

3.2. У Специфікації відповідного Строкового контракту (Деривативу) можуть зазначатись спеціальні умови доступу Учасників Біржових торгів до Біржових торгів цим Строковим контрактом (Деривативом).

3.3. Якщо Кліринг та розрахунки на Строковому ринку (Ринку деривативів) здійснюються Розрахунковим центром, то умовою доступу Учасника Біржових торгів до торгів на Строковому ринку (Ринку деривативів) є укладання та чинність договорів щодо Клірингу та розрахунків Учасників Біржових торгів з Розрахунковим центром.

### **РОЗДІЛ 4 ТОРГОВИЙ ТЕРМІНАЛ BIT eTrade Future**

4.1. Інформаційна взаємодія між Учасником Біржових торгів та Біржею, а, у разі необхідності, з Розрахунковим центром при укладанні Строкових контрактів (Деривативів), отримання інформації про хід Біржових торгів щодо наявності в Учасників Біржових торгів забезпечення та значення параметрів забезпечення, забезпечується за допомогою Торгового терміналу BIT eTrade Future.

4.2. Торговий термінал BIT eTrade Future дозволяє виконувати наступні функції:

- виставляти Заявки на Строковому ринку (Ринку деривативів) у формі Електронних документів;
- одержувати інформацію щодо значення параметрів системи забезпечення

- виконання зобов'язань Учасника Біржових торгів в реальному режимі часу (online);
- одержувати інформацію щодо відхилення Заявок, укладених Строкових контрактів (Деривативів), частково виконаних Заявок тощо;
- друкувати примірники Виписок з Реєстру Заявок на Строковому ринку (Ринку деривативів), Виписок з Реєстру Строкових контрактів (Деривативів) та інших документів, що надаються Біржею Учасникам Біржових торгів відповідно до п. 8.11 цих Правил;
- інформацію про хід та результати Біржових торгів на Строковому ринку (Ринку деривативів) та іншу біржову інформацію;
- забезпечувати авторизований доступ користувачів та унеможливити несанкціонований доступ;
- забезпечувати конфіденційність обміну інформацією під час подання Заявок та укладання Строкових контрактів (Деривативів);
- вести бази даних щодо подання Заявок та укладання Строкових контрактів (Деривативів);
- отримувати Маржинальну вимогу;
- інші функціональні можливості у відповідності з договором доступу до Біржових торгів.

4.3. Підключення Торгового терміналу BIT eTrade Future Учасника Біржових торгів до АС Біржі здійснюється відповідно до процедури Доступу до Біржових торгів та потребує наявності та використання на робочому місці Учасника Біржових торгів:

- сучасного персонального комп'ютеру, який функціонує під управлінням операційної системи не нижче WINDOWS XP SP2;
- ліцензованого антивірусного програмного забезпечення;
- доступу до мережі Інтернет;
- зареєстрованого в ЦСК Біржі сертифікату ключів ЕЦП та засобів КЗІ, наданих ЦСК Біржі згідно з Договором про надання послуг ЕЦП.

## **РОЗДІЛ 5.**

### **СИСТЕМА УПРАВЛІННЯ РИЗИКАМИ НА СТРОКОВОМУ РИНКУ (РИНКУ ДЕРИВАТИВІВ)**

5.1. Система управління ризиками на Строковому ринку (Ринку деривативів) доповнює загальну систему управління ризиками на Біржі, що викладена в Правилах Біржі, враховує особливості Строкового ринку (Ринку деривативів) та має особливості, встановлені в цьому Розділі.

5.2. На Строковому ринку (Ринку деривативів), у разі, якщо Кліринг виконується Біржею, для мінімізації основного, системного, ринкового, кредитного Ризиків та Ризику ліквідності для повного забезпечення виконання зобов'язань за Строковими контрактами (Деривативами) встановлюється процедура Коригування Позицій та обов'язкове перерахування за її наслідками Варіаційної маржі у якості передплати за Строковими контрактами (Деривативами).

5.3. Для мінімізації операційного Ризику при здійсненні Клірингу Біржею на Строковому ринку (Ринку деривативів) здійснюються наступні додаткові заходи:

- в АС Біржі виконується автоматична звірка виписок з Позиційного рахунку з усіма операціями на Позиційному рахунку;
- проводиться регламентна або позапланова (у разі необхідності) архівація операцій за Позиційними рахунками;
- обмежується перелік та ретельно регламентуються операції, що виконуються за Позиційними рахунками та аналітичними рахунками, відкритими Біржею для обліку зобов'язань щодо переказу коштів Учасниками Біржових торгів.

5.4. У разі, якщо Кліринг та розрахунки на Строковому ринку (Ринку деривативів) виконує Розрахунковий центр, система управління Ризиками, крім операційного та



правового Ризиків, що виникають під час Біржових торгів, визначається внутрішніми документами Розрахункового центру.

5.5 Учасник Біржових торгів несе відповідальність за власні зобов'язання та зобов'язання своїх Клієнтів і повинен самостійно вести облік укладених ним Строкових контрактів (Деривативів) та Строкових контрактів (Деривативів), укладених ним в інтересам своїх Клієнтів, власних зобов'язань та зобов'язань своїх Клієнтів.

## РОЗДІЛ 6.

### ЗАБЕЗПЕЧЕННЯ ВИКОНАННЯ ЗОБОВ'ЯЗАНЬ УЧАСНИКІВ БІРЖОВИХ ТОРГІВ НА СТРОКОВОМУ РИНКУ (РИНКУ ДЕРИВАТИВІВ) ПРИ ВИКОНАННІ КЛІРИНГУ БІРЖЕЮ

6.1. Система забезпечення виконання зобов'язань за Строковими контрактами (Деривативами) встановлює наступні параметри:

- i) Грошовий ліміт;
- ii) Розрахунковий грошовий ліміт;
- iii) Початкову маржу.

6.2. Розмір сукупної Початкової маржі для відкриття та подальшого підтримання відкритих Позичій за певним Строковим контрактом (Деривативом) визначається за формулою:

*Початкова маржа = Ставка Початкової маржі \* Кількість відкритих Позичій за Серією Строкового контракту (Деривативу).*

6.3. Строковий контракт (Дериватив) укладається (Позиція відкривається) виключно за умови, що розмір Розрахункового грошового ліміту Учасника Біржових торгів не менше розміру Початкової маржі.

6.4. Розрахунковий грошовий ліміт Учасника Біржових торгів (Сторони Ф'ючерсного контракту (Ф'ючерсу) та Продавця Опціону) повинен перевищувати розмір сукупної Початкової маржі за усіма відкритими Позичіями до Дати виконання Ф'ючерсного контракту (Ф'ючерсу) включно та протягом Терміну дії Опціону до Дати виконання Опціону включно, відповідно.

6.5. Для Покупця Опціону наявність Початкової маржі вимагається тільки при укладанні Опціону.

6.6. До Дати виконання Ф'ючерсного контракту (Ф'ючерсу) та протягом Терміну дії Опціону розмір Початкової маржі за певними або всіма Строковими контрактами (Деривативами) може змінюватись за рішеннями директора Біржі.

6.7. На початок кожного Торговельного дня та протягом Біржових торгів на Строковому ринку (Ринку деривативів) Розрахунковий грошовий ліміт Учасника Біржових торгів повинен бути не меншим ніж:

- а) при Біржових торгах Ф'ючерсними контрактами (Ф'ючерсами):
  - розмір однієї ставки Початкової маржі на кожен відкриту Позичію Учасника Біржових торгів;
  - суми, нарахованої до сплати Біржі за результатами торгів попереднього Торговельного дня відповідно до тарифів Біржі, опублікованих на Інтернет-сайті Біржі (далі - тарифів Біржі).
- б) при Біржових торгах для Продавця Опціону:
  - розмір однієї Початкової маржі на кожен відкриту Позичію Учасника Біржових торгів;
  - суми, нарахованої до сплати Біржі за результатами торгів попереднього Торговельного дня відповідно до тарифів Біржі;
- в) при Біржових торгах для Покупця Опціону:

- суми, достатньої для сплати Премії за кожний Опціон в день укладання Опціону;
- суми, нарахованої до сплати Біржі за результатами торгів попереднього Торговельного дня відповідно до тарифів Біржі.

6.8. Специфікацією може бути передбачено інший порядок забезпечення виконання зобов'язань за Строковими контрактами (Деривативами), в т.ч. шляхом попереднього блокування Базового активу та коштів.

## **РОЗДІЛ 7. ПОРЯДОК ОРГАНІЗАЦІЇ ТА ПРОВЕДЕННЯ ТОРГІВ НА СТРОКОВОМУ РИНКУ (РИНКУ ДЕРИВАТИВІВ)**

### *7.1. Строковий контракт (Дериватив)*

Строковий контракт (Дериватив) допускається до Біржових торгів після затвердження його Специфікації Біржовою Радою, погодження, у разі необхідності, в НБУ та реєстрації в Комісії згідно з вимогами чинного законодавства. Рішення Біржової Ради про затвердження Специфікації доводиться до відома Учасників Біржових торгів шляхом розміщення на Інтернет-сайті Біржі не пізніше як за один робочий день до першого дня Біржових торгів Строковим контрактом (Деривативом).

Умови виконання Строкового контракту (Деривативу) вказуються у Специфікації відповідного Строкового контракту (Деривативу).

За рішенням відповідального співробітника Розрахункового центру або директора Біржі у разі різкої зміни або різких коливань ціни на Базовий актив або значення Базового показника торгівля певною Серією Строкового контракту (Деривативу) може бути зупинено або припинено. За рішенням директора Біржі у разі низької ліквідності Строкового контракту (Деривативу) Біржові торги таким Строковим контрактом (Деривативом) може бути припинено в порядку, визначеному п. 8.6.4 цих Правил.

### *7.2. Подання та реєстрація Заявки*

Факт подання Заявки на Біржу і час її отримання реєструється автоматично в ЕТС Біржі та відображається в Торговому терміналі ВІТ eTrade Future. Кожній Заявці, поданій в ЕТС Біржі, Біржею присвоюється унікальний ідентифікаційний номер в Реєстрі Заявок Біржі. Зареєстрована Біржею Заявка є згодою цього Учасника Біржових торгів укласти та виконати Строковий контракт (Дериватив) у відповідності з умовами Заявки та цих Правил.

### *7.3. Види Заявок*

На Строковому ринку (Ринку деривативів) використовуються наступні види Заявок:

- ринкова Заявка (Market) - пропозиція укласти вказану кількість Строкових контрактів (Деривативів) за найкращою ціною, яка є в даний момент часу на Біржових торгах;
- лімітна Заявка (Limit) - розпорядження укласти визначену кількість Строкових контрактів (Деривативів) по ціні, відповідно, не вище (не нижче), ніж зазначена в Заявці.

### *7.4. Зміст Заявок*

7.4.1. Заявки на Строковому ринку (Ринку деривативів) повинні містити щонайменше наступні параметри:

Для Ф'ючерсних контрактів (Ф'ючерсів):

- Код Ф'ючерсного контракту (Ф'ючерсу);
- кількість Ф'ючерсних контрактів (Ф'ючерсів);
- Ціна укладання Ф'ючерсного контракту (Ф'ючерсу) (для лімітної Заявки);
- направленість дії Заявки (купівля або продаж);
- вид Заявки;
- найменування та реквізити Учасника Біржових торгів (його Клієнта або код Клієнта);
- ЕЦП Учасника Біржових торгів.

Для Опціонів:

- Код Опціону;
- кількість Опціонів;
- Різновид Опціону;
- Ціна виконання Опціону (для лімітної Заявки);
- направленість дії Заявки (купівля або продаж);
- Премія;
- найменування та реквізити Учасника Біржових торгів (його Клієнта або код Клієнта);
- ЕЦП Учасника Біржових торгів.

7.4.2. Ідентифікаційний номер Заявки, дата та час реєстрації автоматично присвоюється ЕТС Біржі.

#### *7.5. Укладання Ф'ючерсних контрактів (Ф'ючерсів)*

7.5.1. Подані на Біржові торги на Строковому ринку (Ринку деривативів) Заявки виконуються, тобто Ф'ючерсний контракт (Ф'ючерс) укладається, якщо в зустрічних Заявках співпадають наступні істотні умови, а саме:

- Код Ф'ючерсного контракту (Ф'ючерсу);
- ціна Ф'ючерсного контракту (Ф'ючерсу).

7.5.2. Учасник Біржових торгів-сторона Ф'ючерсного контракту (Ф'ючерсу) може відмовитися від його виконання виключно за умови згоди іншої сторони Ф'ючерсного контракту (Ф'ючерсу) та/або Центрального контрагента або у випадках визначених цивільним законодавством.

#### *7.6. Укладання Опціонів*

7.6.1. Подані на Біржові торги на Строковому ринку (Ринку деривативів) Заявки виконуються, тобто Опціон укладається, якщо в зустрічних Заявках співпадають наступні істотні умови:

- Код Опціону;
- Ціна виконання Опціону;
- Різновид Опціону;
- Премія.

7.6.2. Торгівля Опціонами відповідно до цих Правил передбачає можливість відмови Покупця Опціону від його виконання та не передбачає можливість відмови Продавця Опціону від його виконання.

#### *7.7. Особливості визначення Розрахункової ціни*

7.7.1. Ціною відкриття Торговельної сесії вважається ціна закриття попередньої Торговельної сесії. У випадках різких коливань (межі яких визначаються Біржею) на ринку Базового активу або різких коливань Базового показника та/або за Ф'ючерсними контрактами (Ф'ючерсами) з низькою ліквідністю директор Біржі має право встановлювати іншу ціну відкриття за відповідними Ф'ючерсними контрактами (Ф'ючерсами) .

7.7.2. Ціна відкриття першої Торговельної сесії (стартова ціна) за новою Серією Ф'ючерсного контракту (Ф'ючерсу) встановлюється рішенням директора Біржі.

7.7.3. Протягом Біржових торгів безперервно розраховується Розрахункова ціна як середньозважена ціна усіх укладених Ф'ючерсних контрактів (Ф'ючерсів) відповідної Серії протягом Торговельної сесії. При розрахунку Розрахункової ціни отримане значення округляється до значення, що кратне Тіку, зазначеному у Специфікації відповідного Ф'ючерсного контракту (Ф'ючерсу).

7.7.4. Ціною закриття за відповідною Серією Ф'ючерсного контракту (Ф'ючерсу) є Розрахункова ціна, визначена на кінець Торговельної сесії за цією Серією Ф'ючерсного контракту (Ф'ючерсу).

7.7.5. Розрахункова ціна, визначена на кінець Торговельної сесії (ціна закриття), якщо це передбачається Специфікацією відповідного Ф'ючерсного контракту (Ф'ючерсу), може встановлюватись в залежності від значення Базового показника. Специфікацією може бути встановлено інший порядок визначення Розрахункової ціни, визначеної на кінець Торговельної сесії (ціни закриття) за відповідною Серією Ф'ючерсного контракту (Ф'ючерсу), для випадків, коли Базовий показник, який розраховується іншими організаціями, органами

державної влади або іншими особами, відсутній та/або не відповідає вимогам, встановленим Специфікацією.

#### *7.8. Запобігання маніпулювання цінами*

7.8.1. Директор Біржі для підтримки на Строковому ринку (Ринку деривативів) добросовісної конкуренції може приймати наступні заходи щодо регулювання ринку:

- встановлювати Ціну відкриття Торговельної сесії при Біржових торгах Ф'ючерсними контрактами (Ф'ючерсами),
- встановлювати ліміти зміни ціни, ліміт загальної кількості Позичій для попередження монополізації ринку, ліміти на відкриття Короткої та/або Довгої Позичій при Біржових торгах Ф'ючерсними контрактами (Ф'ючерсами);
- призупиняти участь окремих Учасників Біржових торгів у Біржових торгах на Строковому ринку (Ринку деривативів), а також застосувати інші заходи дисциплінарного впливу відповідно до Правил Біржі у разі порушення ними цих Правил та інших документів Біржі;
- зупиняти або припиняти Біржові торги за всіма чи окремими Серіями Строкових контрактів (Деривативів).

7.8.2. Ліміт зміни ціни встановлюється рішенням Біржової ради або директора Біржі як відсоток (співвідношення) до значення ціни відкриття/ціни закриття/Розрахункової ціни з метою визначення Граничних значень ціни для кожної Серії Ф'ючерсних контрактів (Ф'ючерсів).

Ціни Заявок та Ф'ючерсних контрактів (Ф'ючерсів) протягом однієї Торговельної сесії мають бути у межах Граничних значень ціни.

ЕТС Біржі протягом Торговельної сесії відхиляє всі Заявки, надані по ціні, що знаходиться поза межами встановлених Граничних значень цін за відповідною Серією Ф'ючерсних контрактів (Ф'ючерсами).

7.8.3. Директор Біржі може встановлювати ліміт загальної кількості відкритих Позичій (ліміт на частку Строкового ринку (Ринку деривативів)) для обмеження частки відкритих Позичій Учасника Біржових торгів по кожній Серії Ф'ючерсних контрактів (Ф'ючерсів).

Ліміти на відкриття Короткої та Довгої позичій - це максимальна кількість відповідно Коротких та Довгих позичій, які Учасник Біржових торгів може відкрити. Цей ліміт директор Біржі встановлює тільки у випадках, коли це передбачено спеціальними умовами доступу Учасників Біржових торгів до торгів Серією відповідного Ф'ючерсного контракту (Ф'ючерсу). В такому разі ліміти на відкриття Короткої та/або Довгої позичій встановлюються Біржею Учаснику Біржових торгів у відповідності з вимогами, передбаченими спеціальними умовами доступу Учасників Біржових торгів до Біржових торгів відповідним Ф'ючерсним контрактом (Ф'ючерсом).

## **РОЗДІЛ 8.**

### **ПОРЯДОК ЗДІЙСНЕННЯ БІРЖЕЮ КЛІРИНГУ, ЗАКРИТТЯ ПОЗИЦІЙ ТА ВИКОНАННЯ СТРОКОВИХ КОНТРАКТІВ (ДЕРИВАТИВІВ)**

У разі, якщо Кліринг на Строковому ринку (Ринку деривативів) здійснюється Біржею, передбачається наступний порядок Клірингу:

#### *8.1. Клірингові сесії*

8.1.1. У кожен Торговельний день Біржа проводить Клірингові сесії.

8.1.2. Клірингова сесія проводиться Біржею одночасно з Торговельною сесією на Строковому ринку (Ринку деривативів) та після її закінчення.

8.1.3. В ході Клірингової сесії Біржа:

- 1) обліковує зобов'язання за розрахунковими Строковими контрактами (Деривативами) в Дату виконання на Позичійних рахунках;
- 2) проводить Коригування Позичій та розраховує Варіаційну маржу за кожною Серією Строкового контракту (Деривативу);
- 3) об'єднує зобов'язання за Строковими контрактами (Деривативами) у Кліринговий пул, припиняє зобов'язання за Строковими контрактами (Деривативами) та розраховує зобов'язання Учасників Біржових торгів щодо переказу коштів або поставки Базового активу на аналітичних рахунках в Реєстрі обліку зобов'язань;

- 4) перевіряє дотримання умови забезпеченості зобов'язань Учасників Біржових торгів за Строковими контрактами (Деривативами) на Строковому ринку (Ринку деривативів) і, в разі недотримання, формує та направляє Учаснику Біржових торгів на Строковому ринку (Ринку деривативів) Маржинальну вимогу;
- 5) проводить процедуру примусової ліквідації Позичій;
- 6) формує звіти для Учасників Біржових торгів на Строковому ринку (Ринку деривативів).

### *8.2. Відкриття Позичій*

За кожним щойно укладеним Строковим контрактом (Деривативом) Біржею відкривається одна Позичія, що обліковується на Позичійному рахунку Учасника Біржових торгів та (протилежна за напрямом) на центральному Позичійному рахунку, крім випадків, коли укладання Строкового контракту (Деривативу) призводить до закриття Позичії. У разі відкриття Позичії така відкрита Позичія обліковується за поточною Розрахунковою ціною.

Відкриті Позичії обліковуються на Позичійних рахунках Учасника Біржових торгів (його Клієнтів). Для Ф'ючерсних контрактів (Ф'ючерсів) відкривається Довга позиція (на купівлю), або Коротка позиція (на продаж).

### *8.3. Коригування Позичій та розрахунок Варіаційної маржі*

8.3.1. В разі зміни Розрахункової ціни відбувається Коригування Позичій та всі відкриті Позичії приводяться до нової Розрахункової ціни.

Коригування Позичій для Строкових контрактів (Деривативів) з поставкою Базового активу може не проводитись у разі, якщо Специфікацією передбачено інший механізм зниження Ризиків.

8.3.2. Варіаційна маржа за Позичіями, розраховується за наступною формулою:

Варіаційна маржа за Ф'ючерсним контрактом (Ф'ючерсом) = (Ціна укладання Ф'ючерсного контракту (Ф'ючерсу) або попередня Розрахункова ціна, що обліковується на відкритій Позичії – поточна Розрахункова ціна за Ф'ючерсним контрактом (Ф'ючерсом)) \* Кількість відкритих Позичій \* обсяг Ф'ючерсного контракту (Ф'ючерсу) відповідно до Специфікації Ф'ючерсного контракту (Ф'ючерсу).

Якщо Варіаційна маржа за Ф'ючерсним контрактом (Ф'ючерсом) від'ємна величина, то вона обліковується як зобов'язання продавця Ф'ючерсного контракту (Ф'ючерсу), а якщо - додатна величина, то як право на отримання передплати за Ф'ючерсним контрактом (Ф'ючерсом); при цьому на центральному Позичійному рахунку обліковуються протилежні права та зобов'язання. В протилежному випадку (для покупця Ф'ючерсного контракту (Ф'ючерсу)) - навпаки.

Варіаційна маржа за Опціоном = (Ціна виконання Опціону – Розрахункова ціна, що розраховується відповідно до Специфікації Опціону) \* Кількість відкритих Позичій \* обсяг Опціону відповідно до Специфікації Опціону.

Якщо Варіаційна маржа за Опціоном колл додатна величина, то вона обліковується як зобов'язання Продавця Опціону колл та право Покупця Опціону на отримання передплати за Опціоном колл. Якщо Варіаційна маржа за Опціоном пут від'ємна величина, то вона обліковується як зобов'язання Продавця Опціону пут та право Покупця Опціону на отримання передплати за Опціоном пут. При цьому на центральному Позичійному рахунку обліковуються протилежні права та зобов'язання.

Варіаційна Маржа для Покупця Опціону не обліковується.

Розрахунок Варіаційної маржі здійснюється протягом всього періоду Біржових торгів відповідним Строковим контрактом (Деривативом) (кожен Торговельний день): з моменту відкриття Позичії до моменту закриття Позичії.

У разі, якщо це передбачено Специфікацією, Варіаційна маржа може не розраховуватися.

8.3.3. Наслідки Коригування Позичій обліковуються на Позичійних рахунках у відповідності з п. 8.10. цих Правил.

### *8.4. Розрахунок зобов'язань щодо переказу коштів*

Біржа на підставі наслідків Коригування Позичій Учасників Біржових торгів об'єднує зобов'язання за Строковими контрактами (Деривативами) у Кліринговий пул, припиняє зобов'язання за Строковими контрактами (Деривативами) та розраховує зобов'язання Учасників Біржових торгів щодо переказу коштів.

### 8.5. Маржинальна вимога

8.5.1. За рішенням директора Біржі розмір Початкової маржі може бути змінений. При цьому Біржа здійснюється перерахунок зобов'язань Учасників Біржових торгів щодо забезпечення відкритих Позичій, та, в разі збільшення Початкової маржі, формує та надає Учасникам Біржових торгів Маржинальну вимогу щодо збільшення Початкової маржі.

8.5.2. Процедура збільшення розміру Початкової маржі здійснюється Біржею в наступному порядку:

- Біржові торги за відповідним Строковим контрактом (Деривативом) зупиняються;
- Засобами ЕТС Біржі Учасникам Біржових торгів надається Маржинальна вимога;
- для відповідного Строкового контракту (Деривативу) значення Початкової маржі в ЕТС Біржі змінюється;
- Біржа в разі необхідності, надає Учасникам Біржових торгів Маржинальну вимогу на збільшення Розрахункового грошового ліміту до розміру, достатнього для забезпечення відкритих Позичій;
- Учасник Біржових торгів поповнює власний рахунок, відкритий в Платіжній організації, а Платіжна організація здійснює перерахунок Грошового ліміту Учасників Біржових торгів та повідомляє про це Біржу;
- Розрахунковий депозитарій, у разі якщо збільшення Розрахункового грошового ліміту відбувається за рахунок Додаткового забезпечення в цінних паперах, за розпорядженням відповідної депозитарної установи (депонента) та відповідних договірних відносин між Біржею та Розрахунковим депозитарієм, додатково блокує цінні папери, що складають Додаткове забезпечення, та повідомляє про це Біржу;
- Біржа перераховує розмір Розрахункових грошових лімітів Учасників Біржових торгів, та Біржові торги по відповідній Серії Строкових контрактів (Деривативів) поновлюються.

8.5.3. Учасник Біржових торгів до моменту виконання Маржинальної вимоги до торгів Строковими контрактами (Деривативами) не допускається.

8.5.4. У разі, якщо розмір Грошового ліміту Учасника Біржових торгів є недостатнім для виконання зобов'язань щодо переказу Варіаційної маржі та/або виконання Строкового контракту (Деривативу) в Дату виконання та/або становить значення, що нижче встановленого рішенням Біржової Ради або директора Біржі співвідношення з розміром Початкової маржі, Біржа надає Учаснику Біржових торгів Маржинальну вимогу щодо збільшення Грошового ліміту.

8.5.5. У разі, якщо Учасник Біржових торгів не виконав зобов'язань щодо додаткового переказу коштів на поповнення Грошового ліміту у відповідності до п. 8.5.4. цих Правил, Біржа виконує дії щодо реалізації цінних паперів, що складають Додаткове забезпечення відповідно до Правил Біржі.

### 8.6. Закриття Позичій

8.6.1. Закриття відкритої Позичії означає припинення відповідних зобов'язань в Учасника Біржових торгів за Строковим контрактом (Деривативом). Закриття відкритої Позичії здійснюється в разі:

- виконання Строкового контракту (Деривативу);
- укладення офсетного Строкового контракту (Деривативу).

8.6.2. Для ліквідації (закриття) відкритої Позичії та відповідно анулювання своїх зобов'язань за Ф'ючерсними контрактами (Ф'ючерсами) Учасник Біржових торгів торгів-продавець (в Короткій позиції) на Строковому ринку (Ринку деривативів) повинен укласти відповідну кількість Ф'ючерсних контрактів (Ф'ючерсів) на купівлю тієї ж Серії, а Учасник Біржових торгів-покупець (в Довгій позиції) повинен укласти відповідну кількість Ф'ючерсних контрактів (Ф'ючерсів) на продаж тієї ж Серії.

8.6.3. Для ліквідації (закриття) відкритої Позичії та відповідно анулювання своїх зобов'язань за Опціонами Продавець Опціону пут повинен купити відповідну кількість

Опціонів пут тієї ж Серії, а Продавець Опціону колл - купити відповідну кількість Опціонів колл тієї ж Серії.

8.6.4. Біржею може здійснюватися примусова ліквідація Позичій Учасника(ів) Біржових торгів в наступних випадках:

8.6.4.1. в разі припинення Біржових торгів певною Серією Строкового контракту (Деривативу) відповідно до п. 7.1 цих Правил;

8.6.4.2. в разі невиконання Учасником Біржових торгів Маржинальної вимоги щодо збільшення Розрахункового грошового ліміту або Грошового ліміту у встановлений цими Правилами термін;

8.6.4.3. в разі втрати Учасником Біржових торгів доступу до торгів конкретною Серією Строкового контракту (Деривативу) або в разі виникнення обмеження на право укладання Строкового контракту (Деривативу), якщо це передбачено Специфікацією Строкового контракту (Деривативу);

8.6.4.4. в разі призупинення Учасником Біржових торгів членства на Біржі;

8.6.4.5. у разі, якщо розмір Розрахункового грошового ліміту становить значення, що нижче розміру, встановленого п. 6.7 цих Правил.

8.6.5. Процедура примусової ліквідації відкритих Позичій у випадках, викладених в п.8.6.4.1 та 8.6.4.3 цих Правил, застосовується до повної ліквідації всіх відкритих Позичій Учасника Біржових торгів за відповідною Серією Строкового контракту (Деривативу) шляхом закриття всіх відкритих Позичій за цією Серією за ціною, прирівняною до останньої зафіксованої на Біржових торгах Розрахункової ціни.

8.6.6. Процедура примусової ліквідації відкритих Позичій у випадку, викладеному в п.8.6.4.3 та 8.6.4.4 цих Правил, застосовується до повної ліквідації всіх відкритих Позичій Учасника Біржових торгів за всіма Серіями Строкових контрактів (Деривативів).

8.6.7. Процедура примусової ліквідації відкритих Позичій у випадку, викладеному в п.8.6.4.2 та 8.6.4.5 цих Правил, застосовується до досягнення стану повного забезпечення відкритих Позичій Учасника Біржових торгів. При цьому Біржа виходить з мінімально необхідної кількості відкритих Позичій, що ліквідуються.

8.6.8. При процедурі примусової ліквідації Позичій у випадку, викладеному в п.8.6.4.1, вважається що Дата виконання Строкового контракту (Деривативу) наступила, а зобов'язання за Строковим контрактом (Деривативом) виконані.

8.6.9. Процедура примусової ліквідації відкритих Позичій у випадках, викладених в п.п. 8.6.4.2÷8.6.4.4, здійснюється уповноваженим співробітником Біржі шляхом подання в ЕТС Біржі ринкових Заявок (Market) від імені та за рахунок відповідного Учасника Біржових торгів (його Клієнтів). При цьому у разі укладення Офсетного Строкового контракту (Деривативу) з Позичійного рахунку Учасника Біржових торгів (його Клієнтів) та центрального Позичійного рахунку списується відповідна кількість відкритих Позичій.

8.6.9.1. Усі витрати, пов'язані з проведенням примусового закриття відкритих Позичій, сплачуються Учасником Біржових торгів, до якого була застосована така процедура. Відповідальність за примусово закриті Позичій Клієнтів Учасника Біржових торгів несе Учасник Біржових торгів, у якого ці Клієнти перебувають на обслуговуванні.

8.6.9.2. Систематичне (більше двох разів) невиконання Учасником Біржових торгів Маржинальної вимоги, що спричинило примусове закриття його Позичій, є підставою для застосування до цього Учасника Біржових торгів заходів дисциплінарного впливу з боку Біржі відповідно до Правил Біржі.

8.6.9.3. Учасник Біржових торгів, що не ліквідував свою відкриту Позичію до Дня виконання Строкового контракту (Деривативу) і несе зобов'язання за Строковим контрактом (Деривативом), повинен їх виконати згідно Специфікації Строкового контракту (Деривативу) та цих Правил.

#### *8.7. Порядок виконання Строкових контрактів (Деривативів) в Дату виконання*

8.7.1. В Дату виконання Ф'ючерсного контракту (Ф'ючерсу) Розрахункова ціна, визначена на кінець останньої Торговельної сесії (ціна закриття), прирівнюється до Ціни виконання Ф'ючерсного контракту (Ф'ючерсу), що визначається відповідною Специфікацією.

8.7.2. Біржа не несе відповідальності за відповідність Базового показника реальній ситуації на ринку Базового активу в Дату виконання.

8.7.3. В Дату виконання розрахункового Ф'ючерсного контракту (Ф'ючерсу) настає строк виконання зобов'язань за Ф'ючерсним контрактом (Ф'ючерсом), Біржа проводить остаточне Коригування Позичій, перераховує Варіаційну маржу та закриває Позичії за

Ф'ючерсним контрактом (Ф'ючерсом). Вказані зобов'язання є зустрічними та однорідними із зобов'язаннями, що виникли при здійсненні передплати Варіаційної маржі, і підлягають заліку.

8.7.4. Порядок виконання Строкових контрактів (Деривативів) з поставкою Базового активу в Дату виконання визначається Специфікацією Строкового контракту (Деривативу).

8.7.5. Покупець Опціону у будь-який день протягом Терміну дії Опціону подає засобами ЕТС Біржі заяву про вимогу прав за Опціоном; при цьому настає Дата виконання за Опціоном. Біржа обирає Продавця Опціону за Датою та часом укладання Опціонів, починаючи з більш ранніх, закриває відповідні Позичії Продавця та Покупця Опціону та починає обліковувати зобов'язання Продавця Опціону як зобов'язання щодо поставки певної кількості Базового активу за Ціною виконання Опціону або зобов'язання сплатити (у разі наявності) винагороду в розмірі різниці між Ціною виконання та фактичною ціною Базового активу або ціною, визначеною в залежності від значення Базового показника в Дату виконання (за мінусом Варіаційної маржі, що переказувалася продавцем Опціону протягом Терміну дії Опціону). При цьому закриваються Позичії Продавця Опціону, що має найбільшу кількість відкритих Позичій за відповідною Серією Опціону, а у разі якщо таких Продавців Опціонів кілька, то Позичії закриваються пропорційно.

8.7.6. У разі, якщо в Дату виконання розрахункового Опціону зобов'язаним є Покупець Опціону, то розрахунковий Опціон вважається таким що виконаний, а зобов'язання Продавця Опціону припиняються. У разі, якщо в Дату виконання Опціону з поставкою Базового активу різниця між ціною виконання Опціону та фактичною ціною Базового активу, є від'ємною величиною (не на користь Покупця Опціону), то Опціон з поставкою Базового активу вважається таким, що виконаний, а зобов'язання Продавця Опціону припиняються.

8.7.7. У разі не виконання Строкового контракту (Деривативу) з поставкою Базового активу в Дату виконання Учасники Біржових торгів, крім Продавця Опціону, отримують компенсацію за рахунок Початкової маржі в порядку, встановленому Специфікацією Строкового контракту (Деривативу). При цьому для Учасника(ів) Біржових торгів, що винний(і) у невиконанні Строкового контракту (Деривативу), крім Покупця Опціону, Специфікацією такого Строкового контракту (Деривативу) може бути встановлене зобов'язання такого Учасника Біржових торгів сплатити штраф Біржі.

*8.8. Грошові розрахунки (переказ коштів) на виконання зобов'язань за Строковими контрактами (Деривативами)*

8.8.1. За результатами Клірингової сесії на Строковому ринку (Ринку деривативів) Біржа на підставі Реєстру обліку зобов'язань щодо переказу коштів формує та надає Платіжній організації Інформацію Біржі необхідну для формування розрахункових документів Учасників Біржових торгів. Платіжна організація перевіряє Інформацію Біржі щодо формування розрахункових документів (виконує Звірку) та у випадку, якщо перевірка (Звірка) пройшла успішно, формує розрахункові документи та ініціює операції переказу коштів з рахунку/на рахунок Учасників Біржових торгів, відкритого(ий) в Платіжній організації. Після завершення переказу коштів Платіжна організація повідомляє про це Біржу шляхом подання звіту про виконання переказу коштів.

8.8.2. Розрахунок підсумкових зобов'язань щодо переказу коштів Учасників Біржових торгів Строковими контрактами (Деривативами) без поставки Базового активу визначається Біржею за наслідками Клірингової сесії на Строковому ринку (Ринку деривативів).

*8.9. Особливості виконання Строкових контрактів (Деривативів) з поставкою Базового активу, який складають цінні папери.*

8.9.1. Особливості виконання зобов'язань за Строковими контрактами (Деривативами) з поставкою Базового активу, який складають цінні папери, встановлюються Специфікацією такого Строкового контракту (Деривативу).

8.9.2. В Дату виконання Біржа за умови достатності Активів у Учасника Біржових торгів (наявності достатніх Ліміту в цінних паперах та/або Грошового ліміту) включає Строкові контракти (Деривативи) з поставкою Базового активу, який складають цінні папери, до Реєстру Договорів Біржі на Ринку заявок.

8.9.3. Виконання розрахунків за Строковими контрактами (Деривативами) з поставкою Базового активу, який складають цінні папери, в Дату виконання виконується у відповідності з Правилами Біржі, регламентами, документами Центрального депозитарію цінних паперів або НБУ.



8.9.4. У разі відсутності достатньої кількості Активів у Учасника Біржових торгів, крім Покупця Опціону, у відповідності з п. 8.9.2 цих Правил, такий Строковий контракт (Дериватив) з поставкою Базового активу є невиконаним, а такий Учасник Біржових торгів є стороною, що не виконала свої зобов'язання.

*8.10. Документування, система обробки інформації та внутрішній облік Клірингових операцій на Біржі.*

8.10.1. Під час проведення Біржею Біржових торгів на Строковому ринку (Ринку деривативів) та Клірингу за їх наслідками Біржа складає та/або використовує наступні документи:

- а) Реєстр Заявок на Строковому ринку (Ринку деривативів);
- б) відомість про відмову у прийнятті до виконання Заявок на Строковому ринку (Ринку деривативів);
- в) Реєстр Строкових контрактів (Деривативів);
- г) Реєстр обліку Позичій;
- д) Реєстр обліку зобов'язань щодо переказу коштів;
- е) Реєстр Грошових лімітів (складається та передається на Біржу Платіжною організацією);
- є) Реєстр Розрахункових грошових лімітів;
- ж) Інформація Біржі щодо формування розрахункових документів (складається та передається Біржею в Платіжну організацію);
- з) Звіт про виконання переказу коштів (складається та передається на Біржу Платіжною організацією);
- і) Звіт, що надається Учасникам торгів на Строковому ринку (Ринку деривативів).

8.10.2. Заявки надаються Біржі у вигляді Електронного документу за допомогою ЕТС Біржі.

Подані Учасниками Біржових торгів Заявки реєструються в ЕТС Біржі в момент отримання шляхом автоматичного формування Реєстру Заявок на Строковому ринку (Ринку деривативів), що містить, відповідно до виду Заявки, щонайменше такі дані: реєстраційний номер Заявки; дату і час реєстрації Заявки; вид Заявки; код Строкового контракту (Деривативу), щодо якого виставлено Заявку; кількість Строкових контрактів (Деривативів), щодо яких виставлено Заявку; ціну Строкового контракту (Деривативу) (для Ф'ючерсних контрактів (Ф'ючерсів)), за якою виставлено Заявку; Премію, Ціну виконання, різновид Опціону (для Опціонів); Вид Строкового контракту (Деривативу); Учасника Біржових торгів (його Клієнта).

8.10.3. Біржа надає Учаснику Біржових торгів підтвердження у прийнятті до виконання кожної Заявки від цього Учасника Біржових торгів шляхом її відображення на Торговому терміналі BIT eTrade Future.

У разі відмови в прийнятті до виконання Заявок Біржа обліковує такі Заявки у відомості про відмову в прийнятті до виконання Заявок на Строковому ринку (Ринку деривативів) з відміткою щодо причини відмови. Ця інформація також відображається у Торговому терміналі BIT eTrade Future Учасника Біржових торгів.

8.10.4. Після підбору зустрічних Заявок Біржа формує у формі Електронного документу Реєстр Строкових контрактів (Деривативів) з зазначенням присвоєних Біржею номерів Строкових контрактів (Деривативів), дати проведення Торговельної сесії та посиланням на пари Заявок, за якими укладено Строкові контракти (Деривативи).

8.10.5. Облік Строкових контрактів (Деривативів).

Інформація про подані Заявки та укладені Строкові контракти (Деривативи) зберігається в Реєстрі Заявок та Реєстрі Строкових контрактів (Деривативів) в розрізі кожного Учасника Біржових торгів, що подав до ЕТС Біржі Заявку, на підставі якої укладений Строковий контракт (Дериватив).

8.10.6. Клірингові реєстри

Для обліку зобов'язань, що виникають у Учасників Біржових торгів на Строковому ринку (Ринку деривативів) Біржа використовує наступні Клірингові реєстри:

- Реєстр обліку Позичій;
- Реєстр обліку зобов'язань щодо переказу коштів.

#### 8.10.7. Реєстр обліку Позичій та Позичійні рахунки

8.10.7.1. Для ведення аналітичного обліку зобов'язань кожного Учасника Біржових торгів (його Клієнта) на Строковому ринку (Ринку деривативів) Біржа при доступі Учасника Біржових торгів до участі в торгах відкриває Позичійні рахунки в складі Реєстру обліку Позичій.

8.10.7.2. Облік операцій Учасників Біржових торгів на Строковому ринку (Ринку деривативів) здійснюється Біржею шляхом обліку відкритих Позичій на Позичійних рахунках Учасників Біржових торгів (їх Клієнтів) за укладеними Строковими контрактами (Деривативами), що формується на підставі Реєстру Строкових контрактів (Деривативів) та розрахунку Варіаційної маржі при Коригуванні Позичій.

8.10.7.3. Біржа обліковує зобов'язання Учасників Біржових торгів (їх Клієнтів) на Позичійних рахунках за наступним ознаками:

- номер Позичійного рахунку Учасника біржових торгів (його Клієнта);
- Серія Строкового контракту (Деривативу);
- кількості Строкових контрактів (Деривативів) даної Серії;
- розміру Варіаційної маржі.

8.10.7.4. Порядок нумерації рахунків в Клірингових реєстрах встановлюється внутрішніми документами Біржі та відображається у клірингових звітах Біржі Учасникам Біржових торгів.

8.10.7.5. При закритті Позичійного рахунку припиняється ведення Біржею аналітичного обліку зобов'язань визначеного Учасника Біржових торгів (його Клієнта) на Строковому ринку (Ринку деривативів).

8.10.7.6. Кількість Строкових контрактів (Деривативів) враховується із знаком, який визначається в залежності від того, покупцем або продавцем за даними Строковими контрактами (Деривативами) є Учасник Біржових торгів на Строковому ринку (Ринку деривативів) (його Клієнт), для обліку зобов'язань якого Біржею відкрито Позичійний рахунок Реєстру обліку Позичій.

Строкові контракти (Деривативи) враховуються із знаком «мінус», якщо Учасник Біржових торгів на Строковому ринку (Ринку деривативів) є продавцем, із знаком «плюс» - якщо покупцем.

При цьому на центральному Позичійному рахунку враховуються Строкові контракти (Деривативи) з протилежним знаком.

8.10.7.7. Зобов'язання за укладеним Строковим контрактом (Деривативом) підлягають обліку на Позичійному рахунку за кожною Серією Строкових контрактів (Деривативів) окремо.

8.10.7.8. Біржа змінює облік зобов'язань за Строковими контрактами (Деривативами) на Позичійних рахунках, відкритих для обліку зобов'язань за Строковими контрактами (Деривативами) Учасника Біржових торгів (його Клієнта) та центральному Позичійному рахунку, при укладанні Офсетного договору Учасником Біржових торгів на Строковому ринку (Ринку деривативів) та внаслідок Коригування Позичій.

#### 8.10.8. Облік зобов'язань Учасників Біржових торгів

8.10.8.1. На аналітичних рахунках в Реєстрі обліку зобов'язань Біржею обліковується або заборгованість перед Учасником Біржових торгів на Строковому ринку (Ринку деривативів), що відображає зобов'язання щодо переказу коштів або поставки Базового активу Учасника Біржових торгів. Кредиторська заборгованість враховується із знаком «плюс», дебіторська - із знаком «мінус». При цьому на центральному Позичійному рахунку враховуються протилежні права та зобов'язання.

8.10.8.2. Біржа обліковує зобов'язання за ознакою платників (номерів аналітичних рахунків для обліку зобов'язань Учасників Біржових торгів (їх Клієнтів) та Серій Строкових контрактів (Деривативів) (розміру Варіаційної маржі за даною Серією).

8.10.8.3. На аналітичному рахунку в Реєстрі обліку зобов'язань Біржа обліковує сумарне сальдо за всіма значеннями Варіаційної маржі за кожною Серією Строкового контракту (Деривативу).

8.10.9. Документи, що надаються Учасникам Біржових торгів на Строковому ринку (Ринку деривативів) (Біржовий звіт).

8.10.9.1 За результатами Торговельної сесії на Строковому ринку ЕТС Біржі формує та відображає в Торговельних терміналах ВІТ еTrade Future Виписку з Реєстру Строкових контрактів (Деривативів).

8.10.9.2. Після завершення Торговельної сесії Учасники Біржових торгів за допомогою ЕТС Біржі та/або Системи ВІТ еTrade Mail отримують у формі Електронного документа Виписки з Реєстру Строкових контрактів (Деривативів), що містять усі Строкові контракти (Деривативи), укладені цим Учасником Біржових торгів протягом Торговельної сесії. Біржа надає на вимогу Учасника Біржових торгів також Виписку з Реєстру Заявок Біржі у вигляді Електронного документа.

8.10.9.3. Інформація про стан та обороти Позиційних рахунків Учасника Біржових торгів за наслідками Клірингової сесії, а також про наявність Маржинальної вимоги відображається в клірингових звітах Біржі, які надаються Учасникам Біржових торгів на Строковому ринку (Ринку деривативів) відповідно до цих Правил. Звіти надаються у формі Електронного документа.

8.10.9.4. Формат клірингових звітів, що надаються Учасникам Біржових торгів на Строковому ринку (Ринку деривативів), затверджується Біржею і публікується на Інтернет-сайті Біржі.

8.11.9.5. Виписки з Реєстру Строкових контрактів (Деривативів), виписки з Реєстру заявок Біржі, клірингові звіти надаються виключно Учаснику Біржових торгів, крім випадків передбачених законодавством. За необхідністю Біржа надає документи в розрізі Клієнтів Учасника Біржових торгів.

8.10.9.6. Документи у вигляді документу на папері можуть бути надані Учаснику Біржових торгів на Строковому ринку (Ринку деривативів) за його запитом протягом 3 (трьох) робочих днів після отримання запиту.

8.10.9.7. В разі виявлення помилок Біржа має право сформулювати і направити Учасникам Біржових торгів на Строковому ринку (Ринку деривативів) виправлені звіти. При цьому дійсним вважається останній звіт.

8.10.9.8. Біржа здійснює ведення внутрішнього обліку з використанням електронних носіїв інформації та забезпечує можливість відтворення інформації, що враховується, на паперових носіях.

8.10.9.9. Порядок здійснення обліку на Біржі операцій Клірингу визначається обліковою політикою Біржі. Порядок формування документів, форми документів визначаються документами Біржі.

## **РОЗДІЛ 9.**

### **УМОВИ ВЗАЄМОДІЇ БІРЖІ З РОЗРАХУНКОВИМ ЦЕНТРОМ, КОЛИ КЛІРИНГ ТА РОЗРАХУНКИ ЗА СТРОКОВИМИ КОНТРАКТАМИ (ДЕРИВАТИВАМИ) ВИКОНУЄ РОЗРАХУНКОВИЙ ЦЕНТР**

9.1. У разі, якщо Кліринг та розрахунки на Строковому ринку (Ринку деривативів) здійснюється Розрахунковим центром, порядок Клірингу та розрахунків, в тому числі система управління Ризиками та умови забезпечення виконання зобов'язань Учасників Біржових торгів, визначаються Правилами клірингу, Правилами та іншими документами Розрахункового центру, що регулюють кліринг та розрахунки за Строковими контрактами (Деривативами). Забезпечення інформаційної взаємодії між Розрахунковим центром та Біржею в ході Клірингу та розрахунків, викладене цим розділом Правил, впроваджується на умовах, що не суперечать зазначеним документам Розрахункового центру та договірним відносинам між Розрахунковим центром та Біржею.

9.2. Біржа кожної Торговельної сесії в режимі on-line інформує Розрахунковий центр про значення Розрахункової ціни за кожною Серією Ф'ючерсного контракту (Ф'ючерса), а Розрахунковий центр перераховує значення параметрів зобов'язань Учасників Біржових торгів та в режимі on-line повідомляє про це Біржу.

9.3. За кожним щойно укладеним Строковим контрактом (Деривативом) Розрахунковий центр проводить Novation, при цьому зобов'язання Учасників Біржових торгів-сторін за

кожним Строковим контрактом (Деривативом) переходять до Розрахункового центру як Центрального Контрагента.

9.4. В подальшому зобов'язання кожного Учасника Біржових торгів (його Клієнта - у разі наявності) обліковується Розрахунковим центром як зобов'язання перед Центральним контрагентом.

9.5. За кожним щойно укладеним Строковим контрактом (Деривативом) Розрахунковим центром відкривається Позиція, крім випадків, коли укладання Строкового контракту (Деривативу) призводить до закриття Позиції.

9.6. Розрахунковий центр проводить Коригування Позицій, розраховує Варіаційну маржу, формує розрахункові документи та ініціює переказ коштів з рахунку/на рахунок Учасників Біржових торгів, відкритих в Розрахунковому центрі.

9.7. За рішенням Розрахункового центру розмір Початкової маржі може бути змінений. При цьому Розрахунковий центр здійснює перерахунок зобов'язань Учасників Біржових торгів щодо забезпечення відкритих Позицій, та, в разі збільшення Початкової маржі, формує та ініціює Маржинальну вимогу щодо збільшення Початкової маржі Учасникам Біржових торгів.

9.8. Процедура збільшення розміру Початкової маржі супроводжується зупиненням Біржею Біржових торгів за відповідною Серією Строкового контракту (Деривативу).

9.9. Примусова ліквідація Позицій Учасника(ів) Біржових торгів проводиться Біржею у випадках, викладених в п. 8.6.4, а також у випадку припинення чинності договорів, укладених Учасником Біржових торгів з Розрахунковим центром відповідно до Правил клірингу Розрахункового центру та Правил Розрахункового центру.

9.10. У разі припинення чинності договорів, вказаних в п.9.9, та в разі невиконання Учасником Біржових торгів Маржинальної вимоги щодо збільшення Початкової маржі ініціатором примусової ліквідації Позицій є Розрахунковий центр.

9.11. Інформаційна взаємодія Розрахункового центру та Учасників Біржових торгів щодо наявності в Учасників Біржових торгів забезпечення та значення параметрів забезпечення для надання Заявок та укладання Строкових контрактів (Деривативів), а також надання Учасником Біржових торгів Маржинальної вимоги забезпечується Торговим терміналом BIT eTrade Future.

## **РОЗДІЛ 10. РОЗКРИТТЯ ІНФОРМАЦІЇ**

Розкриття інформації про діяльність Біржі на Строковому ринку (Ринку деривативів) здійснюється відповідно до Правил Біржі з урахуванням особливостей проведення операцій на Строковому ринку (Ринку деривативів), якщо інше не встановлено Специфікацією або законодавством України.

Зокрема на Інтернет-сайті Біржі оприлюднюється наступна інформація в розрізі Строкових контрактів (Деривативів):

- ціни відкриття, закриття, мінімальні, максимальні та розрахункові ціни, Премії;
- кількість та загальний обсяг укладених Строкових контрактів (Деривативів),
- кількість та загальна сума відкритих Позицій.