

«ЗАТВЕРДЖЕНО»

Біржовою Радою

ПАТ «ФБ «ПЕРСПЕКТИВА»

Протокол № 11/07/11-01

від 11.07.2011р.

«ЗАРЕЄСТРОВАНО»

Державною комісією з цінних паперів та фондового ринку

Рішення № 1131

від 18 . 08 .2011р.

Голова Біржової Ради



Е.І. Мілюшко

Голова Комісії



Д.М. Тевелєв

**ЗРАЗКОВА ФОРМА (СПЕЦИФІКАЦІЯ)  
Ф'ЮЧЕРСНОГО КОНТРАКТУ  
на поставку ОВДП**

**1. ТЕРМІНИ І ВИЗНАЧЕННЯ**

- 1.1. **Біржа** - Публічне акціонерне товариство «Фондова біржа «Перспектива».
- 1.2. **ДКЦПФР** - Державна комісія з цінних паперів та фондового ринку.
- 1.3. **Зразкова форма** - зразкова форма ф'ючерсного контракту на поставку облігацій (ОВДП).
- 1.4. **ОВДП** - облігації внутрішньої державної позики
- 1.5. **Сторони Ф'ючерсного контракту**: Учасник Біржових торгів (його клієнт - у разі наявності) (покупець/продавець), який подав до ЕТС Біржі Заявку, на підставі якої укладено Ф'ючерсний контракт, та Центральний контрагент, який приймає на себе грошові зобов'язання продавця/покупця за наслідками Новації.
- 1.6. **Платіжна організація** - ПУБЛІЧНЕ АКЦІОНЕРНЕ ТОВАРИСТВО «ФІНАНСОВА КОМПАНІЯ «СУЧАСНІ КРЕДИТНІ ТЕХНОЛОГІЇ», що включене до Державного реєстру фінансових установ, має ліцензію Державної комісії з регулювання ринку фінансових послуг на здійснення переказу коштів небанківськими фінансовими установами, отримала дозвіл Національного банку України на здійснення розрахунків за угодами щодо цінних паперів, є платіжною організацією внутрішньодержавної небанківської платіжної системи «РОЗРАХУНКОВА ФОНДОВА СИСТЕМА». Платіжна організація відкриває рахунки учасникам Платіжної системи, які одночасно є Учасниками Біржових торгів, здійснює грошовий кліринг та переказ коштів на виконання зобов'язань за Договорами.
- 1.7. **Платіжна система** - внутрішньодержавна небанківська платіжна система «РОЗРАХУНКОВА ФОНДОВА СИСТЕМА», що є платіжною системою у визначенні Закону України «Про платіжні системи та переказ коштів в Україні», учасники якої є одночасно Учасниками Біржових торгів. Платіжною організацією Платіжної системи є ПУБЛІЧНЕ АКЦІОНЕРНЕ ТОВАРИСТВО «ФІНАНСОВА КОМПАНІЯ «СУЧАСНІ КРЕДИТНІ ТЕХНОЛОГІЇ».
- 1.8. **Правила Біржі** - документ, зареєстрований Державною комісією з цінних паперів та фондового ринку (далі - ДКЦПФР) у відповідності до законодавства.
- 1.9. **Правила Біржі щодо торгівлі на Строковому ринку** - Правила ПАТ «Фондова біржа «Перспектива» щодо торгівлі на Строковому ринку, що є частиною Правил Біржі, викладеною у формі окремого документа.
- 1.10. **Ф'ючерсний контракт** - ф'ючерсний контракт на поставку базового активу (ОВДП), умови якого визначаються цією Зразковою формою.
- 1.11. **Центральний контрагент** - юридична особа, яка після проведення Біржею Новації приймає на себе зобов'язання кожної сторони за Договорами, зобов'язання щодо яких розраховуються шляхом централізованого клірингу. При цьому Центральний контрагент є стороною, яка забезпечує виконання зобов'язань щодо переказу коштів за укладеними Договорами. Функції Центрального контрагента виконує ПУБЛІЧНЕ АКЦІОНЕРНЕ ТОВАРИСТВО «ФІНАНСОВА КОМПАНІЯ «СУЧАСНІ КРЕДИТНІ ТЕХНОЛОГІЇ», що є Платіжною організацією Платіжної системи.

Інші терміни та поняття, які вживаються в Зразковій формі, використовуються згідно з чинним законодавством України та Правилами Біржі.

## 2. ЗАГАЛЬНІ ПОЛОЖЕННЯ

- 1.1. Ця Зразкова форма є типовими умовами договору відповідно до частини 1 статті 630 Цивільного кодексу України та підлягає оприлюдненню на Інтернет-сайті Біржі.
- 1.2. На умовах, визначених Зразковою формою, Ф'ючерсний контракт може бути укладений між Учасниками Біржових торгів, в порядку, встановленому Правилами Біржі щодо торгівлі на Строковому ринку. За кожним щойно укладеним Строковим контрактом Біржа проводить Новацію, при цьому грошові зобов'язання сторін за кожним Ф'ючерсним контрактом переходять до Центрального контрагента. В подальшому зобов'язання кожного Учасника Біржових торгів (його клієнта - у разі наявності) обліковується Біржею як зобов'язання перед Центральним контрагентом.
- 1.3. Адреси, реквізити відкритих у Платіжній організації рахунків Учасників Біржових торгів, що уклали Ф'ючерсний контракт, та їх клієнтів (у разі наявності, в т.ч. паспортні дані фізичних осіб), містяться в Реєстрі Членів Біржі та Учасників Біржових торгів.
- 1.4. Заявки, що подаються Учасниками Біржових торгів для укладення Ф'ючерсного контракту, подаються до ЕТС Біржі у вигляді електронних документів та зберігаються у Реєстрі Заявок Біржі.
- 1.5. Ф'ючерсні контракти укладаються за Правилами Біржі та підписуються електронним цифровим підписом Біржі, є складовою Реєстру Ф'ючерсних контрактів Біржі, зберігаються в архіві Біржі у вигляді електронного документа протягом 5 років і можуть бути надані у вигляді Електронного документа та/або відтворені на прохання Учасника Біржових торгів (або іншої особи та державного органу, у випадках, передбачених законодавством) та надані в формі документа на папері.
- 1.6. **Найменування Ф'ючерсного контракту:** Ф'ючерсний контракт на поставку ОВДП.
- 1.7. **Вид Ф'ючерсного контракту,** укладеного на умовах, визначених цією Зразковою формою: Ф'ючерсний контракт з поставки Базового активу (поставочний).
- 1.8. **Базовий актив Ф'ючерсного контракту:** Облігації внутрішньої державної позики (ОВДП).
- 1.9. **Обсяг Ф'ючерсного контракту (Лот):** ціна за 100 штук ОВДП.
- 1.10. **Форма задання ціни Ф'ючерсного контракту:** Ціна Ф'ючерсного контракту вказується в гривнях за 100 облігацій (ОВДП).
- 1.11. **Мінімальна зміна ціни контракту (Тік):** 0,01 гривні.
- 1.12. **Ціна укладання Ф'ючерсного контракту:** вказується в гривнях з точністю до 0,01 гривні.
- 1.13. **Ціна виконання Ф'ючерсного контракту:** визначається відповідно до п. 2.25 цієї Зразкової форми.
- 1.14. **Код (позначення) Ф'ючерсного контракту:** встановлюється рішенням Біржі про можливість укладення даного Ф'ючерсного контракту на Строковому ринку та формується за наступними правилами:  
<позначка Біржі - PSE> / <позначка терміну виконання контракту: 1,2,3,4,5,6 - згідно п. 2.15 цієї Зразкової форми) >/<позначка терміну обігу ОВДП: 1,2,3,4,5,6 - згідно п. 2.16 цієї Зразкової форми) >/ <позначка методики розрахунку розрахункової ціни - s (за середньозваженою ціною)> <термін виконання> / <рік виконання - останні дві цифри> / <місяць виконання>/<день виконання>.  
Наприклад: код (позначення) «PSE/1/1/12/02/01» означає Ф'ючерсний контракт на поставку випуску ОВДП зі строком погашення до 11 місяців, терміном обігу ОВДП до 11 місяців, з терміном виконання Ф'ючерсного контракту до першого лютого 2012 року.
- 1.15. **Термін виконання Ф'ючерсного контракту:** до торгів допускаються 6 видів стандартизованих Ф'ючерсних контрактів:
  1. На поставку ОВДП зі строком погашення до 11 місяців.
  2. На поставку ОВДП зі строком погашення від 1 року до 1 року 11 місяців.
  3. На поставку ОВДП зі строком погашення з 2 років до 2 років 11 місяців.
  4. На поставку ОВДП зі строком погашення з 3 років до 3 років 11 місяців.
  5. На поставку ОВДП зі строком погашення з 4 років до 4 років 11 місяців.
  6. На поставку ОВДП зі строком погашення більше 5 років.
- 1.16. **Строк погашення ОВДП:**
  1. до 11 місяців.
  2. від 1 року до 1 року 11 місяців.
  3. з 2 років до 2 років 11 місяців.
  4. з 3 років до 3 років 11 місяців.
  5. з 4 років до 4 років 11 місяців.
  6. більше 5 років.
- 1.17. **Дата виконання Ф'ючерсного контракту:** до торгів допускаються ф'ючерсні контракти з виконання у будь-який календарний день року. Якщо день виконання не вказаний, то цим днем вважається 15 число місяця виконання ф'ючерсного контракту. Дата виконання Ф'ючерсного контракту може бути змінена Рішенням Біржі у випадку різкої зміни цін на ринку Базового активу (цін на ОВДП відповідного строку погашення).
- 1.18. **Виконання Ф'ючерсного контракту** не може бути здійснення до дати, вказаної в контракті.

- 1.19. **Перший Торговельний день** - наступний Торговельний день після дати рішення Біржі про можливість укладення даного Ф'ючерсного контракту на Строковому ринку.
- 1.20. **Останній Торговельний день**: Торговельний день, що передує Даті виконання Ф'ючерсного контракту. Останній Торговельний день може бути змінено Рішенням Біржі у випадку, передбаченому у п. 2.17 цієї Зразкової форми.
- 1.21. **Розмір Початкової маржі** за Ф'ючерсним контрактом визначається та оприлюднюється відповідно до Правил Біржі щодо торгівлі на Строковому ринку.
- 1.22. **Валюта розрахунків за операціями з Ф'ючерсним контрактом**: українська гривня.
- 1.23. **Валюта оплати Варіаційної маржі**: українська гривня.
- 1.24. **Поставна маржа** - використовується для забезпечення виконання за поставками. Призначається та розраховується за рішенням Біржі. Починаючи з 3-го виду Ф'ючерсних контрактів, встановлених п. 2.15 цієї Зразкової форми, Поставна маржа встановлюється обов'язково.
- 1.25. **Розрахункова ціна**.  
Протягом Торговельної сесії безперервно (після кожного укладеного Ф'ючерсного контракту) розраховується Розрахункова ціна Ф'ючерсного контракту як середньозважена ціна усіх укладених Ф'ючерсних контрактів за відповідним кодом (позначенням) протягом Торговельної сесії, округлена до п'яти значущих цифр після коми.  
В день виконання Ф'ючерсного контракту Розрахункова ціна приводиться до Ціни виконання Ф'ючерсного контракту, що визначається відповідно до ціни ОВДП, яка розраховується за відповідними внутрішніми документами Біржі.
- 1.26. **Виконання контракту**  
Виконання контракту здійснюється шляхом списання з рахунку у цінних паперах Продавця на рахунок у цінних паперах Покупця кількості ОВДП, попередньо заблокованих для участі в Біржових торгах, та переказу коштів у розмірі Ціни укладення ф'ючерсного контракту з рахунку Покупця на рахунок Продавця в Платіжній організації.  
При цьому Варіаційна маржа, переказана/зарахована відповідно до п. 3.2 цієї Зразкової форми, зараховується в рахунок виконання зобов'язань за Ф'ючерсним контрактом.  
За наявності поставної маржі, вона виплачується разом з ціною ф'ючерсного контракту.

## **2. ЗАБЕЗПЕЧЕННЯ ЗОБОВ'ЯЗАННЯ ЗА Ф'ЮЧЕРСНИМ КОНТРАКТОМ**

- 2.1. Укладення Ф'ючерсного контракту здійснюється за умови наявності коштів, заблокованих на рахунках Покупця/Продавця в Платіжній організації, в розмірі не меншому, ніж Початкова маржа.
- 2.2. Протягом торгів Ф'ючерсним контрактом кожен Торговельний день здійснюється переказ/зарахування Варіаційної маржі.
- 2.3. Часткового виконання зобов'язань за Ф'ючерсним контрактом не допускається.

## **3. ВІДПОВІДАЛЬНІСТЬ СТОРІН ТА ПОРЯДОК РОЗГЛЯДУ СПОРІВ**

- 3.1. Сторони несуть відповідальність за невиконання або неналежне виконання зобов'язань за Ф'ючерсним контрактом відповідно до законодавства України та Правил Біржі.
- 3.2. Порядок розгляду спорів, що виникають під час укладання та виконання Ф'ючерсного контракту, визначений Правилами Біржі.

## **4. ВНЕСЕННЯ ЗМІН ТА ДОПОВНЕНЬ ДО ЗРАЗКОВОЇ ФОРМИ**

- 4.1. Біржа має право внести зміни та доповнення до Зразкової форми та зобов'язана зареєструвати такі зміни в ДКЦПФР.
- 4.2. Зміни та доповнення до цієї Зразкової форми набувають чинності після реєстрації в ДКЦПФР.
- 4.3. Інформація про вступ в дію Зразкової форми, що містить зміни та доповнення, оприлюднюється шляхом публікації на Інтернет-сайті Біржі не менш ніж за один Торговельний день до її вступу в дію.
- 4.4. З моменту вступу в дію Зразкової форми, що містить зміни та доповнення, умови існуючих зобов'язань за раніше укладеними Ф'ючерсними контрактами вважаються зміненими з врахуванням таких змін та доповнень.