

«ЗАТВЕРДЖЕНО»

Біржовою Радою

ПАТ «ФБ «ПЕРСПЕКТИВА»

Протокол № 12/11/05-01

від 05.11.2012р.

«ЗАРЕЄСТРОВАНО»

Національною комісією з цінних паперів та фондового ринку

Рішення № 1815

від 18.12.2012

Голова Біржової Ради



Е.І. Мілюшко



Д.М. Тевелєв

ЗРАЗКОВА ФОРМА (СПЕЦИФІКАЦІЯ) ОПЦІОНУ на Індекс Українських облігацій (Індекс UB)

1. ТЕРМІНИ І ВИЗНАЧЕННЯ

- 1.1. **Біржа** - Публічне акціонерне товариство «Фондова біржа «Перспектива».
- 1.2. **НКЦПФР** - Національна комісія з цінних паперів та фондового ринку.
- 1.3. **Індекс Українських облігацій (далі - Індекс UB)** - індекс, який розраховує Біржа відповідно до затвердженої Біржовою Радою Методики розрахунку Індексу Українських облігацій.
- 1.4. **Зразкова форма** - зразкова форма Опціону на Індекс UB.
- 1.5. **Опціон** - Строковий контракт на Індекс UB, умови якого визначаються цією Зразковою формою.
- 1.6. **Сторони Опціону**: Учасник Біржових торгів (його клієнт - у разі наявності) (покупць/продавець), який подав до ЕТС Біржі Заявку, на підставі якої укладено Опціон, та Центральний контрагент, який приймає на себе грошові зобов'язання продавця/покупця за наслідками *Novation*.
- 1.7. **Novation** - заміна однієї сторони Строкового контракту іншою особою у відповідності з Правилами Біржі щодо торгівлі на Строковому ринку.
- 1.8. **Платіжна організація** - ПУБЛІЧНЕ АКЦІОНЕРНЕ ТОВАРИСТВО «ФІНАНСОВА КОМПАНІЯ «СУЧАСНІ КРЕДИТНІ ТЕХНОЛОГІЇ», що включене до Державного реєстру фінансових установ, має ліцензію Національної (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.
- 1.9. **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».
- 1.10. **Правила Біржі** - документ, зареєстрований НКЦПФР у відповідності до законодавства.
- 1.11. **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.
- 1.12. **Центральний контрагент** - юридична особа, яка після проведення Біржею *Novation* 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

- 2.1. Ця Зразкова форма є типовими умовами договору відповідно до частини 1 статті 630 Цивільного кодексу України та підлягає оприлюдненню на Інтернет-сайті Біржі.
- 2.2. На умовах, визначених Зразковою формою, Опціон 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 *Novation*, при цьому грошові зобов'язання сторін за кожним Опціоном 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.
- 2.3. Адреси, реквізити відкритих у Платіжній організації рахунків Учасників Біржових торгів, що уклали Опціон, та їх клієнтів (у разі наявності), містяться в Реєстрі Членів Біржі та Учасників Біржових торгів.
- 2.4. Заявки, що подаються Учасниками Біржових торгів для укладення Опціону, подаються до ЕТС Біржі у вигляді електронних документів та зберігаються у Реєстрі Заявок Біржі.
- 2.5. Опціони укладаються за Правилами Біржі щодо торгівлі на Строковому ринку та підписуються електронним цифровим підписом Біржі, є складовою Реєстру Строкових 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.
- 2.6. **Найменування Опціону:** Опціон на Індекс Українських облігацій (Індекс UB).
- 2.7. **Різновид Опціону:** Опціон може бути на купівлю (**Опціон колл**) або продаж (**Опціон пут**) Базового активу.
- 2.8. **Вид Опціону** укладеного на умовах, визначених цією Зразковою формою: Опціон без поставки Базового активу (розрахунковий).
- 2.9. **Базовий актив Опціону:** Індекс Українських облігацій (далі - Індекс UB).
- 2.10. **Обсяг Опціону (Лот):** кількість пунктів Індексу UB, що становить значення Індексу UB.
- 2.11. **Вартість 1 пункту Індексу UB:** 1 (одна) гривня.
- 2.12. **Форма задання Ціни виконання Опціону:** Ціна виконання Опціону вказується в гривнях за 1 пункт Індексу UB.
- 2.13. **Перший Торговельний день** - наступний Торговельний день після дати рішення Біржі про можливість укладення даного Опціону на Строковому ринку.
- 2.14. **Термін дії Опціону** - період часу, протягом якого покупець Опціону має право вимагати виконання зобов'язань за Опціоном.
- 2.15. **Термін виконання Опціону:** кількість місяців від дати рішення Біржі про можливість укладення даного Опціону на Строковому ринку до Дати виконання.
- 2.16. **Дата виконання Опціону** (останній день виконання кінцевих розрахунків за Опціоном) - 15 (п'ятнадцяте) число місяця і року виконання Опціону, якщо ця дата припадає на Робочий день, або найближча наступна дата після 15 (п'ятнадцятого) числа місяця та року виконання Опціону дата, що припадає на Робочий день. Дата виконання Опціону може бути змінена Рішенням Біржі у випадку різкої зміни Індексу UB.
- 2.17. **Премія (Ціна) Опціону:** сума коштів, що сплачується покупцем Опціону продавцю в якості винагороди при укладанні Опціону.
- 2.18. **Мінімальна зміна Премії (Ціни) Опціону (Тік):** 0,01 гривні.
- 2.19. **Ціна виконання Опціону:** визначається при укладенні Опціону як ціна, за якою покупець Опціону має право купити або продати Базовий актив.
- 2.20. **Мінімальна зміна Ціни виконання Опціону:** встановлюється рішенням Біржі про можливість укладення даного Опціону на Строковому ринку.
- 2.21. **Код (позначення) Опціону:** встановлюється рішенням Біржі про можливість укладення даного Опціону на Строковому ринку та формується за наступними правилами:
<позначка Біржі - PSE>/<індекс - UB > - <позначка різновиду Опціону - C (Опціон колл) або P (Опціон пут)> <термін виконання> / <рік виконання - останні дві цифри> / <місяць виконання> / <Ціна виконання>
Наприклад: код (позначення) «PSE/UB-C6/13/02/2000» означає Опціон колл на ставку Індекс Українських облігацій (Індекс UB) на найближчі 6 місяців з виконанням у лютому 2013 р.; Ціна виконання дорівнює 2000 пунктів.
- 2.22. **Розмір Початкової маржі** за Опціоном визначається та оприлюднюється відповідно до Правил Біржі щодо торгівлі на Строковому ринку.
- 2.23. **Валюта розрахунків за операціями з Опціоном:** українська гривня.
- 2.24. **Валюта оплати Варіаційної маржі:** українська гривня.
- 2.25. **Порядок виконання (припинення) зобов'язань за Опціоном:** визначається Правилами Біржі щодо торгівлі на Строковому ринку.

3. ЗАБЕЗПЕЧЕННЯ ВИКОНАННЯ ЗОБОВ'ЯЗАННЯ ЗА ОПЦІОНОМ

- 3.1. Опціон укладається виключно за умови, що розмір Розрахункового грошового ліміту Учасника Біржових торгів-покупця повністю покриває розмір Премії за Опціоном, а Розрахунковий грошовий ліміт Учасника Біржових торгів-продавця повністю покриває встановлену Біржею Початкову маржу.
- 3.2. **Розрахункова ціна.**

Протягом Торговельної сесії безперервно (після кожного укладеного Ф'ючерсного контракту з відповідним кодом) розраховується Розрахункова ціна Ф'ючерсного контракту на Індекс UB як середньозважена ціна усіх укладених протягом Торговельної сесії Ф'ючерських контрактів на Індекс UB за відповідним Кодом (позначенням), округлена до п'яти значущих цифр після коми. Значення Розрахункової ціни Ф'ючерсного контракту на Індекс UB з кодом, що відповідає терміну виконання Опціону, використовується при розрахунку Варіаційної маржі за Опціоном. В день виконання Опціону Розрахункова ціна приводиться до Ціни виконання Опціону, що визначається відповідно до значення Індексу UB в Останній Торговельний день.
- 3.3. У відповідності з Правилами Біржі щодо торгівлі на Строковому ринку кожен Торговельний день протягом терміну дії Опціону розраховується Варіаційна маржа та відбувається коригування Позицій.

4. ВІДПОВІДАЛЬНІСТЬ СТОРІН ТА ПОРЯДОК РОЗГЛЯДУ СПОРІВ

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

5. ВНЕСЕННЯ ЗМІН ТА ДОПОВНЕНЬ ДО ЗРАЗКОВОЇ ФОРМИ

- 5.1. Біржа має право внести зміни та доповнення до Зразкової форми та зобов'язана зареєструвати такі зміни в НКЦПФР.
- 5.2. Зміни та доповнення до цієї Зразкової форми набирають чинності після реєстрації в НКЦПФР.
- 5.3. 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.
- 5.4. З моменту вступу в дію Зразкової форми, що містить зміни та доповнення, умови існуючих зобов'язань за раніше укладеними Опціонами вважаються зміненими з врахуванням таких змін та доповнень.