

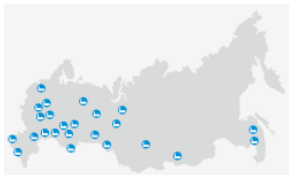


Российские бенчмарки и деривативы на товары

Н.А.Захаров

АО «СПбМТСБ»

Разнообразие ценовых индикаторов рынка нефтепродуктов СпбМТСБ



Сводные цены на НПЗ

Средняя цена нефтепродуктов на отдельном заводе. Рассчитываются для крупнейших НПЗ и служат основой для расчета региональных и национальных индексов.



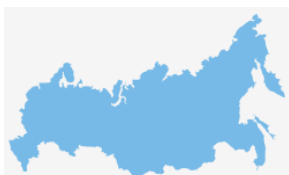
Региональные индексы

Средние цены нефтепродуктов в 9 центрах потребления (Москва, Санкт-Петербург, Ростов, Самара, Екатеринбург, Новосибирск, Красноярск, Иркутск, Хабаровск).



Территориальные индексы

Средние цены нефтепродуктов заводов расположенных на территории Европейской части России, Урала-Сибири и Сибири-Дальнего востока.



Национальные индексы

Средняя цена нефтепродуктов на всех крупнейших нефтеперерабатывающих заводах, расположенных на территории России.



Композитный индекс

Единый универсальный индикатор, отражающий динамику изменения стоимости усредненной тонны светлых нефтепродуктов на внутреннем рынке РФ.

Инструментарий срочного рынка СПбМТСБ

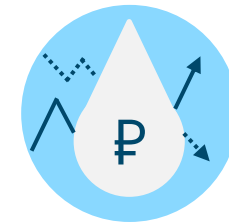
1. Поставочные фьючерсы на нефть

Базисный актив: Российская экспортная нефть сорта Юралс-Приморск



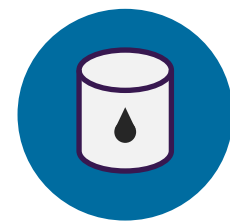
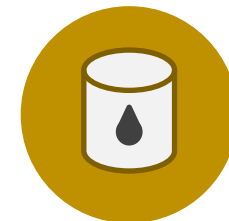
2. Расчетные фьючерсы на индексы нефтепродуктов

Базисный актив: Региональные биржевые индексы цен нефтепродуктов



3. Поставочные фьючерсы на нефтепродукты

Базисный актив: бензин, дизельное топливо, СУГ



Фьючерс на российскую нефть марки Urals

ПАРАМЕТРЫ ФЬЮЧЕРСНОГО КОНТРАКТА



ИСПОЛНЕНИЕ КОНТРАКТА:

Поставка нефти



ОБЪЕМ КОНТРАКТА:

1000 баррелей



БАЗИСНЫЙ АКТИВ:

Нефть марки Urals



ПОСТАВОЧНАЯ ПАРТИЯ:

720 000 баррелей (100 тыс. тонн)



УСЛОВИЯ ПОСТАВКИ:

FOB порт Приморск



ВАЛЮТА:

Доллар США



Шаги к бенчмарку:

Создание методики расчета индекса стоимости российской нефти сорта Urals в порту Приморск.

Ожидаемый результат:

- возможность расчетного исполнения
- включение в торги банков и финансовых компаний
- уменьшение размера контракта
- привлечение массового клиента (сотрудничество с Московской Биржей)
- использование индекса в формульных контрактах на рынке нефти

Успешный старт торгов фьючерсом на бензин

Контракт предусматривает поставка в любую точку России в течение месяца поставки

| | |
|--------------------------------|-----------------------|
| Базовая точка ценообразования: | ж/д станция Аллагуват |
| Базовый актив: | бензин АИ-92-К5 |
| Объем контракта (лот): | 60 тонн |
| Котировка: | В рублях за 1 тонну |
| Мин. изм. цены: | 1 рубль РФ |
| Поставочная партия: | 60 тонн |

Фьючерсный контракт на бензин Регуляр АИ-92 с точкой ценообразования на ж/д станции Аллагуват – **торги стартовали на срочном рынке биржи СПБМТСБ 16.07.2018**

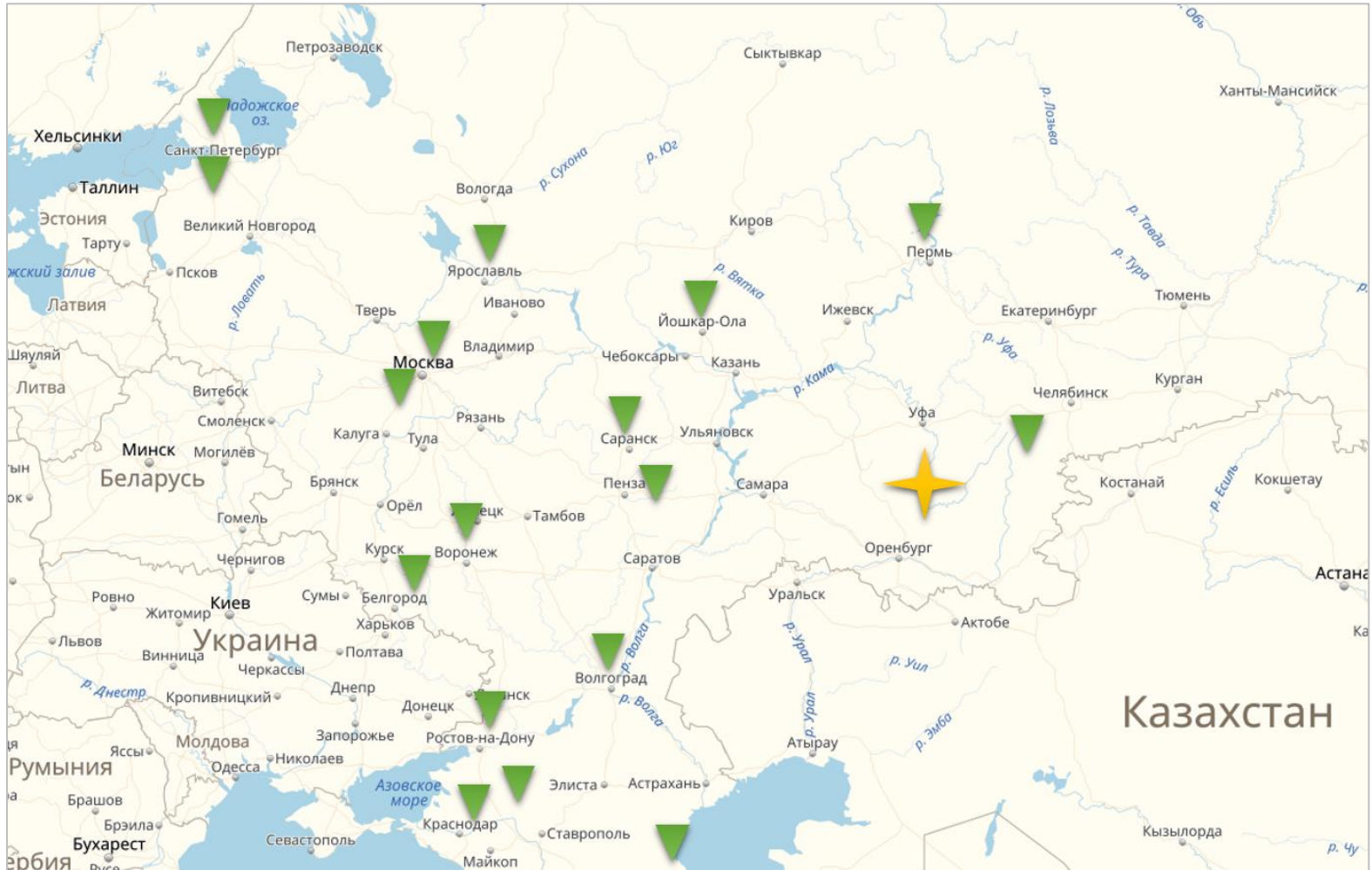
с Июля 2018:

- Объем поставки: более 20 тыс. тонн
- Объем торгов: более 70 тыс. тонн



15 октября 2018 на СПБМТСБ совместно с группой «Газпром межрегионгаз» запущены торги поставочными фьючерсами на СУГ марки ПБТ с базовой точкой ценообразования на ж/д ст. Сургут

География поставок бензина Аи-92



Хеджирование цен на авиатопливо

Перспективный инструмент хеджирования цены авиатоплива – фьючерс на индекс цен авиакеросина в Московском авиационном узле.



Московский авиационный узел



Контакты

АО «Санкт-Петербургская Международная Товарно-сырьевая биржа»

Адрес: г. Москва, ул. Тимура Фрунзе, д.24

Телефон: +7 (495) 380-04-24

Сайт: www.spimex.com

Email: clients@spimex.com



vk.com/spimex



twitter.com/spimex



facebook.com/spimex



[linkedin.com/company/
saint-petersburg-
international-mercantile-
exchange](https://linkedin.com/company/saint-petersburg-international-mercantile-exchange)

