

Справка подготовлена к заседанию рабочей группы ФАС России (13 июня 2018 года) по вопросу запуска биржевой торговли фьючерсными контрактами на уголь.

Территориальный внебиржевой индекс цен угля

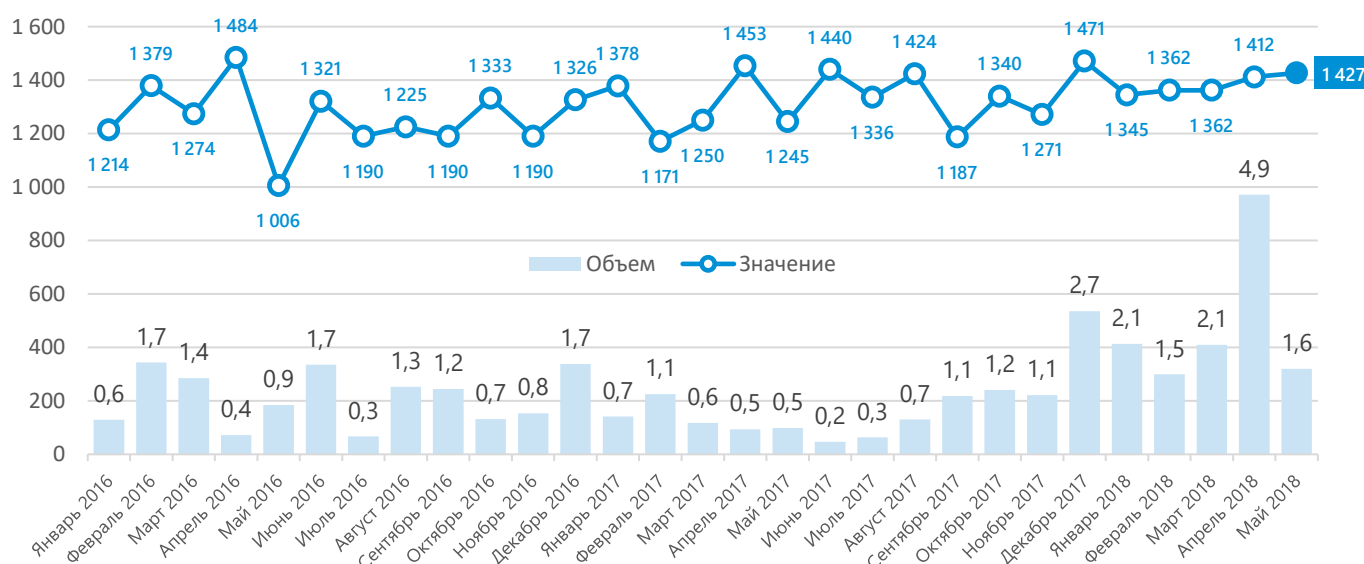
Расчет ведется с июля 2017 года. Справочно рассчитаны значения с января 2016 года. Наиболее ликвидным показателем является индекс энергетического высоколетучего угля в Кузбассе. Код индекса:

ОТИ – Территориальный внебиржевой индекс

KUZ – Кузбасс

EVL – Энергетический высоколетучий уголь

Значение индекса ОТИ_KUZ_EVL (руб./т.) и объем используемых договоров (млн т.)



Методика расчета

Индекс рассчитывается как средневзвешенная цена договоров, зарегистрированных в АО «СПБМТСБ». При расчете не применяются коэффициенты, рассчитанные на основе исторических данных и экспертной оценки, и транспортные тарифы. Используются только цены и объемы реальных договоров.

Порядок выбора договоров для расчета индекса:

1. Привязка договора к месяцу расчета осуществляется по **дате определения цены товара**.
2. Привязка договора к угледобывающему бассейну осуществляется по **месту производства**. При этом выбираются только те договоры, отгрузка по которым осуществляется с места производства и ближайших ж/д станций.
3. Классификация товара осуществляется по **марке угля**. Для расчета индекса каменного энергетического высоколетучего угля выбираются угли марок Д, ДГ, Г и смеси указанных марок.
4. Поставка на внутренний рынок. **Страна назначения** – «Россия».
5. **Способ транспортировки** – «ж/д транспорт».
6. Товарная позиция договора не удалена и не расторгнута.

Фильтры договоров:

- По наличию *стоимости транспортировки* (необходима для приведения цены к месту отгрузки).
- По объему. *Количество товара* не превышает 100 000 тонн.
- По цене. *Цена товара, приведенная к месту отгрузки*, не более чем на 90% отличается от средней по региону.

Дополнительное условие, которое должно быть соблюдено при расчете в соответствии с требованиями Положения, – использование при расчете договоров не менее 2 (двух) различных продавцов и 3 (трех) различных покупателей.

Планируемые изменения в методику расчета

В соответствии с решением Биржевого комитета ФАС России в методику будут внесены следующие изменения:

1. Увеличение значения фильтра по объему со 100 000 тонн до 500 000 тонн.
2. Расчет дополнительного показателя для энергетических углей – индекса в рублях за тонну условного топлива (т.у.т.).

Подготовлен проект методики расчета, который будет презентован 25 июня 2018 года на следующем заседании Биржевого комитета.

Проверка сведений о внебиржевых договорах – основы для расчета индекса

Действуют одновременно несколько процедур, направленных на обеспечения корректного предоставления компаниями информации о внебиржевых договорах:

1. Подготовка ежеквартальных отчетов по регистрации внебиржевых договоров. В отчетах проверяются типовые ошибки в регистрации, которые непосредственно влияют на расчет индекса. Проверяется *дата определения цены товара*, корректность указания *места производства* и *места отгрузки*, также проверяется наличие и корректность указания *стоимости транспортировки*. Т.е. отчетом охватываются все поля, необходимые для расчета индекса, в которых допускаются ошибки при регистрации. Отчеты доступны всем компаниям на бесплатной основе.
2. Обучения по регистрации и ежедневные консультации. Большинство компаний уже прошли обучения, что значительно повысило общее качество направляемой на биржу информации. Корректность регистрации нетиповых договоров или новых форм договоров, которые ранее компанией не заключались, обеспечивается путем возможности консультации со специалистами биржи. Компании ежедневно обращаются за консультациями.
3. Биржевые автоматические процедуры проверки аномальных значений цен и дат их определения. Проверка цен работает в реальном времени. При обнаружении явно завышенных цен или ошибочных дат их определения сотрудникам биржи приходит уведомление. После проверки информации о возможной ошибке сотрудник Биржи уведомляет компанию о необходимости проверки сведений.
4. Дополнительные проверки корректности информации. В случае обнаружения возможных ошибок при выполнении процедур, не связанных с проверкой корректности информации в реестре, в том числе при подготовке аналитической информации по запросам регуляторов, биржа также связывается с компаниями с целью уведомления о возможной ошибке.