ЗАТВЕРДЖЕНО
Рішенням Котирувальної комісії
ТОВ «Українська енергетична біржа»
Протокол засідання Котирувальної комісії
від 21 жовтня 2021 року
Голова Котирувальної комісії
_____ Рибачевич Р.Р.

Методика

розрахунку котирувальних цін та інших показників торгівлі на товарній біржі - Товариство з обмеженою відповідальністю «Українська енергетична біржа»

(нова редакція)

Київ – 2021

Розділ І. Терміни та їх визначення

Біржа – Товариство з обмеженою відповідальністю «Українська енергетична біржа»;

Котирувальна комісія – постійно діючий спеціальний підрозділ, створений в структурі Біржі, який виконує керуючі та контролюючі функції при проведенні котирування цін на товари/біржові товари, що є предметом торгів/біржових торгів на Біржі.

котирувальна ціна – ціна товару/біржового товару, визначена на підставі критеріїв та методів обчислення, встановлених цією Методикою;

котирування (біржове котирування) – сукупність методів та правил (методика), які дають змогу виявити середні об'єктивні ціни на певний товар (групу товарів) / біржовий товар (групу біржових товарів) на основі цін угод / біржових угод або на інших засадах;

ОТС-ринок – неорганізований ринок, на якому, за допомогою торгових систем / інформаційних платформ, що використовує Біржа у своїй діяльності, здійснюється позабіржовий оборот товару;

Торги – торги, що проводяться на Біржі за допомогою торгових систем / інформаційних платформ, що використовує Біржа у своїй діяльності;

Інші терміни, що вживаються в цій Методиці, використовуються відповідно до внутрішніх документів Біржі та законодавства України.

Розділ ІІ. Загальні положення

2.1. Ця «Методика розрахунку котирувальних цін та інших показників торгівлі на товарній біржі - Товариство з обмеженою відповідальністю «Українська енергетична біржа» (по тексту – Методика) розроблена відповідно до Закону України «Про товарні біржі», Статуту Товариства з обмеженою відповідальністю «Українська енергетична біржа», «Правил Товариства з обмеженою відповідальністю «Українська енергетична біржа» (далі – Правила) та є документом, який регламентує порядок встановлення механізму визначення та/або фіксації ринкової ціни товару, що є предметом Торгів на Біржі, та виявлення середніх / середньозважених цін на певний товар (групу товарів) / біржовий товар (групу біржових товарів) на основі цін укладених угод (біржових угод) або на інших засадах.

Біржа може розраховувати котирувальні ціни, біржові курси, індекси та інші показники біржової торгівлі, – далі всі разом поіменовані цінові показники, використовуючи загальнодоступну інформацію та інформацію, одержану в ході або за результатами біржових торгів, інформацію з біржових договорів та біржових операцій.

Перелік цінових показників, розрахунок та оприлюднення яких здійснює Біржа, а також порядки (методики) їх розрахунку та оприлюднення, визначаються цією Методикою.

Розрахунок цінових показників, що оприлюднюються Біржею, супроводжується повною, достовірною, прозорою (такою, що може бути перевірена) та актуальною інформацію про джерела даних, використаних для їх розрахунку.

Ця Методика, будь-які зміни та доповнення до неї розміщуються на офіційному вебсайті Біржі в мережі Інтернет. За необхідності Біржа може використовувати інші способи оприлюднення інформації.

2.2. Методика та зміни / доповнення до неї затверджуються відповідним рішенням Котирувальної комісії Біржі.

2.2.1. Рішення Котирувальної комісії Біржі щодо затвердження Методики (внесення змін / доповнень до Методики) вступають в дію з моменту її (їх) затвердження Котирувальною комісією Біржі, якщо інше не встановлено таким рішенням.

2.2.2. З метою доведення до учасників торгів та інших зацікавлених осіб положень Методики та/або інформації щодо внесення зміни / доповнення до неї, Котирувальна комісія Біржі здійснює необхідні організаційні дії (заходи), спрямовані на розміщення такого документу та/або інформації у відповідному розділі на сайті Біржі. Котирувальна комісія Біржі забезпечує наявність на вебсайті актуальної редакції цієї Методики та додатків до неї із всіма змінами та доповненнями.

2.3. Котирувальні ціни відображають результат аналізу та оцінки кон'юнктури ринку окремого товару (біржового товару) на певний час (день, період) і носять довідковий характер.

2.4. Котирувальні ціни, що визначені згідно з положеннями цієї Методики, підлягають оприлюдненню на безоплатній основі, якщо інше не визначено Біржовим комітетом Біржі.

За результатами котирування та з метою доведення до відома зацікавлених осіб інформації щодо результатів такого котирування, Котирувальна комісія Біржі здійснює необхідні організаційні дії (заходи), спрямовані на опублікування у відповідному розділі на сайті Біржі:(а) біржового бюлетеня (бюлетеня середньозважених цін) – щодо котирування зарезультатами Торгів на біржовому ринку, що містить інформацію про котирувальні ціни;

(б) інформаційної довідки – щодо котирування за результатами Торгів на ОТС-ринку;

(в) інших цінових показників, що розраховуються Біржею.

Розділ ІІІ. Критерії та методи обчислення котирувальної ціни

3.1. Котирування на підставі укладених угод здійснюється на наступних засадах:

3.1.1. середньозважені показники цін визначаються на підставі угод (біржових угод), укладених на Біржі за допомогою торгових систем / інформаційних платформ, щовикористовує Біржа у своїй діяльності;

3.1.2. визначення котирувальних цін здійснюється окремо за кожний торговий день або період, встановлений Біржею, в межах якого укладено угоди (біржові угоди);

3.1.3. в розрізі видів товару (груп товарів) / біржового товару (груп біржових товарів), перелік яких затверджений у Додатку 1 до цієї Методики, окремо для кожного з базисних умов поставки та умов оплати товару (якщо окремим Рішенням Котирувальної комісії визначено окреме котирування для визначених видів товару (груп товарів) / біржового товару (груп біржових товарів) відповідно до умов оплати).

3.1.4. кількісні показники ціни та об'єму товару (групи товарів) / біржового товару (групи біржових товарів) знаходяться в межах граничних показників, що застосовуються при розрахунку котирувальної ціни, згідно Додатку 1 до цієї Методики.

3.2. Котирування цін здійснюється окремо для біржового ринку та для ОТС-ринку та з врахуванням умов поставки і розрахунків та інших чинників, визначених внутрішніми документами Біржі, якими регламентується торгівля у відповідній секції та/або за певним товаром (групою товарів) / біржовим товаром (групою біржових товарів).

3.3. Розрахунок котирувальної ціни може здійснюватися Біржою протягом торгового дня (поточна котирувальна ціна), по закінченню Торгів відповідним товаром в торговий день, за певний період.

3.4. Котирувальна ціна, з урахуванням вимог, передбачених п. 3.1. Методики, розраховується, якщо кількість угод/біржових угод не дорівнює «0» (нулю).

3.4.1. Якщо умова, передбачена пунктом 3.4. Методики, не виконана, то встановлення котирувальних цін для такого виду товару (групи товарів) / біржового товару (групи біржових товарів) може здійснюватися Котирувальною комісією шляхом прийняття відповідного рішення та розміщення відповідної примітки на сайті Біржі при публікації котирувальної ціни.

3.5. Котирувальні ціни розраховуються за такою формулою:

$$\text{Coter P} = \frac{\sum[\mathbf{P} \times \mathbf{V}]}{\sum[\mathbf{V}]}$$

опис:

$\mathbf{P}$ – ціна угоди; $\mathbf{V}$ – об'єм угоди;

$\sum[\ldots]$ – позначення суми значень, що розраховуються по взятій в дужки формулі, за всіма угодами.

Розділ IV. Види біржових індексів цін на електричну енергію, що розраховуються Біржею

4.1. Біржею розраховуються такі види біржових індексів цін на електричну енергію:

4.1.1. Місячний індекс базового навантаження – розрахований накопичувальним підсумком показник середньозваженої ціни в торговій зоні «ОЕС України», що визначається шляхом ділення загальної вартості реалізованої електричної енергії базового навантаження (без ПДВ) на загальний обсяг реалізованої електричної енергії базового навантаження, за періодом постачання, що охоплює повний календарний місяць, який є наступним відповідно до розрахункового (М+1).

4.1.2. Розрахунок Місячного індексу базового навантаження здійснюється на підставі обсягів та цін укладених на Біржі аукціонних свідоцтв за результатами проведення електронних аукціонів з продажу електричної енергії та електронних аукціонів з купівлі-продажу електричної енергії за двосторонніми договорами в комерційних секціях.

До розрахунку Місячного індексу базового навантаження не включаються:

- результати аукціонів у формі спеціальної сесії, окрім спеціальної сесії з продажу електричної енергії, виробленої з альтернативних джерел енергії та спеціальної сесії з продажу пакетів лотів за двосторонніми договорами;

- результати аукціонів в межах кожної окремої позиції на продаж та/або купівлю, ініціатором якої є виробник приватної форм власності, трейдер або електропостачальник, за умови, що середньозважена ціна такої позиції на продаж та/або купівлю більш, ніж на 10% перевищує значення середньозваженої ціни державних виробників (ВП «Енергоатом-Трейдинг» ДП «НАЕК «Енергоатом», ПАТ «Центренерго», ПрАТ «Укргідроенерго») та ДП «Гарантований покупець» (в частині спеціальних сесій з продажу електричної енергії, виробленої з альтернативних джерел енергії) в Місячному індексі базового навантаження;

- у випадку відсутності значення середньозваженої ціни державних виробників відповідно до абзацу 4 цього пункту - результати аукціонів в межах кожної окремої позиції на продаж та/або купівлю, ініціатором якої є виробник приватної форми власності, трейдер або електропостачальник, за умови, що середньозважена ціна такої позиції на продаж та/або купівлю більш ніж на 15% перевищує Індекс ціни електричної енергії на ринку «на добу наперед» базового навантаження в «ОЕС України»;

- результати аукціонів щодо експорту електричної енергії.

4.1.3. За результатами торгового дня календарного місяця, що передує розрахунковому (М+1), Біржа забезпечує публікацію поточного значення Місячного індексу базового навантаження. Остаточне значення Місячного індексу базового навантаження формується за результатами останнього торгового дня календарного місяця, що передує розрахунковому.

Розділ V. Середньозважені ціни місячного ресурсу природного газу, що розраховуються Біржею

5.1 На основі котирувальних цін для місячних ресурсів природного газу за напрямком «Природний газ» на умовах поставки в ВТТ ГТС України розраховуються середньозважені ціни природного газу.

Під місячним ресурсом слід розуміти обсяги природного газу, щодо яких на Біржі укладаються угоди з купівлі-продажу природного газу з поставкою у певному календарному місяці. Розрахунок середньозважених цін здійснюється окремо щодо кожного календарного місяця.

5.2 *Середньозважена ціна* природного газу місячного ресурсу розраховується накопичувальним підсумком ***шляхом ділення загальної вартості*** (з урахуванням ПДВ) укладених на Біржі угод щодо купівлі-продажу відповідного місячного ресурсу на умовах поставки в ВТТ ГТС України ***на суму обсягів*** купівлі-продажу такого місячного ресурсу за відповідними укладеними угодами ***протягом усього періоду його продажу, який визначається відповідно до пункту 5.3. Методики***.

5.3 Розрахунок та публікація середньозваженої ціни місячного ресурсу природного газу відбувається з першого дня продажу ресурсу відповідного місяця до останнього календарного дня відповідного місяця поставки.

5.4 До розрахунку середньозваженої ціни місячного ресурсу природного газу не включаються результати торгів у секції «Природний газ – диференціали».

5.5 Розрахунок та публікація (шляхом розміщення на вебсайті Біржі) середньозваженої ціни місячного ресурсу природного газу відбувається по всіх умовах оплати, за передплатою та за післяплатою кожного торгового дня.

5.6 У випадку відсутності котирувальних цін місячного ресурсу природного газу на певний торговий день, застосовується середньозважена ціна, що склалася на такий місячний ресурс у попередній торговий день.

5.7 Остаточне значення середньозваженої ціни місячного ресурсу природного газу формується на останній торговий день відповідного місяця поставки.

Розділ VI. Біржові курси, що розраховуються Біржею

6.1 Розрахунок біржових курсів та їх оприлюднення здійснюється Біржею згідно з Правилами.