

PROLEUM SWAP

Что такое **Proleum SWAP**?

Proleum SWAP – это продукт Компании, внебиржевой расчетный срочный контракт на нефтепродукты (товарный СВОП), стороной которого для клиентов является ООО «Пролеум Брокер».

-  **Proleum SWAP** не предполагает реальную поставку продукта, все расчеты производятся деньгами
-  **Объектом контракта** (базисным активом) являются нефтепродукты, торгующиеся на СПБМТСБ

Преимущества:

Товарный СВОП дает возможность зафиксировать цену топлива на интересующем вас базисе отгрузки на будущий период, «застраховав» свой бизнес от неблагоприятного изменения цены.



Как работает Proleum SWAP

✓ Унифицированные правила

Все операции осуществляются в рамках Стандартных условий срочных товарных сделок - **RISDA**, разработанных Национальной ассоциацией участников фондового рынка.

✓ Платежный неттинг

В установленные контрактом периоды мы производим с вашей компанией денежные расчёты, сравнивая текущую рыночную цену с зафиксированной ценой. Период может быть один или несколько.

При этом используется правило **платежного неттинга**: стороны уплачивают друг другу только разницу между этими ценами.



✓ Рыночная цена

Рыночная цена - цена, сложившиеся по итогам торгов секции «Нефтепродукты» СПБМТСБ.

✓ Метод усреднения

Для объективного определения расчетной рыночной цены мы используем метод усреднения. Мы определяем среднюю рыночную цену продукта в течение 10 дней, предшествующих дате окончания каждого периода (контрактом может быть установлен иной срок для усреднения).

Пример работы Proleum SWAP



20 МАЯ - Заключение СВОП-контракта

Допустим, сегодня 20 мая, **вы - покупатель нефтепродуктов** и заинтересованы в фиксации цен на топливо (например АИ-92) на ближайшие 6 месяцев

Вы **заключаете с нашей компанией СВОП-контракт** на покупку АИ-92 по цене 60 000 руб/тн с расчетными датами 30 число каждого месяца в течении полугода.



20 мая

20 июня - 30 июня



30 ИЮНЯ

Для определения расчетной цены мы определим среднюю биржевую цену на установленном контрактом базисе с 20 по 30 июня (10 дней, предшествующих расчетной дате)

Сценарий 1

При наступлении расчетной даты рыночная цена выросла, и усредненная цена составила 65 000 руб/тн.

Мы выплачиваем вам разницу в 5 тыс. руб за 1 тн.

Сценарий 2

При наступлении расчетной даты цена опустилась до 57 000 руб/тн вы уплачиваете нашей Компании разницу в 3 тыс. руб за 1 тн.

Но при этом вы сможете приобрести АИ-92 на рынке по более низкой цене.



Аналогично действует механизм контракта в каждый последующий период

Остались вопросы? Звоните, пишите, обсудим.

📍 г. Омск, ул. Герцена 48, кор. 5 этаж 3, пом 18, оф. 306

☎ +7 (499) 110-62-68

+7 (499) 110-62-72

& ПРОЛЕУМ БРОКЕР

✉ proleumbroker@ptomsk.ru

