



Zmiany w modelu rozliczeń związane z wdrożeniem XBID

Autor prezentacji:

Krzysztof Opara

Dyrektor

Dział Rozliczeń i Rozrachunku

Kontakt:

Tel. 22 341 98 80

E-mail: krzysztof.opara@irgit.pl

Warszawa, 16 września 2019 r.

www.irgit.pl

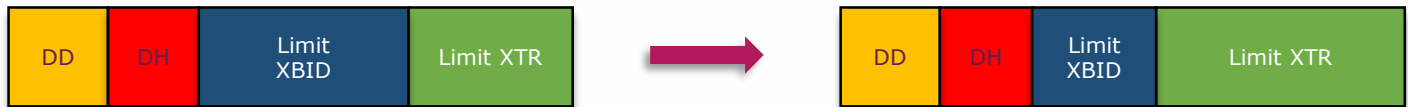
Waluta rozliczeń i limit transakcyjny

- Walutą rozliczeń transakcji zawieranych na rynku XBID będzie **złoty**;
- Zlecenia kupna podlegać będą **prewalidacji**;
- Limit transakcyjny wyznaczany będzie na podstawie obecnie wpłaconych zabezpieczeń:
 - dedykowanie wysokości limitu przez Członka Izby
 - wydzielenie części środków z obecnie obowiązującego limitu transakcyjnego
 - przeliczenie limitu transakcyjnego ze złotych po **kursie średnim euro**, ogłoszonym przez Narodowy Bank Polski

Zmiana wysokości limitu transakcyjnego

1. Zmiana proporcji wpłaconych zabezpieczeń:*

a) zmniejszenie limitu transakcyjnego na XBID, zwiększenie limitu transakcyjnego na XTR



b) zwiększenie limitu transakcyjnego na XBID, zmniejszenie limitu transakcyjnego na XTR



*schemat graficzny nie obejmuje działalności Członka Izby w alternatywnym modelu rozrachunku

Zmiana wysokości limitu transakcyjnego

1. Zmiana proporcji wpłaconych zabezpieczeń:

- Zmiana proporcji wpłaconych zabezpieczeń dokonywana będzie w dni robocze po otrzymaniu przez IRGiT dyspozycji zmiany proporcji, pod warunkiem że została ona przekazana do Izby do godziny 11:00.
- Na podstawie otrzymanej dyspozycji:
 - wyznaczenie nowej wartości limitu na XBID wykonane będzie o godzinie 14:00, po zakończeniu rozliczeń transakcji zawartych w systemie M7
 - wyznaczenie nowej wartości limitu na XTR wykonane będzie po godzinie 18:30, po zakończeniu rozliczeń transakcji zawartych w systemie XTR i SAPRI
- W przypadku otrzymania przez IRGiT dyspozycji zmiany proporcji wpłaconych zabezpieczeń po godzinie 11:00, Izba nie gwarantuje, że operacja będzie wykonana w dniu bieżącym.

Zmiana wysokości limitu transakcyjnego

2. Wpłata środków na rachunek depozytów transakcyjnych*:

- Zwiększenie limitu transakcyjnego na XBID odbywać się będzie pod warunkiem otrzymania dyspozycji, przesłanej do IRGiT do godziny 11:00
- Nowa wartość limitu transakcyjnego na XBID wyznaczona zostanie o godzinie 14:00

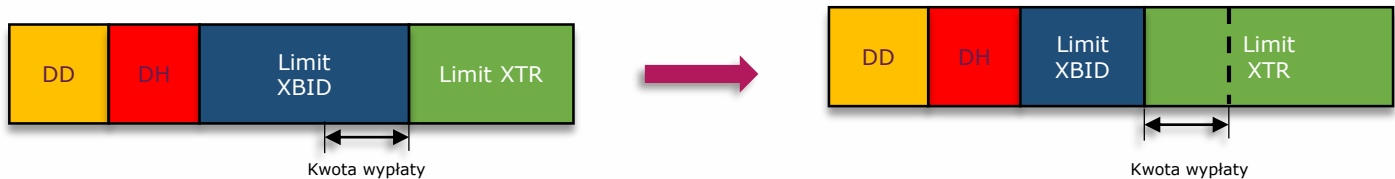


*schemat graficzny nie obejmuje działalności Członka Izby w alternatywnym modelu rozrachunku

Zmiana wysokości limitu transakcyjnego

3. Wypłata środków z rachunku depozytów transakcyjnych:*

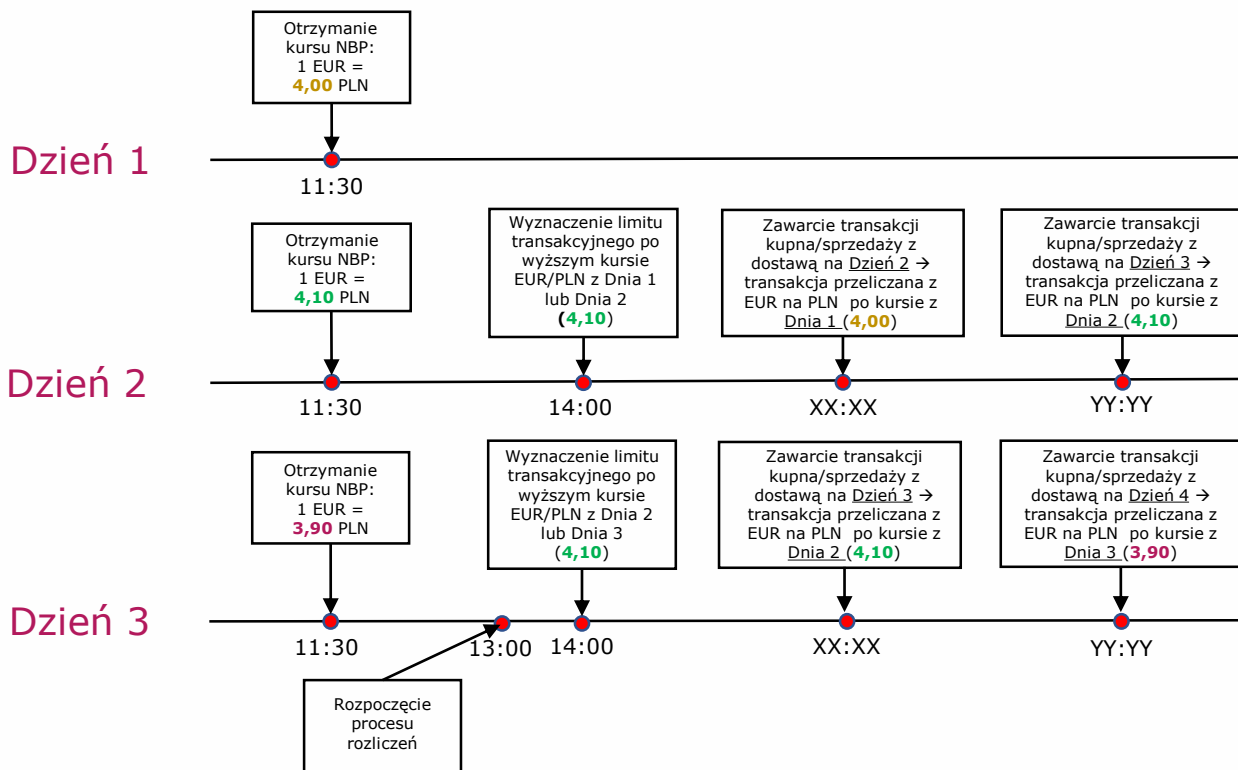
- Zmniejszenie limitu transakcyjnego na XBID poprzez wypłatę środków z rachunku depozytów transakcyjnych może się odbyć pod warunkiem wcześniejszej zmiany proporcji limitu



- Wypłata środków z rachunku depozytów transakcyjnych po zmianie proporcji limitów będzie wykonywana, standardowym trybem, między godziną 16:00 a 16:30, po przekazaniu do Izby do godziny 16:00 dyspozycji wypłaty środków

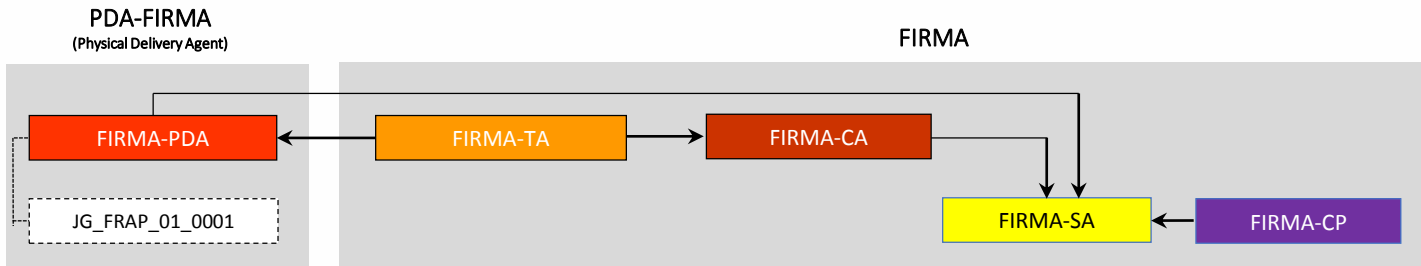
*schemat graficzny nie obejmuje działalności Członka Izby w alternatywnym modelu rozrachunku

Kurs walutowy i czas przekazywania transakcji z M7 do XCLR



Rozliczanie transakcji

- Do obsługi rozliczeń używane będą **istniejące w systemie rozliczeniowym konta** oraz jednostki grafikowe:*
 - konto rozrachunku finansowego (SA)
 - konto zabezpieczeń (CP)
 - konto obrachunkowe (CA)
 - konto ewidencyjne (TA)

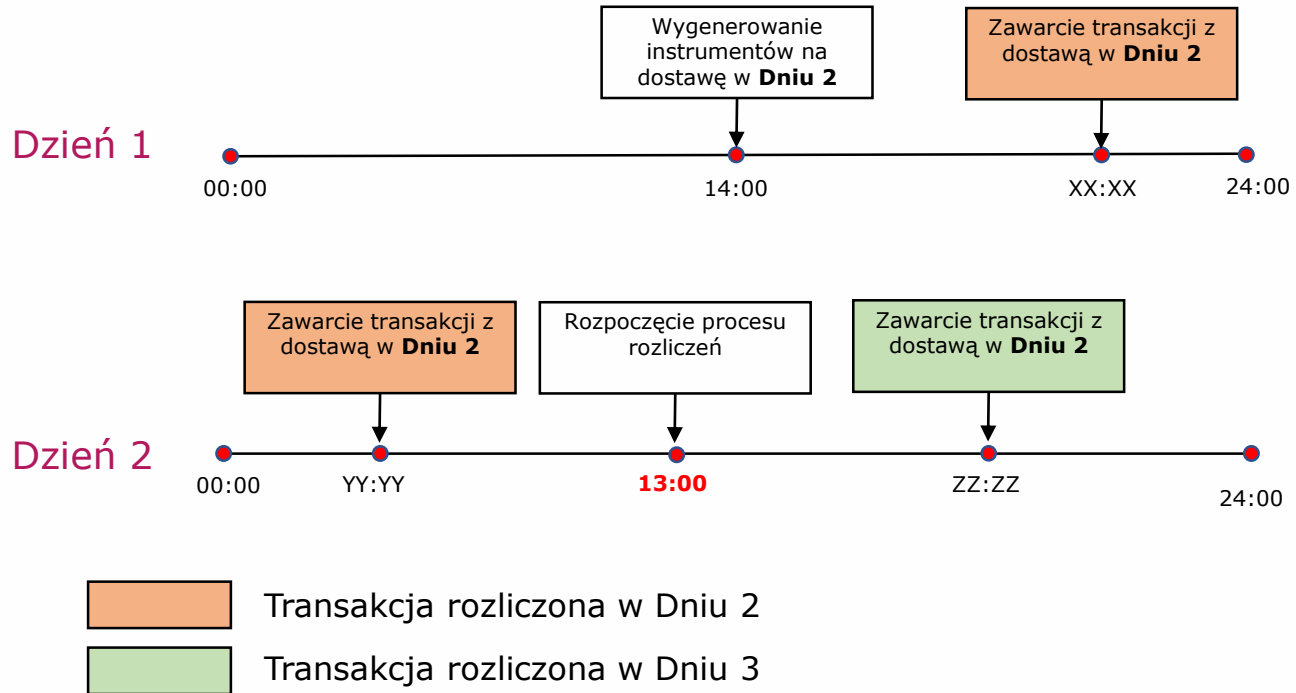


*schemat graficzny nie obejmuje działalności Członka Izby w alternatywnym modelu rozrachunku

Rozliczanie transakcji

- Rozliczenie transakcji odbywać się będzie **niezależnie od harmonogramu obowiązującego dla pozostałych rynków;**
- Rozliczenie transakcji dla danej doby dostawy odbywać się będzie:
 - **w dobie dostawy**, dla transakcji zawartych przed godziną rozliczeń XBID
 - **dzień po dobie dostawy**, dla transakcji zawartych po godzinie rozliczeń XBID

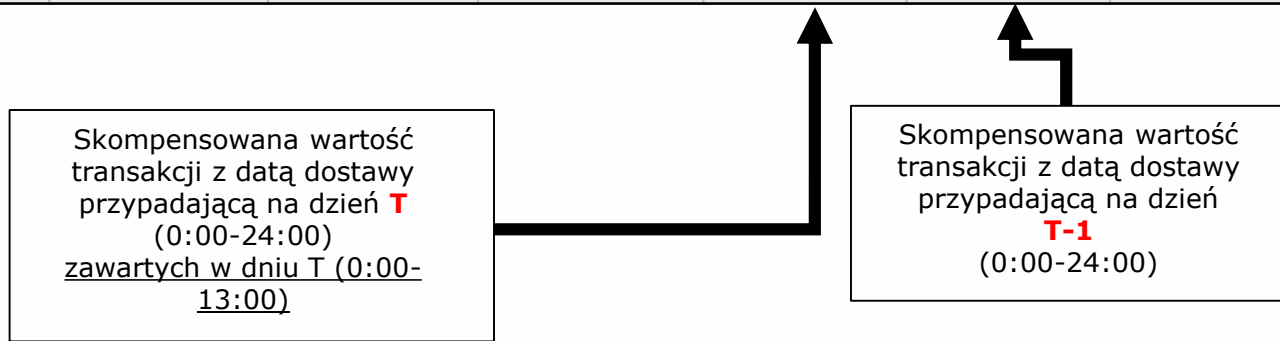
Rozliczanie transakcji



Dane w raportach rozliczeniowych

Dzień rozliczeń – T (dzień roboczy)
 Transakcje zawarte tylko na XBID

Konto	Waluta	Depozyt wstępny	Depozyt uzupełniający	Depozyt rozliczeniowy	Depozyt na należności	Depozyt ogółem
XYZ-CA	PLN	0,00	0,00	-20 000,00		-20 000,00
XYZ-SA	PLN				-10 000,00	-10 000,00
Razem	PLN	0,00	0,00	-20 000,00	-10 000,00	-30 000,00



Dane w raportach rozliczeniowych*

Dzień rozliczeń – T (dzień roboczy)

Transakcje zawarte tylko na XBID

Depozyt dostawy i depozyt historyczny = 0

Deklarowany limit na XBID: 100 000 PLN

Konto	Waluta	Wpłacone zabezpieczenia	Depozyt ogółem	Nadwyżka DW+DU	Inne zabezpieczenia	Dzienny limit transakcyjny
XYZ-SA	PLN	500 000,00	-30 000,00	0,00	-70 000,00	400 000,00

<p>„Inne zabezpieczenia”</p> <p>=</p> <p>wartość deklarowanego limitu na XBID zapisanego ze znakiem ujemnym (-100 000 PLN)</p> <p>+</p> <p>Wartość w kolumnie „Depozyt rozliczeniowy” ze znakiem przeciwnym (+20 000 PLN)</p> <p>+</p> <p>Wartość w kolumnie „Depozyt na należności” ze znakiem przeciwnym (+10 000 PLN)</p>
--



Limit transakcyjny na XBID po zawarciu transakcji:
70 000 PLN

*schemat graficzny nie obejmuje działalności Członka Izby w alternatywnym modelu rozrachunku

Rozrachunek transakcji

- Walutą rozrachunku pieniężnego dla transakcji zawartych na XBID będzie **złoty**;
- Rozrachunek pieniężny zawartych transakcji odbywać się będzie w dniu **D+2** od dnia dostawy towaru;

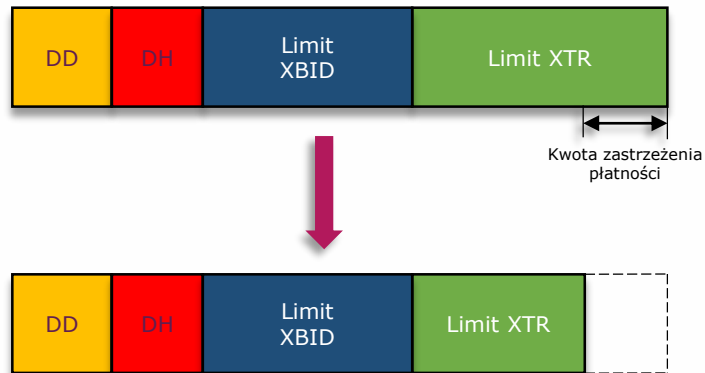
Wtorek	Środa	Czwartek	Piątek	Sobota	Niedziela	Poniedziałek	Wtorek	Środa
Dostawa	Dostawa	Dostawa	Dostawa	Dostawa	Dostawa	Dostawa		
		Płatność	Płatność			Płatność	Płatność	Płatność

Rozrachunek transakcji

- Realizowana płatność stanowić będzie **saldo wszystkich rozliczonych transakcji** Członka Izby w ramach GIR, dla danego dnia rozrachunku pieniężnego;
- Rozrachunek pieniężny przeprowadzany będzie przy współpracy z obecnymi bankami działającymi jako BPCI oraz przy użyciu **obecnych rachunków bankowych** Członków Izby.

Zmniejszenie limitu transakcyjnego – zastrzeżenie płatności*

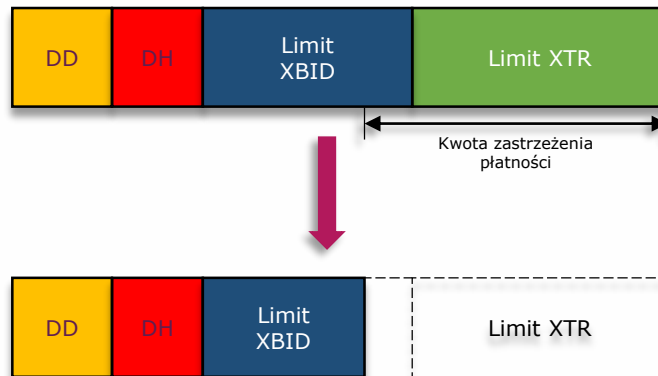
- W przypadku, wystąpienia zastrzeżenia płatności z paczki 1, którego kwota nie przekracza wysokości limitu transakcyjnego na XTR, Izba zmniejszy limit transakcyjny na XTR o kwotę zastrzeżenia płatności



*nie dotyczy działalności Członka Izby w alternatywnym modelu rozrachunku

Zmniejszenie limitu transakcyjnego – zastrzeżenie płatności*

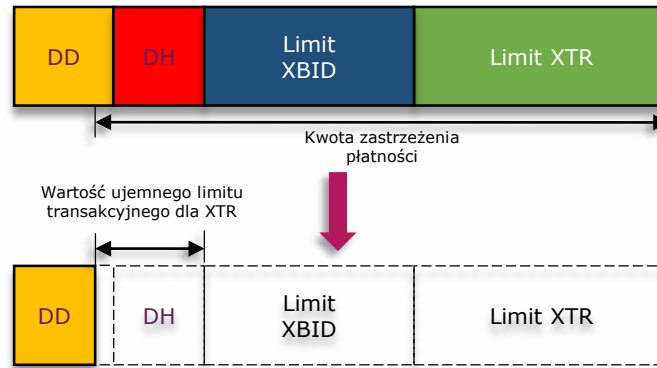
- W przypadku, wystąpienia zastrzeżenia płatności z paczki 1, którego kwota przekracza wysokość limitu transakcyjnego na XTR, Izba zmniejszy limit transakcyjny na XTR do zera oraz dedykowany limit transakcyjny na XBID o pozostałą część kwoty zastrzeżenia płatności.



*nie dotyczy działalności Członka Izby w alternatywnym modelu rozrachunku

Zmniejszenie limitu transakcyjnego – zastrzeżenie płatności*

- W przypadku, wystąpienia zastrzeżenia płatności z paczki 1, którego kwota przekracza zarówno wysokość limitu transakcyjnego na XTR, jak i wysokość deklarowanego limitu na XBID, Izba zmniejszy limit na XBID do zera, natomiast wysokość limitu transakcyjnego na XTR zostanie zmniejszona do wartości ujemnej o brakującą kwotę zastrzeżenia płatności.



*nie dotyczy działalności Członka Izby w alternatywnym modelu rozrachunku

Faktury VAT

- Ze względu na fakt, że **walutą dla składania zleceń i zawierania transakcji będzie euro**, kwoty stosowane do określenia podstawy opodatkowania będą określone w tej walucie;
- Do ustalenia wskazanych wartości w złotych, cena energii po której doszło do transakcji będzie przeliczana według **kursu średniego euro ogłoszonego przez Narodowy Bank Polski**, na ostatni dzień roboczy poprzedzający dzień wystawienia faktury;

Faktury VAT

- Faktury dokumentujące transakcje sprzedaży energii będą wystawiane w **dniu dostawy**;
- Udostępnienie faktur odbywać się będzie za pomocą Platformy Udostępniania Faktur.



Dziękuję za uwagę

Autor prezentacji:

Krzysztof Opara

Dyrektor

Dział Rozliczeń i Rozrachunku

Kontakt:

Tel. 22 341 98 80

E-mail: krzysztof.opara@irgit.pl

Izba Rozliczeniowa Giełd Towarowych S.A., ul. Książęca 4, wejście D, 00-498 Warszawa
T: +48 22 341 99 01, F: +48 22 341 99 83, E: irgit@irgit.pl, NIP: 525-244-16-34

www.irgit.pl