

Wprowadzenie zmian do regulacji IRGiT

Podsumowanie

Izba przedstawia informację na temat zmian wprowadzonych w Regulaminie Giełdowej Izby Rozrachunkowej (Rynek towarowy), Szczegółowych Zasadach Rozliczeń rynków prowadzonych przez Towarową Giełdę Energii S.A. oraz stosownych uchwałach Zarządu IRGiT w zakresie:

- a) działalności przedsiębiorstw energetycznych na rachunek klientów,
- b) aukcji na potrzeby obsługi niewypłacalności na rynku terminowym w zakresie energii elektrycznej i gazu,
- c) wykorzystania należności niewypłacalnego Członka Izby.

Szczegóły zmian zostały opisane w dalszej części dokumentu.

Regulamin Giełdowej Izby Rozrachunkowej (Rynek towarowy) oraz Szczegółowe Zasady Rozliczeń rynków prowadzonych przez Towarową Giełdę Energii S.A. w brzmieniu uwzględniającym powyższe zmiany są dostępne na stronie internetowej Izby i wejdą w życie z dniem 10 maja 2019 r.

W przypadku pytań prosimy o kontakt.

Biuro IRGiT	22 341 99 01
Dział Rozliczeń i Rozrachunku	22 341 99 80
Dział Zarządzania Ryzykiem	22 341 98 20

Działalność przedsiębiorstw energetycznych na rachunek klientów

Izba wprowadziła zapisy regulujące zasady prowadzenia przez przedsiębiorstwa energetyczne działalności na rachunek podmiotów należących do tej samej grupy kapitałowej w rozumieniu Ustawy o rachunkowości („klientów”).

Regulacje, które w szczególności uległy zmianie to:

- a) Szczegółowe Zasady Rozliczeń rynków prowadzonych przez Towarową Giełdę Energii S.A.,
- b) uchwała w sprawie zabezpieczeń niepieniężnych,
- c) uchwała w sprawie określenia algorytmu wyznaczania wartości i trybu regulacji depozytu historycznego oraz określenia listy typów instrumentów, w odniesieniu do których stosowany jest depozyt historyczny,
- d) uchwały w sprawie zmiany zasad organizacji Funduszu Gwarancyjnego.

Rozszerzenie zakresu działalności prowadzonej przez przedsiębiorstwo energetyczne o działalność na rachunek klientów wymaga od Członka Izby:

- złożenia do Izby wniosku o zmianę umowy o członkostwo, umożliwiającej prowadzenie działalności spółki na rachunek klienta;
- złożenia wniosku o dodatkowe dostępy do systemu rozliczeniowego dla pracowników Członka Izby, ponieważ w systemie nadany zostanie osobny kod Członka Izby dla działalności na rachunek klienta;
- otwarcia oddzielnego rachunku rozliczeniowego w celu rozrachunku finansowego oraz aktualizacji wniesionych zabezpieczeń w ramach działalności na rachunek klienta – ze względu na brak możliwości saldowania płatności za transakcje zawarte przez Członka Izby na rachunek własny i rachunek klienta;
- zdeponowania zabezpieczeń na oddzielnych dla danego rodzaju działalności subkontach depozytów transakcyjnych i depozytów zabezpieczających (dodatkowe dostępy do bankowości elektronicznej BPI dla pracowników Członka Izby, w zależności od nadanych im uprawnień dla danego rodzaju działalności);
- złożenia wniosku do Izby o utworzenie osobnych kont ewidencyjnych i obrachunkowych dla każdego klienta (możliwość wyboru jednostek grafikowych dla każdego konta ewidencyjnego).

W zakresie przyjętego modelu:

- limit transakcyjny, depozyt historyczny oraz depozyt dostawy będą wyznaczone oddzielnie dla danego rodzaju działalności;
- depozyty wstępne i uzupełniające będą wyznaczone osobno dla każdego klienta z grupy kapitałowej (nadwyżka z tytułu depozytu zabezpieczającego wyliczonego dla klienta nie będzie mogła pokrywać wymaganego depozytu zabezpieczającego wyliczonego dla innego klienta działającego w ramach jednej grupy kapitałowej);
- faktury będą wystawiane odrębnie za transakcje zawarte przez Członka Izby w ramach działalności na rachunek własny oraz w ramach działalności na rachunek klienta;
- Członek Izby działający na rachunek klientów, wnosząc zabezpieczenia niepieniężne będzie zobowiązany do wskazania klienta, na poczet którego składane jest zabezpieczenie.

Aukcje na potrzeby obsługi niewypłacalności na rynku energii elektrycznej i gazu

W celu objęcia mechanizmem automatycznego zamykania pozycji (aukcji) całego Rynku Terminowego Towarowego prowadzonego przez Towarową Giełdę Energii S.A. („TGE”), Izba dostosowała zapisy Rozdziału VIIa Regulaminu Giełdowej Izby Rozrachunkowej („Regulamin GIR”). Celem aukcji jest zminimalizowanie kosztów zamykania pozycji niewypłacalnych Członków Izby przy możliwie najmniejszym wpływie na ceny rynkowe.

Założenia dotyczące modelu aukcji dla kontraktów terminowych na energię elektryczną i gaz oraz zapisy Regulaminu GIR uzyskały akceptację Komitetu ds. Ryzyka działającego przy IRGiT.

Aukcje dla rynków energii i gazu prowadzone będą z wykorzystaniem systemu transakcyjnego TGE na zasadach określonych dla aukcji w Regulaminie obrotu Rynku Towarów Giełdowych Towarowej Giełdy Energii S.A.

Ponadto, uwzględniając uwagi zgłaszane przez uczestników rynku, zmieniony został §54a ust. 1 oraz §54b ust. 2 Regulaminu GIR, tak aby uczestnictwo w aukcjach nie było obowiązkowe. W konsekwencji §54c ust. 3 Regulaminu GIR został zmodyfikowany poprzez usunięcie zasad dotyczących wykorzystania środków funduszy w zależności od zaangażowania podmiotów w organizowane aukcje.

Powyższe zmiany zostały również uwzględnione w Szczegółowych Zasadach Rozliczeń rynków prowadzonych przez Towarową Giełdę Energii S.A. poprzez dodanie odpowiednich zapisów precyzujących tryb organizacji aukcji.

Wykorzystanie należności niewypłacalnego Członka Izby

W celu zapewnienia Izbie dostępu do odpowiednich mechanizmów zarządzania ryzykiem płynności, w Regulaminie GIR oraz w Szczegółowych Zasadach Rozliczeń rynków prowadzonych przez Towarową Giełdę Energii S.A. wprowadzono zapisy umożliwiające wykorzystanie należności Członka Izby w przypadku jego niewypłacalności, celem pokrycia zobowiązań wymaganych zgodnie z Regulaminem GIR.

Zmiany powyżej wskazanych regulacji przewidują możliwość pokrycia nieuregulowanych zobowiązań Członka Izby poprzez przekazywanie jego należności na odpowiedni rachunek w BPI przypisany temu Członkowi Izby. Wprowadzenie takiego rozwiązania może wpłynąć na usprawnienie procesu obsługi niewypłacalności oraz na obniżenie kosztów zamykania pozycji niewypłacalnych Członków Izby, tym samym zmniejszając prawdopodobieństwo wykorzystania środków wniesionych na poczet funduszu gwarancyjnego.

Projekt zmian regulacji uzyskał pozytywną rekomendację Komitetu ds. Ryzyka działającego przy IRGiT.