



Szczegółowe zasady rozliczeń i roзраchunku Giełdowej Izby Rozrachunkowej

Wchodzą w życie w dniu 1 kwietnia 2021 roku.

Spis treści

DEFINICJE	4
POSTANOWIENIA OGÓLNE	10
CZŁONKOSTWO W IZBIE	10
SYSTEM ZABEZPIECZANIA PŁYNNOŚCI ROZLICZANIA TRANSAKЦИИ	13
PRZEKAZYWANIE POŻYTKÓW ZE ŚRODKÓW ZGROMADZONYCH W SYSTEMIE ZABEZPIECZANIA PŁYNNOŚCI ROZLICZANIA TRANSAKЦИИ ...	14
DEPOZYTY TRANSAKCYJNE	15
DEPOZYT DOSTAWY	18
DEPOZYT HISTORYCZNY	20
LIMIT TRANSAKCYJNY	22
DEPOZYTY ZABEZPIECZAJĄCE DLA RTP	30
REJESTR ZABEZPIECZEŃ NIEPIENIĘŻNYCH.....	44
LIMITY KONCENTRACJI ZABEZPIECZEŃ NIEPIENIĘŻNYCH	54
FUNDUSZ GWARANCYJNY	57
ZASADY POSTĘPOWANIA W SYTUACJI WYSTĄPIENIA PRZYPADKU NARUSZENIA	59
REJESTRACJA OPERACJI ZWIĄZANYCH Z OBROTEM TOWARAMI GIEŁDOWYMI	59
PODZIAŁ POZYCJI KONTRAKTÓW TERMINOWYCH Z RTP, KTÓRYCH PRZEDMIOTEM OBROTU JEST GAZ	62
SPOSÓB I TRYB ROZLICZANIA TRANSAKЦИИ	63
POSTANOWIENIA OGÓLNE.....	63
ZASADY USTALANIA WYSOKOŚCI NALEŻNOŚCI I ZOBOWIĄZAŃ Z TYTUŁU TRANSAKЦИИ ZAWARTYCH NA RDN	65
ZASADY USTALANIA WYSOKOŚCI NALEŻNOŚCI I ZOBOWIĄZAŃ Z TYTUŁU TRANSAKЦИИ ZAWARTYCH NA RDB.....	66
ZASADY USTALANIA WYSOKOŚCI NALEŻNOŚCI I ZOBOWIĄZAŃ Z TYTUŁU REALIZACJI TRANSAKЦИИ ZAWARTYCH NA RTP	66
ZASADY USTALANIA WYSOKOŚCI NALEŻNOŚCI I ZOBOWIĄZAŃ Z TYTUŁU TRANSAKЦИИ ZAWARTYCH NA RPM.....	67
ZASADY USTALANIA WYSOKOŚCI NALEŻNOŚCI I ZOBOWIĄZAŃ Z TYTUŁU TRANSAKЦИИ ZAWARTYCH NA RDNG I RDBG	68
SPOSÓB I TRYB ROZRACHUNKU TRANSAKЦИИ	68
ZASADY PRZEKAZYWANIA INFORMACJI POMIĘDZY IZBA, BPI ORAZ BPCI	69
OBŚLUGA ROZLICZAJĄCYCH CZŁONKÓW IZBY W RAMACH ROZRACHUNKU PIENIĘŻNEGO.....	73
ROZRACHUNEK ENERGII ELEKTRYCZNEJ.....	76
ROZRACHUNEK PRAW MAJĄTKOWYCH ŚP NA RYNKU PRAW MAJĄTKOWYCH	77
ZAWIESZENIE ROZLICZEŃ TRANSAKЦИИ. POSTĘPOWANIE W PRZYPADKU BRAKU DOSTATECZNEJ ILOŚCI PRAW MAJĄTKOWYCH ŚP NA KONCIE CZŁONKA REJESTRU ŚWIADECTW POCHODZENIA W TRYBIE NORMALNYM. TRANSAKЦИЯ KUPNA NA TGE BRAKUJĄCEJ ILOŚCI PRAW MAJĄTKOWYCH ŚP W TRYBIE TRANSAKЦИИ POZASESYJNEJ LUB SESYJNEJ NA RPM	77
TRANSAKЦИЯ KUPNA BRAKUJĄCEJ ILOŚCI PRAW MAJĄTKOWYCH ŚP W TRYBIE DODATKOWYM TRANSAKЦИИ POZASESYJNEJ NA RPM... ..	78
TRYB POSTĘPOWANIA PO WYKONANIU DOKUPIENIA PRAW MAJĄTKOWYCH ŚP	79
ROZRACHUNEK GAZU.....	79
ROZRACHUNEK I ROZLICZENIE TRANSAKЦИИ W OBROcie ENERGIĄ ELEKTRYCZNĄ ZAWIERANYCH NA GIEŁDACH I WYKONYWANYCH POZA KRAJOWYM SYSTEMEM	80
INNE OPERACJE	81
TRANSFER POZYCJI	81
DZIAŁANIA IZBY W PRZYPADKU WYSTĄPIENIA OGRANICZEŃ W POBORZE LUB DOSTAWACH ENERGII ELEKTRYCZNEJ LUB GAZU	83

DZIAŁANIA IZBY W PRZYPADKU ZAWIESZENIA ŚWIADCZENIA USŁUG PRZESYŁOWYCH PRZEZ OSPE LUB OSPG DLA CZŁONKA IZBY LUB W PRZYPADKU WYPOWIEDZENIA UMOWY CZŁONKOWI IZBY PRZEZ PODMIOT UDOSTĘPNIAJĄCY CZŁONKOWI JEDNOSTKĘ GRAFIKOWĄ LUB KOD ZUP	85
DZIAŁANIA IZBY W PRZYPADKU NIEPRZYJĘCIA PRZEZ OSPE LUB OSPG ZGŁOSZENIA DO FIZYCZNEJ REALIZACJI TRANSAKCJI, KTÓRYCH PRZEDMIOTEM JEST ENERGIA ELEKTRYCZNA LUB GAZ	86
ZAŁĄCZNIK NR 1 DO SZCZEGÓŁOWYCH ZASAD ROZLICZEŃ I ROZRACHUNKU GIEŁDOWEJ IZBY ROZRACHUNKOWEJ - HARMONOGRAM ROZLICZEŃ	87
ZAŁĄCZNIK NR 2 DO SZCZEGÓŁOWYCH ZASAD ROZLICZEŃ I ROZRACHUNKU GIEŁDOWEJ IZBY ROZRACHUNKOWEJ - HARMONOGRAM WYSTAWIANIA FAKTUR	88
ZAŁĄCZNIK NR 3A DO SZCZEGÓŁOWYCH ZASAD ROZLICZEŃ I ROZRACHUNKU GIEŁDOWEJ IZBY ROZRACHUNKOWEJ – WZÓR FORMULARZA DEKLARACJI WYZNACZENIA LIMITU TRANSAKCYJNEGO DEDYKOWANEGO RDB (XBID)	90
ZAŁĄCZNIK NR 3B DO SZCZEGÓŁOWYCH ZASAD ROZLICZEŃ I ROZRACHUNKU GIEŁDOWEJ IZBY ROZRACHUNKOWEJ – WZÓR FORMULARZA DEKLARACJI WYZNACZENIA LIMITU TRANSAKCYJNEGO DEDYKOWANEGO RCG	91

Definicje

- 1) **Bank Płatnik Członka Izby lub BPCI** – bank, który na podstawie umowy z Izbą, BPI oraz umów z Członkami Izby zapewnia Członkom Izby usługi finansowe związane z rozrachunkiem Transakcji zawartych przez nich na giełdzie;
- 2) **Bank Rozliczeniowy, Bank Płatnik Izby lub BPI** – bank, który na podstawie umowy z Izbą oraz umów z Bankami Płatnikami Członków Izby zapewnia Izbie usługi finansowe związane z rozrachunkiem Transakcji zawartych na giełdzie;
- 3) **Członek Giełdy** – podmiot, który zawarł z Giełdą umowę o członkostwo;
- 4) **Członek Izby** – podmiot, który zawarł z IRGiT umowę o członkostwo;
- 5) **Dzień Dostawy** – dzień, w którym towar giełdowy sprzedany lub zakupiony w Dniu Obrotu, zostanie dostarczony lub odebrany;
- 6) **Dzień N** – dzień przeprowadzania przez Izbę rozliczeń Transakcji. Dni poprzedzające lub następujące po Dniu N oznaczają się odpowiednio N-1 lub N+1;
- 7) **Dzień Obrotu** – doba, w której odbywa sesja, na której notowane są towary giełdowe;
- 8) **Gaz** – paliwa gazowe, o których mowa w art. 3 pkt 3 a) Ustawy Prawo Energetyczne będący towarem giełdowym dopuszczonym do obrotu na Rynku Towarów Giełdowych zgodnie z odpowiednimi uregulowaniami wewnętrznymi Giełdy;
- 9) **giełda** – Rynek Towarów Giełdowych w rozumieniu Regulaminu;
- 10) **Giełda, TGE** – Towarowa Giełda Energii S.A.;
- 11) **Harmonogram** – szczegółowy plan przebiegu rozrachunku pieniężnego prowadzonego przez Izbę, będący załącznikiem nr 1 do niniejszego dokumentu;
- 12) **IRGiT** – spółka Izba Rozliczeniowa Giełd Towarowych S.A. z siedzibą w Warszawie;
- 13) **IRiESPe** – Instrukcja Ruchu i Eksploatacji Sieci Przesyłowej opracowana przez OSPe;
- 14) **IRiESPg** – Instrukcja Ruchu i Eksploatacji Sieci Przesyłowej opracowana przez OSPg;
- 15) **Izba** – giełdowa izba rozrachunkowa (w rozumieniu Ustawy) prowadzona przez Izbę Rozliczeniową Giełd Towarowych S.A.;
- 16) **Jednostka Grafikowa** – podstawowy obiekt rynku bilansującego w rozumieniu IRiESPe, przydzielony przez OSPe lub udostępniony: Członkowi Izby, klientowi Członka Izby lub reprezentowanemu przez Członka Izby Członkowi Giełdy zgodnie z regulacjami obowiązującymi na Giełdzie, w celu fizycznej realizacji dostawy energii elektrycznej;
- 17) **Kod ZUP** – kod służący do identyfikacji Zleceniodawcy Usługi Przesyłania zdefiniowany w IRiESPg przydzielony przez OSPg lub udostępniony: Członkowi Izby, klientowi

Członka Izby lub reprezentowanemu przez Członka Izby Członkowi Giełdy zgodnie z regulacjami obowiązującymi na Giełdzie, w celu fizycznej realizacji dostawy gazu;

- 18) **Komunikaty SWIFT** – komunikaty przesyłane pomiędzy bankami biorącymi udział w procesie rozrachunku, zgodne ze standardami Society for Worldwide Interbank Financial Telecommunication;
- 19) **Konto dostawy** – urządzenie ewidencyjne służące do rejestrowania wolumenu Pozycji, będącego przedmiotem dostawy;
- 20) **Konto ewidencyjne** – urządzenie ewidencyjne służące do rejestrowania Pozycji w towarach giełdowych prowadzone przez IRGiT według kodu Członka Izby, kodu klienta Członka Izby lub reprezentowanego przez Członka Izby Członka Giełdy, kodu serii towarów giełdowych, kodu rodzaju działalności;
- 21) **Konto rozliczeniowe** – urządzenie ewidencyjne służące do ustalania zobowiązań i należności wynikających z rozliczeń Transakcji zawartych na giełdzie i aktualizacji wymaganych depozytów zabezpieczających, prowadzone przez IRGiT według kodu Członka Izby, kodu klienta Członka Izby lub reprezentowanego przez Członka Izby Członka Giełdy;
- 22) **Konto rozrachunków finansowych** – urządzenie ewidencyjne służące do rejestrowania wartości zobowiązań i należności Członka Izby, na podstawie których Izba przygotowuje zlecenia płatnicze przekazywane do Banku Rozliczeniowego w celu rozrachunku finansowego rozliczanych przez Izbę Transakcji;
- 23) **Konto zabezpieczeń** – urządzenie ewidencyjne służące do rejestrowania łącznej wartości zabezpieczeń wniesionych przez Członka Izby w środkach pieniężnych zdeponowanych na subkontach Rachunków depozytów transakcyjnych i Rachunków depozytów zabezpieczających prowadzonych w BPI lub zdeponowanych przez Izbę na innym rachunku Izby o którym mowa w § 5 ust. 5, jak również w uznanych zgodnie z regulacjami Izby Rachunkach rozliczeniowych prowadzonych w BPCI oraz formach zabezpieczeń niepieniężnych zarejestrowanych w Rejestrze Zabezpieczeń Niepieniężnych;
- 24) **kontrakt terminowy** – kontrakt forward w rozumieniu Regulaminu;
- 25) **Krajowy System** – zbiór urządzeń rozumiany zgodnie z art. 3 pkt 33 Ustawy Prawo Energetyczne, funkcjonujących w ramach krajowej polityki energetycznej,
- 26) **Kurs średni euro** – kurs euro wyrażony w polskich złotych, wyliczany i publikowany przez Narodowy Bank Polski zgodnie z Uchwałą Zarządu Narodowego Banku Polskiego w sprawie sposobu wyliczania i ogłaszania bieżących kursów walut obcych;

- 27) **Limit transakcyjny** – limit składający się z Podstawowego limitu transakcyjnego, Limitu transakcyjnego dedykowanego RDB oraz Limitów transakcyjnych RCG;
- 28) **Limit transakcyjny RCG** – deklarowana i wydzielona przez Członka Izby, działającego jako reprezentant Członka Giełdy, część Limitu transakcyjnego, która składa się z Podstawowego limitu transakcyjnego RCG oraz Limitu transakcyjnego RCG dedykowanego RDB;
- 29) **Limit transakcyjny dedykowany RDB** – deklarowana i wydzielona przez Członka Izby część Limitu transakcyjnego definiująca maksymalną łączną wartość Transakcji kupna (w przypadku cen dodatnich) lub maksymalną łączną wartość Transakcji sprzedaży (w przypadku cen ujemnych) możliwych do zawarcia przez Członka Izby na RDB od godziny 14:00 Dnia N do godziny 14:00 Dnia N+1;
- 30) **Limit transakcyjny RCG dedykowany RDB** - deklarowana przez Członka Izby i wydzielona część Limitu transakcyjnego RCG deklarowanego reprezentowanemu Członkowi Giełdy definiująca maksymalną łączną wartość Transakcji kupna (w przypadku cen dodatnich) lub maksymalną łączną wartość Transakcji sprzedaży (w przypadku cen ujemnych) możliwych do zawarcia przez reprezentowanego przez ten podmiot Członka Giełdy na RDB od godziny 14:00 Dnia N do godziny 14:00 Dnia N+1;
- 31) **Nominacja** – nominacja zdefiniowana w IRiESPg;
- 32) **OSPe lub Operator Systemu Przesyłowego Elektroenergetycznego** – Polskie Sieci Elektroenergetyczne Spółka Akcyjna z siedzibą w Konstancinie-Jeziornie;
- 33) **OSPg lub Operator Systemu Przesyłowego Gazowego** – Operator Gazociągów Przesyłowych GAZ-SYSTEM Spółka Akcyjna z siedzibą w Warszawie;
- 34) **OTF** – OTF w rozumieniu Regulaminu;
- 35) **Podmiot zagraniczny** – Członek Izby z siedzibą za granicą działający na terytorium RP;
- 36) **Podstawowy limit transakcyjny** – część Limitu transakcyjnego pozostała po wydzieleniu, na podstawie deklaracji Członka Izby: Limitu transakcyjnego dedykowanego RDB i Limitu transakcyjnego RCG, definiująca maksymalną łączną wartość Transakcji kupna (w przypadku cen dodatnich cen) lub maksymalną łączną wartość Transakcji sprzedaży (w przypadku cen ujemnych) możliwych do zawarcia w Dniu N na RDN, RDNg, RDBg i RPM przez danego Członka Izby z wyłączeniem Transakcji zawartych na RDN objętych depozytem historycznym;
- 37) **Podstawowy limit transakcyjny RCG** – część Limitu transakcyjnego RCG pozostała po wydzieleniu, na podstawie deklaracji Członka Izby Limitu transakcyjnego RCG dedykowanego RDB, definiująca maksymalną łączną wartość Transakcji kupna (w

przypadku cen dodatnich) lub maksymalną łączną wartość Transakcji sprzedaży (w przypadku cen ujemnych) możliwych do zawarcia w Dniu N na RDN, RDNg, RDBg i RPM przez reprezentowanego Członka Giełdy z wyłączeniem Transakcji zawartych na RDN objętych depozytem historycznym;

- 38) **Pozycje** – towary giełdowe, zarejestrowane na Kontach ewidencyjnych w wyniku przyjętych do rozliczenia transakcji nabycia lub zbycia danej serii towarów giełdowych albo transakcji zawartych w ramach prowadzonego przez Izbę systemu gwarantowania rozliczeń;
- 39) **Prawa Majątkowe ŚP** – prawa majątkowe ze świadectw pochodzenia w rozumieniu przepisów Ustawy Prawo Energetyczne, w rozumieniu Ustawy o odnawialnych źródłach energii oraz prawa majątkowe ze świadectw efektywności energetycznej w rozumieniu przepisów Ustawy o efektywności energetycznej;
- 40) **Rachunek depozytów transakcyjnych** – rachunek Izby w BPI wraz z subkontami dedykowanymi Członkom Izby, na których księgowane są środki stanowiące depozyty transakcyjne wnoszone przez Członków Izby;
- 41) **Rachunek depozytów zabezpieczających** – rachunek Izby w BPI wraz z subkontami dedykowanymi Członkom Izby, na których księgowane są środki stanowiące depozyty zabezpieczające dla RTP wnoszone przez Członków Izby;
- 42) **Rachunek rozliczeniowy** – rachunek Członka Izby w BPCI służący do obsługi rozrachunku pieniężnego dla Transakcji zawartych na RDN, RDB, RDNg, RDBg, RPM i RTP oraz aktualizacji depozytów zabezpieczających dla RTP;
- 43) **Rachunek rozliczeniowy Izby** – rachunek Izby w BPI dedykowany do obsługi transferów międzybankowych podczas rozrachunku pieniężnego oraz aktualizacji wymaganych depozytów zabezpieczających;
- 44) **Rachunek techniczny** – rachunek Izby w BPCI dedykowany do obsługi rozrachunku pieniężnego oraz aktualizacji wymaganych depozytów zabezpieczających;
- 45) **Raport kontrolny** – raport wysyłany przez Izbę do BPCI w każdym dniu roboczym zawierający informacje o płatnościach poszczególnych Członków Izby z tytułu rozliczeń Transakcji zawartych na giełdzie oraz aktualizacji wymaganych depozytów zabezpieczających;
- 46) **Raport rozliczeniowy** – raport dostępny dla Członka Izby w Systemie rozliczeniowym zawierający wartości depozytów, płatności na dany dzień z tytułu rozliczeń Transakcji zawartych na giełdzie, wartość Limitu transakcyjnego oraz wartość wniesionych zabezpieczeń;
- 47) **RDB** – Rynek Dnia Bieżącego, prowadzony przez Giełdę;

- 48) **RDBg** – Rynek Dnia Bieżącego gazu, prowadzony przez Giełdę;
- 49) **RDN** – Rynek Dnia Następnego, prowadzony przez Giełdę;
- 50) **RDNg** – Rynek Dnia Następnego gazu, prowadzony przez Giełdę;
- 51) **Regulamin** – Regulamin Giełdowej Izby Rozrachunkowej (Rynek towarowy);
- 52) **Regulamin TGE** – Regulamin obrotu Rynku Towarów Giełdowych Towarowej Giełdy Energii S.A.;
- 53) **Rejestr Świadectw Pochodzenia** – rejestr świadectw pochodzenia prowadzony przez uprawniony podmiot na podstawie obowiązujących w tym zakresie przepisów prawa;
- 54) **Rejestr Zabezpieczeń Niepieniężnych** – Rejestr prowadzony przez Izbę, w którym rejestrowane są Prawa Majątkowe ŚP, uprawnienia do emisji CO₂, gwarancje bankowe stanowiące zabezpieczenie pokrycia zobowiązań Członków Izby oraz odpowiednio ich klientów lub reprezentowanych Członków Giełdy z tytułu depozytów zabezpieczających oraz depozytów transakcyjnych;
- 55) **Rozliczający Członek Izby** – podmiot, który uzyskał członkostwo w Izbie na mocy uchwały Zarządu IRGiT i dopuszczony został przez Izbę do rozliczania Transakcji zawartych na giełdzie;
- 56) **rozliczenie** – proces ustalania Pozycji, w tym obliczania zobowiązań netto oraz zapewniania dostępności towarów giełdowych lub środków pieniężnych na potrzeby zabezpieczenia ekspozycji wynikających z tych Pozycji, zachodzący od momentu przyjęcia przez Izbę Transakcji do rozliczenia zgodnie z Regulaminem, do momentu przeprowadzenia rozrachunku przez Izbę lub przez inny uprawniony podmiot;
- 57) **rozrachunek** – zrealizowanie transakcji na towarach giełdowych rozliczanych przez Izbę, poprzez transfer środków pieniężnych lub dostawę towarów giełdowych na zasadach określonych w Regulaminie;
- 58) **RPM** – Rynek Praw Majątkowych ŚP, prowadzony przez Giełdę;
- 59) **RTP** – prowadzony przez Giełdę w ramach OTF, Rynek Terminowy Produktów z dostawą energii elektrycznej (RTPE) i Rynek Terminowy Produktów z dostawą Gazu (RTPG), w ramach którego prowadzony jest obrót kontraktami terminowymi;
- 60) **seria kontraktu** – rozumie się przez to kontrakt o określonym standardzie i okresie wykonania;
- 61) **System rozliczeniowy** – zespół urządzeń i oprogramowania, w szczególności wyspecjalizowany program komputerowy, przy pomocy którego prowadzony jest

proces rozliczenia Transakcji oraz sporządzane są Raporty rozliczeniowe, udostępniane przez Izbę upoważnionym użytkownikom tego systemu;

- 62) **TGeBase** – indeks TGeBase, wyznaczany przez TGE zgodnie ze Szczegółowymi zasadami obrotu i rozliczeń dla energii elektrycznej na Rynku Dnia Następnego;
- 63) **TGEgasDA** – indeks TGEgasDA, wyznaczany przez TGE zgodnie ze Szczegółowymi zasadami obrotu i rozliczeń dla gazu na Rynku Dnia Następnego i Bieżącego gazu;
- 64) **TGeOffpeak** – indeks TGeOffpeak, wyznaczany przez TGE zgodnie ze Szczegółowymi zasadami obrotu i rozliczeń dla energii elektrycznej na Rynku Dnia Następnego;
- 65) **TGePeak** – indeks TGePeak, wyznaczany przez TGE zgodnie ze Szczegółowymi zasadami obrotu i rozliczeń dla energii elektrycznej na Rynku Dnia Następnego;
- 66) **Toe** – rozumie się przez to tonę oleju ekwiwalentnego w rozumieniu Ustawy o efektywności energetycznej;
- 67) **towar giełdowy** – rozumie się przez to towar giełdowy w rozumieniu Regulaminu;
- 68) **Transakcja** – umowa sprzedaży towaru giełdowego zawarta na giełdzie, której stroną rozliczeń jest Członek Izby;
- 69) **Transakcja pozasesyjna** – umowa sprzedaży towaru giełdowego zawarta poza sesją na giełdzie, której stroną rozliczeń jest Rozliczający Członek Izby;
- 70) **Ustawa** – ustawa z dnia 26 października 2000 r. o giełdach towarowych (t. jedn. Dz. U. z 2005 r., Nr 121 poz. 1019 z późn. zm.);
- 71) **Ustawa o efektywności energetycznej** – rozumie się przez to ustawę z dnia 15 kwietnia 2011 r. o efektywności energetycznej (Dz. U. z 2011 r., Nr 94, poz. 551 z późn. zm.);
- 72) **Ustawa o odnawialnych źródłach energii** - ustawa z dnia 20 lutego 2015 r. o odnawialnych źródłach energii (Dz. U. z 2015 r., poz. 478, z późn. zm.);
- 73) **Ustawa Prawo Energetyczne** – rozumie się przez to ustawę z dnia 10 kwietnia 1997 r. Prawo Energetyczne (Dz. U. z 2006 r., Nr 89. poz. 625 z późn. zm.);
- 74) **Zagraniczna izba rozliczeniowa** – podmiot działający samodzielnie wobec Izby, który dokonuje rozliczenia Transakcji w obrocie energią elektryczną zawieranych na giełdach i wykonywanych poza Krajowym Systemem;
- 75) **Zlecenie** – złożona przez Członka Giełdy oferta kupna lub sprzedaży towarów giełdowych na giełdzie.

ROZDZIAŁ I

POSTANOWIENIA OGÓLNE

§ 1

1. Niniejsze Szczegółowe zasady rozliczeń i rozrachunku Giełdowej Izby Rozrachunkowej (dalej również „Szczegółowe zasady rozliczeń i rozrachunku”) zostały zatwierdzone przez Zarząd IRGiT celem określenia szczegółowych zasad prowadzenia procesu rozliczeń i rozrachunku Transakcji zawartych na giełdzie, zgodnie z Regulaminem.
2. Szczegółowe zasady prowadzenia procesu rozliczeń i rozrachunku Transakcji zawartych na giełdzie w zakresie Rynku Towarów Rolno – Spożywczych określają odrębne Szczegółowe zasady rozliczeń dla tego rynku.

§ 2

Zarząd Izby Rozliczeniowej Giełd Towarowych S.A. ma prawo do zmiany niniejszych Szczegółowych zasad rozliczeń i rozrachunku w całości lub w części, w każdym czasie, na zasadach określonych w § 3 Regulaminu.

§ 3

Do terminów użytych w niniejszych Szczegółowych zasadach rozliczeń i rozrachunku stosuje się przepisy i definicje określone w Regulaminie, o ile nie zostały zdefiniowane w niniejszych Szczegółowych zasadach rozliczeń i rozrachunku.

ROZDZIAŁ II

CZŁONKOSTWO W IZBIE

§ 4

1. Członkami Izby na zasadach określonych w Regulaminie, mogą być:
 - a) spółki prowadzące Rynek towarów giełdowych,
 - b) towarowe domy maklerskie,
 - c) domy maklerskie,
 - d) inne niż wymienione w lit. a) – c) krajowe instytucje finansowe, w tym w szczególności banki, jeżeli ich członkostwo ma na celu współdziałanie z Izbą w zakresie rozliczania Transakcji zawieranych na Rynkach towarów giełdowych,
 - e) przedsiębiorstwa energetyczne,

- f) zagraniczne osoby prawne, o których mowa w art. 50 ust. 1 Ustawy, prowadzące działalność maklerską w zakresie obrotu towarami giełdowymi na terytorium Rzeczypospolitej Polskiej w formie oddziału.
- g) spółki prowadzące giełdową izbę rozrachunkową z siedzibą w krajach członkowskich Unii Europejskiej, Konfederacji Szwajcarskiej lub w państwach członkowskich Europejskiego Porozumienia o Wolnym Handlu (EFTA) – stronach umowy o Europejskim Obszarze Gospodarczym.
2. Członkostwo w Izbie nabywane jest poprzez podjęcie przez Zarząd IRGiT uchwały w sprawie akceptacji wniosku zainteresowanego podmiotu o zawarcie umowy o członkostwo.
3. Wniosek, o którym mowa w ust. 2, sporządza się na formularzu, zgodnie ze wzorem określonym przez Izbę.
4. We wniosku, o którym mowa w ust. 2, Wnioskodawca wskazuje rodzaj wykonywanej działalności. Wyróżnia się następujące rodzaje działalności:
- a) działalność na rachunek własny - gdy Członek Izby przyjmuje odpowiedzialność za wykonywanie zobowiązań wynikających z rozliczeń Transakcji zawieranych przez niego na rachunek własny,
 - b) działalność na rachunek klientów - gdy Członek Izby przyjmuje odpowiedzialność za wykonywanie zobowiązań wynikających z rozliczeń Transakcji zawieranych przez niego na rachunek jego klientów,
 - c) jako reprezentant Członka Giełdy - w wypadku, gdy Członek Izby przyjmuje odpowiedzialność za wykonywanie zobowiązań wynikających z rozliczeń Transakcji zawieranych przez inny podmiot.
- Dopuszcza się wskazanie więcej niż jednego rodzaju wykonywanej działalności.
5. Członek Giełdy reprezentowany przez Członka Izby na zasadach określonych w ust. 4 lit c), nie może być jednocześnie Członkiem Izby. Członek Giełdy może być reprezentowany tylko przez jednego Członka Izby.
6. Członek Izby, który zamierza prowadzić działalność jako reprezentant Członka Giełdy, zobowiązany jest dołączyć do wniosku o zawarcie umowy o członkostwo w Izbie, pisemne oświadczenie podmiotu, którego zamierza reprezentować jako strona rozliczenia, w którym podmiot ten wyraża zgodę na wykonywanie przez Członka Izby obowiązków wynikających z rozliczeń zawieranych przez niego Transakcji.
7. Dla Członka Izby, który zamierza prowadzić działalność na rachunek własny i jednocześnie działać na rachunek klienta lub jako reprezentant Członka Giełdy, Izba tworzy w Systemie rozliczeniowym dwa oddzielne zestawy kont, zgodnie z zapisami

§ 39 i § 40, jeden odpowiadający działalności danego Członka Izby na rachunek własny, natomiast drugi odpowiadający działalności innej niż na rachunek własny.

8. Izba tworzy konta, o których mowa w § 39 i § 40, dla Członka Izby działającego wyłącznie na rachunek własny na podstawie wniosku o zawarcie umowy o członkostwo w Izbie. Członek Izby, który działa na rachunek klienta lub jako reprezentant Członka Giełdy, składa w Izbie odrębny wniosek o otwarcie odpowiednich kont w Systemie rozliczeniowym.
9. Członek Izby wskazuje we wniosku o zawarcie umowy o członkostwo w Izbie podmiot, który będzie pełnił dla niego funkcję Banku Płatnika Członka Izby. Członek Izby, który zamierza prowadzić działalność na rachunek własny i jednocześnie działać na rachunek klienta lub jako reprezentant Członka Giełdy jest zobowiązany do otwarcia w BPCI dwóch rachunków bankowych, jednego dedykowanego dla działalności na rachunek własny drugiego dla działalności innej niż na rachunek własny.
10. Izba rozlicza Transakcje, za których rozliczenie odpowiada dany Członek Izby, o ile w momencie zawarcia tych Transakcji, Członek ten posiada status Rozliczającego Członka Izby na zasadach określonych w Regulaminie. Członek Izby, który zamierza prowadzić działalność na rachunek własny i jednocześnie działać na rachunek klienta lub jako reprezentant Członka Giełdy, zobowiązany jest do uzyskania statusu Rozliczającego Członka Izby dla każdego rodzaju prowadzonej działalności.
11. Zmiana umowy o członkostwo odbywa się poprzez złożenie przez Członka Izby wniosku zgodnie ze wzorem określonym przez Izbę i wymaga akceptacji Zarządu IRGiT.
12. Rozwiązanie umowy o członkostwo przez Członka Izby wymaga formy pisemnej. Członek Izby może rozwiązać umowę o członkostwo w Izbie wypowiedzając tę umowę z zachowaniem czternastodniowego okresu wypowiedzenia, ze skutkiem na koniec miesiąca kalendarzowego. Członek Izby, który dokonał wypowiedzenia umowy o członkostwo w Izbie, obowiązany jest podjąć działania mające na celu zamknięcie Pozycji otwartych w wyniku Transakcji zawartych na giełdzie, za których rozliczenie odpowiada, lub przetransferowanie tych Pozycji do innego Rozliczającego Członka Izby. Zamknięcie lub przetransferowanie tych Pozycji powinno nastąpić najpóźniej do dnia upływu okresu dokonanego wypowiedzenia. Dokonanie wypowiedzenia umowy o członkostwo w Izbie, nie powoduje utraty posiadania przez niego statusu Rozliczającego Członka Izby w zakresie Transakcji zawartych na giełdzie do dnia rozwiązania tej umowy, ani też wygaśnięcia innych związanych z tym statusem obowiązków.

ROZDZIAŁ III

SYSTEM ZABEZPIECZANIA PŁYNNOŚCI ROZLICZANIA TRANSAKCJI

§ 5

1. W skład systemu gwarantowania rozliczeń prowadzonego przez Izbę wchodzi:
 - a) depozyty transakcyjne, które składają się z depozytu dostawy, depozytu historycznego oraz Limitu transakcyjnego uwzględniającego Podstawowy limit transakcyjny, Limit transakcyjny dedykowany RDB oraz Limit transakcyjny RCG,
 - b) depozyty zabezpieczające dla kontraktów terminowych, które składają się z depozytu wstępnego i depozytu uzupełniającego,
 - c) fundusz gwarancyjny.
2. Izba tworzy i zarządza systemem zabezpieczenia płynności rozliczeń Transakcji sesyjnych i pozasesyjnych zawartych na giełdzie w oparciu o środki finansowe zgromadzone na subkontach Rachunku depozytów transakcyjnych i subkontach Rachunku depozytów zabezpieczających Członków Izby w Banku Płatniku Izby oraz o uznane zabezpieczenia niepieniężne, zarejestrowane w Rejestrze Zabezpieczeń Niepieniężnych, z zastrzeżeniem postanowień ust. 3 i ust. 5.
3. W przypadku Członków Izby, którzy uzyskali zgodę Zarządu IRGiT, o której mowa w § 11 ust. 2 Regulaminu, za Rachunek depozytów transakcyjnych lub depozytów zabezpieczających Izba może uznać wskazany Rachunek rozliczeniowy prowadzony w BPCI.
4. Wpłaty i wypłaty z subkonta Rachunku depozytów transakcyjnych dokonywane są przez Członka Izby oraz wpływają bezpośrednio na Podstawowy limit transakcyjny. Aktualizacja środków zgromadzonych na subkontach Rachunku depozytów zabezpieczających odbywa się w sposób automatyczny, na podstawie zleceń płatniczych składanych przez IRGiT w każdym dniu roboczym.
5. Zarząd IRGiT może w sytuacjach szczególnych podjąć uchwałę o czasowym przeniesieniu na czas określony środków finansowych, o których mowa w ust. 2 na zbiorczy rachunek Izby prowadzony w innym banku niż BPI oraz określić tą uchwałą szczegółowe zasady postępowania w takiej sytuacji.

§ 6

1. Każdy Członek Izby posiada w Systemie rozliczeniowym Konto zabezpieczeń odzwierciedlające bieżący stan wniesionych zabezpieczeń dla Transakcji, za których rozliczenie odpowiada.

2. W każdym dniu roboczym po zakończeniu rozliczeń do godziny 18:30, stan Konta zabezpieczeń jest aktualizowany w oparciu o wniesione środki pieniężne i uznane zabezpieczenia niepieniężne.
3. Przed każdym Dniem Obrotu Izba przesyła do Giełdy aktualne Podstawowe limity transakcyjne oraz Podstawowe limity transakcyjne RCG wyznaczane na kolejną sesję odpowiednio dla poszczególnych Rozliczających Członków Izby oraz Członków Giełdy reprezentowanych przez Członków Izby.
4. Limity transakcyjne dedykowane RDB oraz Limity transakcyjne RCG dedykowane RDB wyznaczane są na okres, w którym notowane są instrumenty na RDB. Limity te są aktualizowane i przesyłane do Giełdy w Dniu N do godziny 14:00, po zakończeniu rozliczeń Transakcji, które zostały zawarte na RDB pomiędzy godziną 13:00 w Dniu N 1 a godziną 13:00 w Dniu N. W wyjątkowych sytuacjach limity te mogą zostać przesłane do Giełdy po godzinie 14:00.

Przekazywanie pożytków ze środków zgromadzonych w systemie zabezpieczania płynności rozliczania Transakcji

§ 7

1. Pożytki z tytułu odsetek od środków pieniężnych wnoszonych przez Rozliczających Członków Izby na subkonta Rachunku depozytów zabezpieczających w Banku Płatniku Izby, przekazywane są Członkom Izby kolejnego dnia roboczego po dniu ich otrzymania w trakcie aktualizacji depozytu zabezpieczającego, poprzez zmniejszenie bądź zwiększenie kwoty wynikającej z aktualizacji depozytu.
2. Do momentu przekazania Członkom Izby pożytków, o których mowa w ust. 1 powyżej, zaliczane są one na poczet wpłaty na depozyt zabezpieczający danego Członka Izby.
3. Pożytki z tytułu odsetek od środków pieniężnych wnoszonych przez Członków Izby na subkonta Rachunku depozytów transakcyjnych w Banku Płatniku Izby zaliczane są na poczet wpłaty na depozyt transakcyjny poszczególnych Członków Izby.
4. Pożytki z tytułu odsetek od środków pieniężnych wnoszonych przez Członków Izby na rachunek funduszu gwarancyjnego, przekazywane są Członkom Izby zgodnie z § 45f Regulaminu.
5. W odniesieniu do Członków Izby, dla których Zarząd IRGiT wyraził zgodę, o której mowa w § 11 ust. 2 Regulaminu, pożytki z tytułu odsetek od środków pieniężnych tych Członków utrzymywanych na Rachunkach rozliczeniowych zaliczane są na poczet wpłaty na depozyt transakcyjny i depozyt zabezpieczający.

6. Wartość pożytków uzyskanych z tytułu odsetek od środków pieniężnych, wnoszonych przez Członków Izby do systemu gwarantowania rozliczeń, jest pomniejszana zgodnie z obowiązującymi przepisami o kwotę należnego podatku. Podatek od pożytków z tytułu odsetek od środków wniesionych przez Członków Izby na subkonta Rachunku depozytów zabezpieczających oraz na subkonta Rachunku depozytów transakcyjnych pobierany jest w pierwszym tygodniu każdego miesiąca za miesiąc poprzedni, natomiast podatek od pożytków z tytułu odsetek od środków pieniężnych wniesionych do Funduszu Gwarancyjnego jest pobierany kwartalnie wraz z aktualizacją wpłaty do tego funduszu.

Depozyty transakcyjne

§ 8

1. Depozyty transakcyjne służą zabezpieczeniu rozrachunków pieniężnych oraz zobowiązań z tytułu zmian wartości depozytów zabezpieczających.
2. Wartość depozytów transakcyjnych stanowi suma środków wpłaconych na poczet wymaganego depozytu dostawy, wymaganego depozytu historycznego i środków wniesionych na rzecz Limitu transakcyjnego.
3. Izba wymaga od Rozliczającego Członka Izby utrzymywania minimalnej wartości depozytów transakcyjnych, która z zastrzeżeniem ust. 4, w zależności od rynku na którym prowadzi on działalność, wynosi:
 - a) dla RPM – 0 zł,
 - b) dla RDNg oraz RDBg – 0 zł,
 - c) dla RDN oraz RDB – 20 000 zł,
 - d) dla RTP – 50 000 zł.
4. W przypadku prowadzenia przez Członka Izby działalności na więcej niż jednym rynku, minimalna wartość depozytów transakcyjnych wyznaczana jest jako określona dla rynku o najwyższej wymaganej wartości minimalnej depozytów transakcyjnych zgodnie z ust. 3.

§ 9

1. Środki depozytu transakcyjnego wniesione przez Członka Izby gromadzone są odrębnie dla działalności prowadzonej na rachunek własny oraz odrębnie dla działalności innej niż

na rachunek własny, na dedykowanym temu Członkowi Izby subkoncie Rachunku depozytów transakcyjnych w Banku Płatniku Izby oraz w Rejestrze Zabezpieczeń Niepieniężnych, z zastrzeżeniem § 5 ust. 3 oraz ust. 5.

2. Wpłaty na subkonto Rachunku depozytów transakcyjnych są wykonywane bez konieczności uzyskania uprzedniej akceptacji Izby.
3. Wypłaty środków pieniężnych wniesionych na depozyt transakcyjny są dokonywane w dni robocze na zlecenie Rozliczającego Członka Izby pod warunkiem uzyskania uprzedniej akceptacji Izby.
4. Realizacja zlecenia wypłaty środków pieniężnych wniesionych z tytułu depozytu transakcyjnego następuje nie później niż następnego dnia roboczego po dniu złożenia odpowiedniej dyspozycji przez Członka Izby w systemie bankowości elektronicznej BPI lub w przypadku, o którym mowa w § 5 ust. 3, w bankowości elektronicznej BPCI wraz z akceptacją dyspozycji przez osoby upoważnione przez danego Członka Izby.
5. Złożenie dyspozycji przelewu, o której mowa w ust. 4 powyżej, może nastąpić także poprzez przesłanie pocztą elektroniczną na adres mailowy Działu Rozliczeń i Rozrachunku skanu pisma zawierającego prośbę o dokonanie wypłaty środków wraz ze wskazaniem kwoty wypłaty, numeru rachunku rozliczeniowego w BPCI albo alternatywnego numeru rachunku w przypadku uzyskania zgody Zarządu IRGiT, o której mowa w ust. 6.
6. Zarząd IRGiT na wniosek Członka Izby może w drodze uchwały wyrazić zgodę na składanie przez tego Członka Izby zleceń wypłaty środków pieniężnych z subkonta Rachunku depozytów transakcyjnych na wskazany we wniosku rachunek bankowy prowadzony w walucie PLN przez bank krajowy mający siedzibę na terytorium Polski („alternatywny numer rachunku”).
7. Zarząd IRGiT ma prawo do odmowy udzielenia zgody na korzystanie przez Członka Izby z alternatywnego numeru rachunku do wypłat, o których mowa w ust. 6 lub jej uchylenia, w przypadku wystąpienia jakiegokolwiek zdarzenia, które w ocenie IRGiT może mieć negatywny wpływ na bezpieczeństwo rozliczeń.
8. Izba weryfikuje złożone przez Rozliczających Członków Izby zlecenia wypłat, o których mowa w ust. 3 stosując poniższe zasady:
 - a) W przypadku zlecenia od Członka Izby działającego na rachunek własny lub Członka Izby prowadzącego działalność inną niż na rachunek własny, który nie uzyskał zgody, o której mowa w § 11 ust. 2 Regulaminu, zgoda na wypłatę wyrażana jest jeśli spełniony jest następujący warunek:

$$W\dot{S}DT - WW - DWLT - LT_{RDB} + \min(BM; 0) + \min(SM; 0) \geq \max(DD + \dot{S}PDH; MWDT)$$

gdzie:

- WŚDT* – wartość środków pieniężnych na subkoncie Rachunku depozytów transakcyjnych w BPI,
- WW* – wartość wypłaty w zleceniu Rozliczającego Członka Izby,
- DWLT* – suma wartości Limitów transakcyjnych RCG,
- LT_{RDB}* – wartość Limitu transakcyjnego dedykowanego RDB,
- BM* – wartość salda zobowiązań lub należności z tytułu rozliczeń Transakcji, którego płatność będzie realizowana w najbliższym dniu roboczym,
- SM* – wartość salda zobowiązań lub należności z tytułu rozliczeń Transakcji, którego płatność będzie realizowana w drugim najbliższym dniu roboczym,
- DD* – wymagana wartość depozytu dostawy, o którym mowa w § 10,
- ŚPDH* – wartość wymaganych środków pieniężnych na pokrycie depozytu historycznego, o którym mowa w § 11,
- MWDT* – minimalna wartość depozytu transakcyjnego, o której mowa w § 8 ust. 3 oraz ust. 4.

b) W przypadku zlecenia od Członka Izby, który uzyskał zgodę, o której mowa w § 11 ust. 2 Regulaminu, zgoda na wypłatę wyrażana jest jeśli spełnione są następujące warunki:

$$WŚ - WW - DWLT - WŚDZ - LT_{RDB} + \min(BM; 0) + \min(SM; 0) \geq MWDT$$
$$WŚ - WW \geq 0 \text{ zł}$$

gdzie:

- WŚ* – wartość środków pieniężnych na Rachunku rozliczeniowym w BPCI,
- WW* – wartość wypłaty w zleceniu Rozliczającego Członka Izby,
- DWLT* – suma wartości Limitów transakcyjnych RCG,
- LT_{RDB}* – wartość Limitu transakcyjnego dedykowanego RDB,
- WŚDZ* – wartość wymaganych środków pieniężnych na depozyty zabezpieczające,
- BM* – wartość salda zobowiązań lub należności z tytułu rozliczeń Transakcji, którego płatność będzie realizowana w najbliższym dniu roboczym,
- SM* – wartość salda zobowiązań lub należności z tytułu rozliczeń Transakcji, którego płatność będzie realizowana w drugim najbliższym dniu roboczym,
- MWDT* – minimalna wartość depozytu transakcyjnego, o której mowa w § 8 ust. 3 oraz ust. 4.

9. Zgoda na wypłatę wyrażana jest pod warunkiem kompletności podpisów złożonych przez osoby posiadające upoważnienie do wydawania dyspozycji przelewu środków z dedykowanego Członkowi Izby subkonta Rachunku depozytów transakcyjnych w BPI lub

w przypadku, o którym mowa w punkcie § 5 ust. 3, z Rachunku rozliczeniowego domów maklerskich oraz towarowych domów maklerskich w BPCI.

10. W przypadku zlecenia od Członka Izby działającego na rachunek własny lub Członka Izby prowadzącego działalność inną niż na rachunek własny, który nie uzyskał zgody, o której mowa w § 11 ust. 2 Regulaminu, zgoda na wypłatę wyrażana jest, pod warunkiem spełnienia kryteriów opisanych w ust. 8 lit. a), jeśli wskazany numeru rachunku, na który zostaną przekazane środki jest numerem rachunku rozliczeniowego Członka Izby lub alternatywnym numerem rachunku, o którym mowa w ust. 6.
11. W przypadku zlecenia od Członka Izby, który uzyskał zgodę, o której mowa w § 11 ust. 2 Regulaminu, zgoda na wypłatę wyrażana jest, pod warunkiem spełnienia kryteriów opisanych w ust. 8 lit. b), jeśli wskazany numeru rachunku, na który zostaną przekazane środki, jest numerem rachunku bankowego dedykowanego do kierowania zleceń wypłat środków pieniężnych z Rachunku rozliczeniowego Rozliczającego Członka Izby.
12. Akceptacja zleceń wypłat środków wniesionych na depozyt transakcyjny następuje w dni robocze w godz. 16:00 – 16:30, pod warunkiem przekazania do godziny 16:00, drogą poczty elektronicznej na adres mailowy Działu Rozliczeń i Rozrachunku, lub awaryjnie za pośrednictwem wiadomości SMS na telefon Operatora Działu Rozliczeń i Rozrachunku, komunikatu informującego o złożeniu zlecenia oraz po spełnieniu warunków opisanych w ust. 4-9.
13. Izba nie realizuje wypłat środków bezpośrednio pomniejszających wartości limitów deklarowanych przez Członka Izby. W celu wypłaty środków wydzielonych na potrzeby Limitu transakcyjnego dedykowanego RDB lub Limitu transakcyjnego RCG, Członek Izby zobowiązany jest zmniejszyć deklarowaną wartość limitu poprzez przesłanie odpowiedniej dyspozycji zmiany jego wysokości, a następnie złożyć dyspozycję zlecenia wypłaty, o której mowa w § 9 ust. 4.

Depozyt dostawy

§ 10

1. Rozliczający Członek Izby, zobowiązany jest do wniesienia i utrzymywania depozytu dostawy dla kontraktów terminowych na energię elektryczną i Gaz w wysokości określonej przez Izbę na dedykowanym dla niego subkoncie Rachunku depozytów transakcyjnych w BPI, z zastrzeżeniem § 5 ust. 3 i ust. 5. Dla Członków Izby prowadzących działalność na rachunek własny oraz jednocześnie działalność inną niż na rachunek własny, depozyt dostawy określany jest odrębnie dla tych rodzajów

działalności. Domy maklerskie oraz towarowe domy maklerskie, które uzyskały zgodę o której mowa w § 11 ust. 2 Regulaminu, są zwolnione z obowiązku wnoszenia depozytu dostawy w odniesieniu do działalności innej niż na rachunek własny.

2. Środki zgromadzone przez Członka Izby jako depozyt dostawy i depozyt historyczny zapewniają pokrycie zobowiązań w wypadku dokonania przez Bank Płatnik Członka Izby zastrzeżenia zlecenia płatniczego z tytułu dostawy towarów giełdowych, o którym mowa w § 55 ust. 2. Domy maklerskie oraz towarowe domy maklerskie, które uzyskały zgodę o której mowa w § 11 ust. 2 Regulaminu, są zobowiązane do kontroli i zapewnienia pokrycia zleceń na zasadach określonych w § 37 ust. 11 Regulaminu.
3. Określenie wymaganego depozytu dostawy dla kontraktów terminowych na energię elektryczną i Gaz odbywa się odrębnie dla działalności na rachunek własny oraz dla działalności innej niż na rachunek własny, prowadzonej przez Członka Izby, z wykorzystaniem następującego algorytmu:

wartość wymaganego depozytu dostawy dla każdego Rozliczającego Członka Izby na dany miesiąc równa jest podwojonej maksymalnej dziennej wartości zobowiązań powstałych w wyniku dostawy z tytułu Transakcji zawartych na Rynku Terminowym Produktów w zakresie energii elektrycznej i Gazu do dnia wyznaczenia depozytu dostawy, których dostawa realizowana będzie w trakcie tego miesiąca.

4. Wartość wymaganego depozytu dostawy jest wyznaczana w przedostatnim dniu poprzedniego miesiąca lub jeżeli dzień ten jest dniem wolnym od pracy w ostatnim dniu roboczym poprzedzającym ten dzień. W dniu wyznaczenia depozytu dostawy, nowa wymagana wartość depozytu dostawy jest podawana do wiadomości Członkom Izby.
5. Dniem regulacji przez Członków Izby wymaganego depozytu dostawy jest pierwszy dzień roboczy miesiąca. Regulacja wymaganej wartości depozytu dostawy następuje, z zastrzeżeniem § 5 ust. 3, na dedykowanych Członkom Izby subkontach Rachunku depozytów transakcyjnych w BPI, wpływając na zmniejszenie lub zwiększenie Podstawowego limitu transakcyjnego. W przypadku, gdy w wyniku aktualizacji stan środków pieniężnych na subkoncie Rachunku depozytów transakcyjnych nie jest wystarczający do pokrycia zaktualizowanej wartości depozytu dostawy, Członek Izby, z zastrzeżeniem § 5 ust. 5, wzywany jest do niezwłocznej dopłaty środków. Do momentu wniesienia wymaganych środków, Podstawowy limit transakcyjny tego Członka Izby jest równy różnicy między wartością środków zdeponowanych przez niego na subkoncie Rachunku depozytów transakcyjnych, a sumą wartości wymaganego depozytu dostawy, wymaganego depozytu historycznego oraz wartości salda zobowiązań lub należności z tytułu rozliczeń Transakcji, natomiast Limit transakcyjny dedykowany RDB oraz Limity

transakcyjne RCG są równe zero. Nieuzupełnienie przez Członka Izby środków do wymaganej wartości może stanowić dla Izby przesłankę do stwierdzenia Przypadku naruszenia w rozumieniu Regulaminu oraz podjęcia działań, o których mowa w § 54 Regulaminu.

Depozyt historyczny

§ 11

1. Rozliczający Członek Izby zobowiązany jest do wniesienia i utrzymywania określonej przez Izbę wartości depozytu historycznego na dedykowanym mu subkoncie Rachunku depozytów transakcyjnych w BPI, z zastrzeżeniem § 5 ust. 3 i ust. 5. Dla Członków Izby prowadzących działalność na rachunek własny oraz jednocześnie działalność inną niż na rachunek własny, depozyt historyczny określany jest odrębnie dla tych rodzajów działalności.
2. Wymagana wartość depozytu historycznego dla Rozliczającego Członka Izby jest wyznaczana przez Izbę codziennie zgodnie z poniższym algorytmem:

$$DH_t = \max (PF_t * pD; PF_{t-1} * pD; \dots; PF_{t-29} * pD; DH_{min})$$

gdzie:

DH_t – wartość depozytu historycznego wyznaczona w dniu t ;

PF_t – wartość płatności z tytułu Transakcji zawartych w dniu t na typach instrumentów, o których mowa w ust. 6, gdzie wartość Transakcji kupna oznacza się znakiem dodatnim, a wartość Transakcji sprzedaży oznacza się znakiem ujemnym;

pD – parametr liczby dni równy 3;

DH_{min} – minimalna wartość depozytu historycznego określona jako minimalna wartość wpłaty na depozyty transakcyjne dla RDN oraz RDB zgodnie z § 8 ust. 3.

3. Wartość wymaganego depozytu historycznego może być wniesiona w środkach pieniężnych lub w formie gwarancji bankowych, na zasadach określonych w § 33.
4. Wnoszenie przez Rozliczających Członków Izby wymaganego depozytu historycznego w środkach pieniężnych następuje, z zastrzeżeniem § 5 ust. 3, na dedykowanych Rozliczającym Członkom Izby subkontach Rachunku depozytów transakcyjnych w BPI w dniu wyznaczenia jego wartości, wpływając na wysokość Podstawowego limitu transakcyjnego na kolejną sesję.

5. W przypadku, gdy w wyniku aktualizacji stan wniesionych na poczet depozytu historycznego środków pieniężnych oraz zabezpieczeń niepieniężnych jest niewystarczający do pokrycia jego zaktualizowanej wartości, Rozliczający Członek Izby, z zastrzeżeniem § 5 ust. 5, wzywany jest do niezwłocznego wniesienia zabezpieczeń w wysokości wskazanej przez Izbę. Do momentu ich wniesienia Podstawowy limit transakcyjny tego Rozliczającego Członka Izby jest równy różnicy między wartością środków zdeponowanych przez niego na subkoncie Rachunku depozytów transakcyjnych, a sumą wartości wymaganego depozytu dostawy, wymaganego depozytu historycznego oraz wartości salda zobowiązań lub należności z tytułu rozliczeń Transakcji, natomiast Limit transakcyjny dedykowany RDB oraz Limity transakcyjne RCG są równe zero. Nieuzupełnienie przez Członka Izby zabezpieczeń do wymaganej wartości może stanowić dla Izby przesłankę do stwierdzenia Przypadku naruszenia w rozumieniu Regulaminu oraz podjęcia działań, o których mowa w § 54 Regulaminu.
6. Depozyt historyczny jest stosowany w odniesieniu do instrumentów których kod, zgodnie ze specyfikacją określoną w Szczegółowych zasadach obrotu i rozliczeń dla energii elektrycznej na Rynku Dnia Następnego opublikowanych przez Towarową Giełdę Energii S.A., zaczyna się ciągiem znaków "DAM".
7. Domy Maklerskie lub Towarowe Domy Maklerskie, które uzyskały zgodę o której mowa w § 11 ust. 2 Regulaminu, są zwolnione z obowiązku wnoszenia depozytu historycznego w odniesieniu do działalności innej niż na rachunek własny.
8. Izba każdego dnia roboczego niezwłocznie po opublikowaniu wyników notowań w systemie kursu jednolitego dla instrumentów o których mowa w ust. 6, porównuje dla każdego Członka Izby wartość płatności wynikającą z zawartych Transakcji za których rozliczenie odpowiada ten Rozliczający Członek Izby z wartością wniesionego depozytu historycznego.
9. W przypadkach, w których wynik porównania, o którym mowa w ust. 8 wskazuje na brak odpowiedniej wysokości zabezpieczeń na pokrycie depozytu historycznego, Izba niezwłocznie blokuje możliwość zawierania Transakcji przez danego Członka Izby, lub Członków Giełdy, których dany Członek Izby reprezentuje oraz może przystąpić do zamykania Pozycji wynikających z Transakcji zawartych w danym dniu na instrumentach, o których mowa w ust. 6.
10. Izba może podnieść wartość parametru liczby dni pD , o którym mowa w ust. 2. dla wszystkich lub określonych Członków Izby, którzy narażają bezpieczeństwo rozliczeń w odniesieniu do rynków objętych depozytem historycznym. Zmiana parametru dokonywana jest w drodze uchwały Zarządu IRGiT.

11. Izba może ustalić limit maksymalnej wartości Transakcji zawieranych w trakcie jednej sesji na rynkach objętych depozytem historycznym dla Członków Izby, którzy narażają bezpieczeństwo rozliczeń w odniesieniu do tych rynków. Ustanowienie limitu dokonywane jest w drodze uchwały Zarządu IRGiT.

Limit transakcyjny

§ 12

1. Limit transakcyjny wyznaczany jest z uwzględnieniem podziału na Podstawowy limit transakcyjny oraz Limit transakcyjny dedykowany RDB, oddzielnie dla:
 - a) działalności na rachunek własny,
 - b) działalności innej niż na rachunek własny,z zastrzeżeniem, że w przypadku, gdy Członek Izby pełni funkcję reprezentanta Członka Giełdy, Limit transakcyjny jest dzielony na Podstawowy limit transakcyjny, Limity transakcyjne RCG oraz Limit transakcyjny dedykowany RDB.
2. Wpłaty zasilające Limit transakcyjny mogą być wnoszone w środkach pieniężnych oraz w środkach niepieniężnych na zasadach określonych w § 28-36, z wyłączeniem deklarowanych przez Członka Izby Limitu transakcyjnego dedykowanego RDB oraz Limitu transakcyjnego RCG, dla których wpłaty zasilające mogą być wnoszone jedynie w środkach pieniężnych.
3. W dni ustawowo wolne od pracy zmiana salda na Rachunku depozytów transakcyjnych nie wpływa na wysokość Limitu transakcyjnego dla tych dni.

§ 13

1. Wartość Podstawowego limitu transakcyjnego danego Członka Izby działającego na rachunek własny oraz Członka Izby prowadzącego działalność inną niż na rachunek własny, który nie uzyskał zgody, o której mowa w § 11 ust. 2 Regulaminu, z zastrzeżeniem § 5 ust. 5, wyznacza suma środków wniesionych na depozyt transakcyjny pomniejszona o wymaganą wartość depozytu dostawy, wartość depozytu historycznego, wartość Limitu transakcyjnego dedykowanego RDB, wartość Limitów transakcyjnych RCG, oraz pomniejszona lub powiększona o saldo zobowiązań i należności z tytułu rozliczeń Transakcji zawartych przez Rozliczającego Członka Izby:
 - a) w Dniu N na RDN z dostawą w Dniu N+2,

- b) w Dniu N na RDN z dostawą w Dniu N+3 (w przypadku, gdy Dzień N przypada na czwartek),
 - c) w Dniu N na RDNg z dostawą w Dniu N+2 (w przypadku, gdy Dzień N przypada na czwartek lub piątek),
 - d) w Dniu N na RDNg z dostawą w Dniu N+3 (w przypadku, gdy Dzień N przypada na czwartek),
 - e) w Dniu N na RDBg z dostawą w Dniu N, RDNg z dostawą w Dniu N+1 i RDN z dostawą w Dniu N+1 (w przypadku, gdy Dzień N przypada na dzień wolny od pracy).
 - f) w dni poprzedzające Dzień N, jeżeli wartości wynikające z tych Transakcji nie zostały uwzględnione w Raportach kontrolnych, o których mowa w § 52, przesłanych do BPCI w ostatni dzień roboczy przed Dniem N.
2. Wartość Podstawowego limitu transakcyjnego RCG dla Członka Giełdy reprezentowanego przez Członka Izby, który nie uzyskał zgody, o której mowa w § 11 ust. 2 Regulaminu jest pomniejszana o wartość Limitu transakcyjnego RCG dedykowanego RDB oraz pomniejszana lub powiększana o saldo zobowiązań i należności z tytułu rozliczeń Transakcji zawartych przez reprezentowanego Członka Giełdy na rynkach i zgodnie z zapisami, o których mowa w ust. 1 lit. a) – f).
3. Wartość Podstawowego limitu transakcyjnego danego Rozliczającego Członka Izby, który uzyskał zgodę, o której mowa w § 11 ust. 2 Regulaminu wyznacza suma środków wniesionych na Rachunek rozliczeniowy w BPCI pomniejszona o wymaganą wartość depozytu zabezpieczającego, wartość Limitu transakcyjnego dedykowanego RDB, wartość Limitów transakcyjnych RCG oraz pomniejszona lub powiększona o saldo zobowiązań i należności Rozliczającego Członka Izby wynikających z Transakcji zawartych przez:
- a) Rozliczającego Członka Izby w Dniu N na RPM z dostawą w Dniu N (w przypadku, gdy Dzień N przypada na dzień od poniedziałku do czwartku),
 - b) Rozliczającego Członka Izby w Dniu N na RDBg z dostawą w Dniu N,
 - c) Rozliczającego Członka Izby w Dniu N na RDN z dostawą w Dniu N+1 i Dniu N+2,
 - d) Rozliczającego Członka Izby w Dniu N na RDN z dostawą w Dniu N+3 (w przypadku, gdy Dzień N przypada na czwartek),
 - e) Rozliczającego Członka Izby w Dniu N na RDNg z dostawą w Dniu N+1,
 - f) Rozliczającego Członka Izby w Dniu N na RDNg z dostawą w Dniu N+2 (w przypadku, gdy Dzień N przypada na czwartek lub piątek),

- g) Rozliczającego Członka Izby w Dniu N na RDNg z dostawą w Dniu N+3 (w przypadku, gdy Dzień N przypada na czwartek),
 - h) Rozliczającego Członka Izby i reprezentowanych przez niego Członków Giełdy na RTP z dostawą w Dniu N+1 (w przypadku, gdy Dzień N jest dniem roboczym),
 - i) Rozliczającego Członka Izby i reprezentowanych przez niego Członków Giełdy na RTP z dostawą w dniu następnym w stosunku do każdego dnia wolnego poprzedzającego Dzień N (gdzie Dzień N jest pierwszym dniem roboczym następującym po dniu wolnym).
4. Wartość Podstawowego limitu transakcyjnego RCG dla Członka Giełdy reprezentowanego przez Członka Izby, który uzyskał zgodę, o której mowa w § 11 ust. 2 Regulaminu jest pomniejszana o wartość Limitu transakcyjnego RCG dedykowanego RDB oraz pomniejszana lub powiększana o saldo zobowiązań i należności wynikających z zawartych Transakcji przez reprezentowanego Członka Giełdy na rynkach i zgodnie z zapisami, o których mowa w ust. 3 lit a) – g).
5. Członek Izby prowadzący działalność jako reprezentant Członka Giełdy definiuje wartość Limitu transakcyjnego RCG dla każdego reprezentowanego Członka Giełdy, poprzez przesłanie w dni robocze do godziny 11:00 pocztą elektroniczną, na wskazany na stronie internetowej IRGiT adres Działu Rozliczeń i Rozrachunku oraz Działu Zarządzania Ryzykiem, deklaracji wraz ze wskazaniem wartości limitu na formularzu, zgodnym ze wzorem stanowiącym załącznik nr 3b do niniejszych Szczegółowych Zasad Rozliczeń.
6. W przypadku, gdy dyspozycja, o której mowa w ust. 5 zostanie przekazana do Izby do godziny 11:00 w bieżącym roboczym dniu, zaktualizowana wartość limitów obowiązywać będzie pod warunkiem jej akceptacji przez Izbę po udostępnieniu raportu, o którym mowa w § 44 ust. 4, o ile:
- a) kwota zwiększenia wartości Limitu transakcyjnego RCG jest niższa niż wolne środki pieniężne na Podstawowym limicie transakcyjnym określonym dla tego Członka Izby;
 - b) kwota zmniejszenia wartości Limitu transakcyjnego RCG jest mniejsza lub równa wartości Podstawowego limitu transakcyjnego RCG
7. W przypadku, gdy dyspozycja deklaracji Limitu transakcyjnego RCG zostanie przekazana do Izby po godzinie 11:00 dnia bieżącego, zaktualizowana wartość tych limitów obowiązywać będzie na zasadach określonych w ust. 6 w następnym dniu roboczym.
8. W przypadku, gdy na skutek rozliczenia Transakcji lub aktualizacji depozytów Podstawowy limit transakcyjny danego Członka Izby przyjmuje wartość mniejszą niż

zero, Izba pokrywa ujemną wartość tego limitu zmniejszając odpowiednio i w następującej kolejności:

- a) Podstawowe limity transakcyjne RCG Członków Giełdy, których reprezentuje;
- b) Limity transakcyjne RCG dedykowane RDB Członków Giełdy, których reprezentuje;
- c) Limit transakcyjny dedykowany RDB danego Członka Izby.

Jeżeli środki definiujące wartość limitów, o których mowa w lit. a) – c) są niewystarczające do pokrycia ujemnej wartości Podstawowego limitu transakcyjnego Członka Izby, Izba wzywa Członka Izby do niezwłocznej wpłaty uzupełniającej depozyt transakcyjny.

§ 14

1. Członek Izby definiuje wartość Limitu transakcyjnego dedykowanego RDB, jak również wartość Limitu transakcyjnego RCG dedykowanego RDB, poprzez przesłanie pocztą elektroniczną na wskazany na stronie internetowej IRGiT adres Działu Rozliczeń i Rozrachunku oraz Działu Zarządzania Ryzykiem deklaracji wraz ze wskazaniem wartości tych limitów w złotych polskich na formularzu, zgodnie ze wzorem stanowiącym Załącznik nr 3a do niniejszych Szczegółowych Zasad Rozliczeń.
2. W przypadku, gdy dyspozycja, o której mowa w ust. 1 zostanie przekazana do Izby do godziny 11:00 w bieżącym dniu roboczym, zaktualizowana wartość limitów obowiązywać będzie pod warunkiem akceptacji przez Izbę:
 - a) począwszy od godziny 14:00 tego dnia:
 - 1) w przypadku obniżenia wartości Limitu transakcyjnego dedykowanego RDB lub Limitu transakcyjnego RCG dedykowanego RDB o ile wartość nowego limitu jest wyższa niż wysokość zobowiązań wynikających z Transakcji zawartych na RDB odpowiednio przez tego Członka Izby lub reprezentowanego Członka Giełdy;
 - 2) w przypadku zwiększenia wartości Limitu transakcyjnego dedykowanego RDB dla Rozliczającego Członka Izby, który uzyskał zgodę o której mowa w § 11 ust. 2 Regulaminu lub zwiększenia wartości Limitu transakcyjnego RCG dedykowanego RDB dla Członka Giełdy, dla którego pełni on funkcję reprezentanta;
 - 3) w przypadku zwiększenia wartości Limitu transakcyjnego dedykowanego RDB dla Rozliczającego Członka Izby działającego na rachunek własny oraz Rozliczającego Członka Izby prowadzącego działalność inną niż na rachunek własny, który nie uzyskał zgody o której mowa w § 11 ust. 2 Regulaminu lub zwiększenia wartości Limitu transakcyjnego RCG dedykowanego RDB dla Członka Giełdy, dla którego pełni on funkcję reprezentanta, o ile dokonał on wpłaty na subkonto Rachunku

depozytów transakcyjnych w odpowiedniej wysokości i wpłata ta została zaksięgowana na rachunku do godziny 12:00 w danym dniu. Postanowień niniejszego punktu nie stosuje się w przypadku, o którym mowa w § 5 ust. 5;

- b) po udostępnieniu raportu, o którym mowa w § 44 ust. 4 - dla Rozliczającego Członka Izby działającego na rachunek własny oraz Rozliczającego Członka Izby prowadzącego działalność inną niż na rachunek własny, który nie uzyskał zgody o której mowa w § 11 ust. 2 Regulaminu lub dla Członka Giełdy, dla którego pełni on funkcję reprezentanta, jeżeli nie dokonał on wpłaty na subkonto Rachunku depozytów transakcyjnych, o ile kwota zwiększenia wartości Limitu transakcyjnego dedykowanego RDB lub Limitu transakcyjnego RCG dedykowanego RDB jest niższa niż wolne środki pieniężne odpowiednio na Podstawowym limicie transakcyjnym określonym dla tego Członka Izby lub Podstawowym limicie transakcyjnym RCG określonym dla reprezentowanego Członka Giełdy.
3. W przypadku, gdy dyspozycja aktualizacji Limitu transakcyjnego dedykowanego RDB lub Limitu transakcyjnego RCG dedykowanego RDB zostanie przekazana do Izby po godzinie 11:00 dnia bieżącego, zaktualizowana wartość tych limitów obowiązywać będzie na zasadach określonych w ust. 2 w następnym dniu roboczym.
4. Wartość Limitu transakcyjnego dedykowanego RDB lub Limitu transakcyjnego RCG dedykowanego RDB jest wyznaczana na podstawie wartości zdefiniowanej przez Rozliczającego Członka Izby na zasadach określonych w ust. 1 - 3 oraz z uwzględnieniem salda zobowiązań i należności wynikających z Transakcji zawartych odpowiednio przez tego Członka Izby lub reprezentowanego przez niego Członka Giełdy, na zasadach określonych w ust. 5 - 8 poniżej.
5. W dni robocze, z zastrzeżeniem ust. 6, wartość Limitu transakcyjnego dedykowanego RDB zdefiniowana przez Rozliczającego Członka Izby działającego na rachunek własny oraz Rozliczającego Członka Izby prowadzącego działalność inną niż na rachunek własny, który nie uzyskał zgody o której mowa w § 11 ust. 2 Regulaminu lub Limitu transakcyjnego RCG dedykowanego RDB dla Członka Giełdy, dla którego pełni on funkcję reprezentanta, jest pomniejszana o:
- a) saldo zobowiązań i należności z tytułu Transakcji zawartych odpowiednio przez tego Członka Izby lub reprezentowanego Członka Giełdy na RDB z dostawą w Dniu N - 1,
- b) saldo zobowiązań i należności z tytułu Transakcji zawartych odpowiednio przez tego Członka Izby lub reprezentowanego Członka Giełdy na RDB z dostawą w Dniu N (w przypadku, gdy Transakcje zostały zawarte do godziny 13:00 w Dniu N),
- z zastrzeżeniem, iż w przypadku, gdy salda Transakcji, o których mowa w lit. a) i b) są dodatnie, nie wpływają one na wysokość tych limitów.

6. W pierwszy dzień roboczy następujący po dniach wolnych, wartość Limitu transakcyjnego dedykowanego RDB zdefiniowana przez Rozliczającego Członka Izby działającego na rachunek własny oraz Rozliczającego Członka Izby prowadzącego działalność inną niż na rachunek własny, który nie uzyskał zgody o której mowa w § 11 ust. 2 Regulaminu lub Limitu transakcyjnego RCG dedykowanego RDB dla Członka Giełdy, dla którego pełni funkcję reprezentanta, jest pomniejszana o:

- a) saldo zobowiązań i należności z tytułu Transakcji zawartych odpowiednio przez tego Członka Izby lub reprezentowanego Członka Giełdy na RDB z dostawą w Dniu N - 1 w stosunku do każdego dnia wolnego poprzedzającego ten dzień roboczy oraz z dostawą w Dniu N - 1 w stosunku do tego dnia roboczego,
- b) saldo zobowiązań i należności z tytułu Transakcji zawartych odpowiednio przez tego Członka Izby lub reprezentowanego Członka Giełdy na RDB z dostawą w pierwszy dzień roboczy po dniach wolnych (w przypadku, gdy Transakcje zostały zawarte do godziny 13:00 w tym dniu roboczym),

z zastrzeżeniem, iż w przypadku, gdy salda Transakcji, o których mowa w lit. a) i b) powyżej są dodatnie, nie wpływają one na wysokość tych limitów.

7. W dni wolne od pracy, wartość Limitu transakcyjnego dedykowanego RDB zdefiniowana przez Rozliczającego Członka Izby działającego na rachunek własny oraz Rozliczającego Członka Izby prowadzącego działalność inną niż na rachunek własny, który nie uzyskał zgody o której mowa w § 11 ust. 2 Regulaminu lub Limitu transakcyjnego RCG dedykowanego RDB dla Członka Giełdy, dla którego pełni on funkcję reprezentanta jest pomniejszana o:

- a) saldo zobowiązań i należności z tytułu Transakcji zawartych odpowiednio przez tego Członka Izby lub reprezentowanego Członka Giełdy na RDB z dostawą w przedostatnim dniu roboczym przed dniem wolnym,
- b) saldo zobowiązań i należności z tytułu Transakcji zawartych odpowiednio przez tego Członka Izby lub reprezentowanego Członka Giełdy na RDB z dostawą w Dniu N - 1 w stosunku do każdego dnia wolnego oraz z dostawą w bieżącym dniu wolnym (w przypadku, gdy Transakcje zostały zawarte do godziny 13:00 w dniu bieżącym).

z zastrzeżeniem, iż w przypadku, gdy salda Transakcji, o których mowa w lit. a) i b) powyżej są dodatnie, nie wpływają one na wysokość tych limitów.

8. W dni robocze, z zastrzeżeniem ust. 9, wartość Limitu transakcyjnego dedykowanego RDB zdefiniowana przez Rozliczającego Członka Izby, który uzyskał zgodę, o której mowa w § 11 ust. 2 Regulaminu lub Limitu transakcyjnego RCG dedykowanego RDB dla Członka Giełdy, dla którego pełni on funkcję reprezentanta, jest pomniejszana lub

powiększana o saldo zobowiązań i należności z tytułu Transakcji zawartych odpowiednio przez tego Członka Izby lub reprezentowanego Członka Giełdy na RDB:

a) z dostawą w Dniu N - 1,

b) z dostawą w Dniu N (w przypadku, gdy Transakcje zostały zawarte do godziny 13:00 w Dniu N).

9. W pierwszy dzień roboczy następujący po dniach wolnych, wartość Limitu transakcyjnego dedykowanego RDB zdefiniowana przez Rozliczającego Członka Izby działającego na rachunek własny oraz Rozliczającego Członka Izby, który uzyskał zgodę, o której mowa w § 11 ust. 2 Regulaminu lub zdefiniowana wartość Limitu transakcyjnego RCG dedykowanego RDB dla Członka Giełdy, dla którego pełni funkcję reprezentanta, jest pomniejszana lub powiększana o saldo zobowiązań i należności z tytułu Transakcji zawartych odpowiednio przez tego Członka Izby lub reprezentowanego Członka Giełdy na RDB:

a) z dostawą w Dniu N - 1 w stosunku do każdego dnia wolnego poprzedzającego ten dzień roboczy,

b) z dostawą w Dniu N - 1 w stosunku do tego dnia roboczego,

c) z dostawą w pierwszy dzień roboczy po dniach wolnych (w przypadku, gdy Transakcje zostały zawarte do godziny 13:00 w tym dniu roboczym).

10. W dni wolne od pracy wartość Limitu transakcyjnego dedykowanego RDB zdefiniowana przez Rozliczającego Członka Izby, który uzyskał zgodę, o której mowa w § 11 ust. 2 Regulaminu lub zdefiniowana wartość Limitu transakcyjnego RCG dla Członka Giełdy, dla którego pełni on funkcję reprezentanta jest pomniejszana lub powiększana o saldo zobowiązań i należności z tytułu Transakcji zawartych na RDB odpowiednio przez tego Członka Izby lub reprezentowanego Członka Giełdy:

a) z dostawą w przedostatnim dniu roboczym przed dniem wolnym,

b) z dostawą w Dniu N - 1 w stosunku do każdego dnia wolnego,

c) z dostawą w bieżącym dniu wolnym (w przypadku, gdy Transakcje zostały zawarte do godziny 13:00 w dniu bieżącym).

11. W przypadku, gdy na skutek rozliczenia Transakcji, zawartych przez Członka Izby, Limit transakcyjny dedykowany RDB przyjmuje wartość mniejszą niż zero, Izba pokrywa ujemną wartość tego limitu zmniejszając odpowiednio i w następującej kolejności:

a) Podstawowy limit transakcyjny tego Członka Izby;

b) Podstawowe limity transakcyjne RCG Członków Giełdy, których reprezentuje;

c) Limity transakcyjne RCG dedykowane RDB Członków Giełdy, których reprezentuje.

Jeżeli środki definiujące wartość limitów, o których mowa w lit. a) – c) są niewystarczające do pokrycia ujemnej wartości Limitu transakcyjnego dedykowanego RDB, Izba wzywa Członka Izby do niezwłocznej wpłaty uzupełniającej depozyt transakcyjny.

12. W przypadku, gdy na skutek rozliczenia Transakcji, zawartych przez Członka Giełdy reprezentowanego przez Członka Izby, Limit transakcyjny RCG dedykowany RDB przyjmuje wartość mniejszą niż zero, Izba pokrywa ujemną wartość tego limitu zmniejszając odpowiednio i w następującej kolejności:

- a) Podstawowy limit transakcyjny RCG tego Członka Giełdy;
- b) Podstawowy limit transakcyjny Członka Izby, który reprezentuje tego Członka Giełdy;
- c) Limit transakcyjny dedykowany RDB Członka Izby, który reprezentuje tego Członka Giełdy
- d) Podstawowe limity transakcyjne RCG pozostałych Członków Giełdy, którzy są reprezentowani przez danego Członka Izby;
- e) Limity transakcyjne RCG dedykowane RDB pozostałych Członków Giełdy, którzy są reprezentowani przez danego Członka Izby.

Jeżeli środki definiujące wartość limitów, o których mowa w lit. a) – e) są niewystarczające do pokrycia ujemnej wartości Limitu transakcyjnego RCG dedykowanego RDB, Izba wzywa Członka Izby, który pełni funkcję reprezentanta Członka Giełdy do niezwłocznej wpłaty uzupełniającej depozyt transakcyjny.

§ 15

1. Izba przekazuje do Giełdy wysokość Limitu transakcyjnego wyznaczonego dla danego Członka Izby z uwzględnieniem podziału na Podstawowy limit transakcyjny i Limit transakcyjny dedykowany RDB, oraz wysokość Limitów transakcyjnych RCG dla poszczególnych Członków Giełdy reprezentowanych przez danego Członka Izby z uwzględnieniem podziału na Podstawowy limit transakcyjny RCG i Limit transakcyjny RCG dedykowany RDB.
2. Wysokość przekazywanego do Giełdy Podstawowego limitu transakcyjnego i Podstawowego limitu transakcyjnego RCG jest wyznaczana na zasadach określonych w § 13 i przekazywana przez Izbę w polskich złotych.
3. Wartość Limitu transakcyjnego dedykowanego RDB i Limitu transakcyjnego RCG dedykowanego RDB wyznaczana jest przez Izbę na zasadach określonych w § 14 w polskich złotych, a następnie przeliczana jest na euro po wyższym z kursów określonych

jako Kurs średni euro wyznaczony dla dnia bieżącego i Kurs średni euro wyznaczony dla roboczego dnia poprzedzającego dzień bieżący. Jeżeli dzień bieżący przypada na dzień ustawowo wolny od pracy wartość tych limitów przeliczana jest po Kursie średnim euro wyznaczonym dla ostatniego dnia roboczego poprzedzającego dzień bieżący.

Depozyty zabezpieczające dla RTP

§ 16

1. Wartość depozytu zabezpieczającego naliczana jest codziennie dla każdego Członka Izby.
2. Wartości depozytów zabezpieczających dla Członka Izby rejestrowane są na subkontach depozytów wstępnych i depozytów uzupełniających prowadzonych w ramach konta rozliczeniowego.
3. Jeżeli Członek Izby rozlicza inne podmioty to wartość depozytu zabezpieczającego naliczana jest odrębnie dla każdego klienta tego Członka Izby, każdego reprezentowanego Członka Giełdy oraz dla Pozycji własnych Rozliczającego Członka Izby.
4. W celu określenia wartości depozytów zabezpieczających (wstępnych oraz uzupełniających), o których mowa w § 39 Regulaminu, Pozycje w kontraktach terminowych na energię elektryczną lub Gaz zajmowane przez danego Członka Izby oraz jego klientów lub reprezentowanych Członków Giełdy umieszczane są w koszykach uformowanych według okresów dostawy z uwzględnieniem kompensacji Pozycji w ramach tych okresów dostawy.

§ 17

1. Depozyty wstępne dla kontraktów terminowych na energię elektryczną, wyznaczone w Dniu N, obejmują wszystkie Dni Dostawy, począwszy od Dnia N+1 dla kontraktów, które zostały zawarte do Dnia N włącznie.
2. Depozyty wstępne dla kontraktów terminowych na energię elektryczną naliczane są wg poniższego algorytmu:

$$Dw_e = - \sum_{i=1}^N (|LK_i - LS_i| * P_i * Kr_i - NW_MP_i)$$

gdzie:

Dw_e – wartość depozytu wstępnego [zł],

- LK_i – ilość niedostarczonej energii przypadającej na kontrakty terminowe kupna dla i – tego okresu dostawy [MWh],
- LS_i – ilość niedostarczonej energii przypadającej na kontrakty terminowe sprzedaży dla i - tego okresu dostawy [MWh],
- Kr_i – kurs rozliczeniowy dla i – tego okresu dostawy [zł/MWh],
- i – okres dostawy,
- P_i – średnia arytmetyczna parametrów ryzyka przypisanych do wszystkich dni i – tego okresu dostawy,
- N – liczba okresów dostawy kontraktów terminowych,
- NW_MP_i – wartość kompensacji międzyproduktowej dla i -tego okresu dostawy, kalkulowana zgodnie z zasadami opisanymi w § 17a.

§ 17a

1. Dla każdego z okresów dostawy i utworzonych na każdym z rozliczanych typów kontraktów terminowych na RTPE (BASE, PEAK5, OFFPEAK), kalkulowana jest pozycja netto w okresie dostawy. Pozycja netto w okresie dostawy dla kontraktów terminowych typu BASE kalkulowana jest jako:

$$BASE_i = (BASE_K_i - BASE_S_i)$$

gdzie:

- $BASE_i$ – pozycja netto w kontraktach terminowych typu BASE przypadających na i -ty okres dostawy [MWh],
- $BASE_K_i$ – ilość zawartych kontraktów terminowych kupna produktu BASE przypadających na i -ty okres dostawy [MWh],
- $BASE_S_i$ – ilość zawartych kontraktów terminowych sprzedaży produktu BASE przypadających na i -ty okres dostawy [MWh].

Kalkulacja pozycji netto w kontraktach terminowych typu PEAK5 i OFFPEAK dokonywana jest w sposób analogiczny.

2. Dla każdego okresu dostawy i w ramach kontraktów terminowych typu BASE określa się odpowiadające okresy dostawy i w kontraktach terminowych typu PEAK5 oraz OFFPEAK. Odpowiadające okresy dostawy, to okresy których początek przypada nie później niż początek okresu dostawy i w ramach kontraktu terminowego typu BASE, a koniec przypada nie później niż koniec okresu dostawy i w ramach kontraktu terminowego typu BASE.
3. W przypadku, w którym dla kontraktu terminowego typu PEAK5 odpowiadający okres dostawy i nie istnieje, przyjmuje się że pozycja netto w kontraktach terminowych typu PEAK5 w odpowiadającym okresie dostawy i wynosi 0.

4. Na potrzeby kalkulacji kompensacji międzyproduktowej na RTPE, pozycja netto w kontraktach terminowych typu BASE przypadających na dany okres dostawy i , dekomponowana jest na syntetyczne pozycje w kontraktach terminowych typu PEAK5 i OFFPEAK w odpowiadających okresach dostawy i :

$$PEAK5'_i = BASE_i + PEAK5_i$$

$$OFFPEAK'_i = BASE_i + OFFPEAK_i$$

gdzie:

$PEAK5'_i$ – syntetyczna pozycja w kontraktach terminowych typu PEAK5 przypadających na odpowiadający okres dostawy i [MWh],

$OFFPEAK'_i$ – syntetyczna pozycja w kontraktach terminowych typu OFFPEAK przypadających na odpowiadający okres dostawy i [MWh],

$BASE_i$ – pozycja netto w kontraktach terminowych typu BASE przypadających na okres dostawy i [MWh],

$PEAK5_i$ – pozycja netto w kontraktach terminowych typu PEAK5 przypadających na odpowiadający okres dostawy i [MWh],

$OFFPEAK_i$ – pozycja netto w kontraktach terminowych typu OFFPEAK przypadających na odpowiadający okres dostawy i [MWh].

5. Poprzez okres dostawy w kontraktach terminowych typu OFFPEAK oraz PEAK5 odpowiadający okresowi dostawy w kontrakcie terminowym typu BASE, o którym mowa w ust. 4 powyżej, rozumie się okres dostawy, dla którego początek przypada nie wcześniej aniżeli początek okresu dostawy w kontrakcie terminowym typu BASE, a koniec przypada nie później aniżeli koniec okresu dostawy w kontrakcie terminowym typu BASE. W przypadku, gdy brak jest okresu spełniającego powyższą definicję odpowiadającego okresu dostawy w ramach danego typu kontraktów terminowych, przyjmuje się, że pozycja netto wykorzystywana do dalszych analiz w miejsce pozycji netto dla odpowiadającego okresu dostawy, każdorazowo równa jest 0.

6. Dla każdego z okresów dostawy i określa się syntetyczną pozycję netto w kontrakcie terminowym typu BASE ($BASE'_i$) po kompensacji, zgodnie z poniższymi zasadami:

- a) w przypadku braku odpowiadającego okresu dostawy i w kontrakcie terminowym typu PEAK5:

$$BASE'_i = OFFPEAK'_i$$

- b) w przypadku posiadania w okresie dostawy i pozycji długiej zarówno w $PEAK5'_i$, jak i w $OFFPEAK'_i$, syntetyczną pozycję netto w kontrakcie terminowym typu BASE wyznacza się wg. wzoru:

$$BASE'_i = MIN(PEAK5'_i; OFFPEAK'_i)$$

- c) w przypadku posiadania pozycji krótkiej zarówno w $PEAK5'_i$, jak i w $OFFPEAK'_i$, syntetyczną pozycję netto w kontrakcie terminowym typu BASE wyznacza się wg. wzoru:

$$BASE'_i = MAX(PEAK5'_i; OFFPEAK'_i)$$

- d) we wszystkich pozostałych przypadkach:

$$BASE'_i = 0$$

gdzie:

$BASE'_i$ - syntetyczna pozycja netto po kompensacji międzyproduktowej w kontraktach terminowych typu BASE przypadających na okres dostawy i [MWh],

$PEAK5'_i$ - syntetyczna pozycja w kontraktach terminowych typu PEAK5 przypadających na odpowiadający okres dostawy i [MWh],

$OFFPEAK'_i$ - syntetyczna pozycja w kontraktach terminowych typu OFFPEAK przypadających na odpowiadający okres dostawy i [MWh].

7. Dla każdego z okresów dostawy i określa się liczbę kontraktów terminowych odpowiadającą syntetycznym pozycjom netto w kontraktach terminowych typu PEAK5 i OFFPEAK przypadających na dany okres dostawy i po kompensacji, według wzoru:

$$PEAK5''_i = PEAK5'_i - BASE'_i$$

$$OFFPEAK''_i = OFFPEAK'_i - BASE'_i$$

gdzie:

$BASE'_i$ - syntetyczna pozycja netto po kompensacji międzyproduktowej w kontraktach terminowych typu BASE przypadających na okres dostawy i [MWh],

$PEAK5''_i$ - syntetyczna pozycja netto po kompensacji międzyproduktowej w kontraktach terminowych typu PEAK5, przypadających na odpowiadający okres dostawy i [MWh],

$OFFPEAK''_i$ - syntetyczna pozycja netto po kompensacji międzyproduktowej w kontraktach terminowych typu OFFPEAK, przypadających na odpowiadający okres dostawy i [MWh].

8. Dla każdego z okresów dostawy i wartość kompensacji międzyproduktowej depozytu wstępnego wyznaczana jest z wykorzystaniem wzorów:

$$NW_MP_{BASE_i} = (|BASE_i| - |BASE'_i|) \cdot P_{BASE_i} \cdot Kr_{BASE_i} \cdot U_{MP}$$

$$NW_MP_{PEAK5_i} = (|PEAK5_i| - |PEAK5''_i|) \cdot P_{PEAK5_i} \cdot Kr_{PEAK5_i} \cdot U_{MP}$$

$$NW_MP_{OFFPEAK_i} = (|OFFPEAK_i| - |OFFPEAK''_i|) \cdot P_{OFFPEAK_i} \cdot Kr_{OFFPEAK_i} \cdot U_{MP}$$

gdzie:

NW_MP_i – potencjalna zmiana poziomu wymaganego depozytu wstępnego dla kontraktów terminowych typu BASE, PEAK oraz OFFPEAK przypadających na okres dostawy i , wynikająca z różnicy pomiędzy wolumenem pozycji netto, a wolumenem syntetycznej pozycji netto [PLN],

$P_{BASE_i}, P_{PEAK5_i}, P_{OFFPEAK_i}$ – średnia arytmetyczna publikowanych przez IRGiT parametrów ryzyka odpowiednio dla kontraktów terminowych typu BASE, PEAK5 oraz OFFPEAK przypisanych do wszystkich dni w okresie dostawy i ,

$Kr_{BASE_i}, Kr_{PEAK5_i}, Kr_{OFFPEAK_i}$ – kurs rozliczeniowy wyznaczony przez IRGiT, przypisany odpowiednio do kontraktu terminowego typu BASE, PEAK5 oraz OFFPEAK w okresie dostawy i [PLN/MWh],

U_{MP} – parametr uznania kompensacji międzyproduktowej, publikowany przez IRGiT.

9. Parametr uznania kompensacji międzyproduktowej publikowany jest w komunikacie Dyrektora Działu Zarządzania Ryzykiem oraz udostępniany na stronie internetowej IRGiT.

§ 18

1. Depozyty wstępne dla kontraktów terminowych na Gaz wyznaczone w Dniu N obejmują wszystkie Dni Dostawy począwszy od Dnia N+1 dla kontraktów terminowych, które zostały zawarte do Dnia N włącznie.
2. Depozyty wstępne dla kontraktów terminowych na Gaz naliczane są wg poniższego algorytmu:

$$Dw_g = - \sum_{i=1}^N |LK_i - LS_i| * P_i * Kr_i$$

gdzie:

Dw_g – wartość depozytu wstępnego [zł],

LK – ilość niedostarczonego Gazu przypadającego na kontrakty terminowe kupna dla i – tego okresu dostawy [MWh],

- LS_i – ilość niedostarczonego Gazu przypadającego na kontrakty terminowe sprzedaży dla i - tego okresu dostawy [MWh],
- Kr_i – kurs rozliczeniowy dla i – tego okresu dostawy wyznaczony przez IRGiT, [zł/MWh],
- i – okres dostawy,
- P_i – średnia arytmetyczna parametrów ryzyka przypisanych do wszystkich dni i – tego okresu dostawy,
- N – liczba okresów dostawy kontraktów terminowych.

§ 19

1. Depozyty uzupełniające dla kontraktów terminowych na energię elektryczną wyznaczone w Dniu N obejmują wszystkie Dni Dostawy począwszy od Dnia $N+1$ dla kontraktów terminowych, które zostały zawarte do Dnia N włącznie.
2. Depozyty uzupełniające dla kontraktów terminowych na energię elektryczną naliczane są wg następującego algorytmu:

$$Du_e = \sum_{i=1}^N (LK_i * (Kr_i - Kk_i) + LS_i * (Ks_i - Kr_i)) * (1 + VAT)$$

gdzie:

- Du_e – wartość depozytu uzupełniającego,
- LK_i – ilość niedostarczonej energii przypadającej na kontrakty terminowe kupna dla i - tego okresu dostawy [MWh],
- LS_i – ilość niedostarczonej energii przypadającej na kontrakty terminowe sprzedaży dla i - tego okresu dostawy [MWh],
- Kr_i – kurs rozliczeniowy dla i – tego okresu dostawy wyznaczony przez IRGiT, [zł/MWh],
- Kk_i – średni ważony kurs Transakcji kupna kontraktów terminowych dla i – tego okresu dostawy [zł/MWh],
- Ks_i – średni ważony kurs Transakcji sprzedaży kontraktów terminowych dla i – tego okresu dostawy [zł/MWh],
- i – okres dostawy,
- N – liczba okresów dostawy kontraktów terminowych,
- VAT – wartość obowiązującej stawki podstawowej podatku VAT.

§ 20

1. Depozyty uzupełniające dla kontraktów terminowych na Gaz wyznaczone w Dniu N obejmują wszystkie Dni Dostawy począwszy od Dnia N+1 dla kontraktów terminowych, które zostały zawarte do Dnia N włącznie.
2. Depozyty uzupełniające dla kontraktów terminowych na Gaz naliczane są wg następującego algorytmu:

$$Du_g = \sum_{i=1}^N (LK_i * (Kr_i - Kk_i) + LS_i * (Ks_i - Kr_i)) * (1 + VAT)$$

gdzie:

- Du_g – wartość depozytu uzupełniającego,
- LK_i – ilość niedostarczonego Gazu przypadającego na kontrakty terminowe kupna dla i - tego okresu dostawy [MWh],
- LS_i – ilość niedostarczonego Gazu przypadającego na kontrakty terminowe sprzedaży dla i - tego okresu dostawy [MWh],
- Kr_i – kurs rozliczeniowy dla i – tego okresu dostawy wyznaczony przez IRGiT, [zł/MWh],
- Kk_i – średni ważony kurs Transakcji kupna kontraktów terminowych dla i – tego okresu dostawy [zł/MWh],
- Ks_i – średni ważony kurs Transakcji sprzedaży kontraktów terminowych dla i – tego okresu dostawy [zł/MWh],
- i – okres dostawy,
- N - liczba okresów dostawy kontraktów terminowych,
- VAT – wartość obowiązującej stawki podstawowej podatku VAT.

§ 21

1. Jeżeli Członek Izby rozlicza wyłącznie własne Transakcje, to wartość depozytu zabezpieczającego wyliczana jest według następującego wzoru:

$$Dz = \min (Dw_e + Du_e + Dw_g + Du_g; 0)$$

gdzie:

Dz – całkowity depozyt zabezpieczający,

Dw_e – depozyt wstępny dla kontraktów terminowych na energię elektryczną,

Du_e – depozyt uzupełniający dla kontraktów terminowych na energię elektryczną,

Dw_g – depozyt wstępny dla kontraktów terminowych na Gaz,

Du_g – depozyt uzupełniający dla kontraktów terminowych na Gaz.

2. W przypadku, gdy Członek Izby rozlicza Transakcje swoich klientów lub reprezentowanych Członków Giełdy, to zasada przedstawiona w ust. 1 obowiązuje na poziomie poszczególnych klientów lub reprezentowanych Członków Giełdy, a całkowity depozyt zabezpieczający liczony dla tego Członka Izby jest równy sumie depozytów zabezpieczających naliczonych dla poszczególnych: klientów, reprezentowanych Członków Giełdy i Pozycji własnych Członka Izby.

§ 22

1. Depozyt wstępny dla kontraktów terminowych na energię elektryczną obliczany jest osobno dla każdego okresu dostawy. Za okres dostawy przyjmuje się jeden dzień, jeżeli dostawa nastąpi w okresie od Dnia N+1 do:
 - a) 16 dni, gdy dniem naliczania depozytu jest piątek,
 - b) 15 dni, gdy dniem naliczania depozytu jest sobota,
 - c) 14 dni, gdy dniem naliczania depozytu jest niedziela,
 - d) 13 dni, gdy dniem naliczania depozytu jest poniedziałek,
 - e) 12 dni, gdy dniem naliczania depozytu jest wtorek,
 - f) 11 dni, gdy dniem naliczania depozytu jest środa,
 - g) 10 dni, gdy dniem naliczania depozytu jest czwartek.
2. Dla kolejnych dni tworzy się tygodniowe okresy dostawy pokrywające się z terminami wykonania kontraktów terminowych tygodniowych będących w notowaniu.

3. Dni, które zawierają się w kontrakcie terminowym tygodniowym obejmującym przełom dwóch miesięcy rozbijane są na dwa koszyki: do pierwszego zaliczają się dni z kończącego się miesiąca, a do drugiego z miesiąca rozpoczynającego się.
4. Jeśli okres dostawy ostatniego z notowanych kontraktów terminowych tygodniowych nie kończy się w ostatnim dniu miesiąca to tworzy się koszyk z dni począwszy od dnia, który jest pierwszym następującym po ostatnim Dniu Dostawy ostatniego notowanego kontraktu tygodniowego aż do ostatniego dnia tego miesiąca.
5. Kolejne okresy dostawy tworzone są dla dni, które pokrywają się w całości z notowanymi kontraktami terminowymi miesięcznymi i tworzą koszyki miesięczne.
6. Jeśli okres dostawy ostatniego z notowanych kontraktów terminowych miesięcznych nie kończy się w ostatnim dniu kwartału to tworzy się koszyk z dni począwszy od dnia, który jest pierwszym następującym po ostatnim Dniu Dostawy ostatniego notowanego kontraktu terminowego miesięcznego aż do ostatniego dnia tego kwartału.
7. Kolejne dni, których nie obejmują okresy dostawy notowanych kontraktów terminowych miesięcznych grupuje się w koszyki kwartalne.
8. Jeśli okres dostawy ostatniego z notowanych kontraktów terminowych kwartalnych nie kończy się w ostatnim dniu roku to tworzy się koszyk z dni począwszy od dnia, który jest pierwszym następującym po ostatnim Dniu Dostawy ostatniego notowanego kontraktu terminowego kwartalnego aż do ostatniego dnia roku.
9. Kolejne dni, których nie obejmują okresy dostawy notowanych kontraktów terminowych kwartalnych grupuje się w koszyki roczne.

§ 23

1. Depozyt wstępny dla kontraktów terminowych na Gaz obliczany jest osobno dla każdego okresu dostawy. Za okres dostawy przyjmuje się jeden dzień, jeżeli dostawa nastąpi w okresie od Dnia N+1 do:
 - a) 16 dni, gdy dniem naliczania depozytu jest piątek,
 - b) 15 dni, gdy dniem naliczania depozytu jest sobota,
 - c) 14 dni, gdy dniem naliczania depozytu jest niedziela,
 - d) 13 dni, gdy dniem naliczania depozytu jest poniedziałek,
 - e) 12 dni, gdy dniem naliczania depozytu jest wtorek,
 - f) 11 dni, gdy dniem naliczania depozytu jest środa,

- g) 10 dni, gdy dniem naliczania depozytu jest czwartek.
2. Dla kolejnych dni tworzy się tygodniowe okresy dostawy pokrywające się z terminami wykonania kontraktów terminowych tygodniowych będących w notowaniu.
 3. Dni, które zawierają się w kontrakcie terminowym tygodniowym obejmującym przełom dwóch miesięcy rozbijane są na dwa koszyki: do pierwszego zaliczają się dni z kończącego się miesiąca, a do drugiego z miesiąca rozpoczynającego się.
 4. Jeśli okres dostawy ostatniego z notowanych kontraktów terminowych tygodniowych nie kończy się w ostatnim dniu miesiąca to tworzy się koszyk z dni począwszy od dnia, który jest pierwszym następującym po ostatnim Dniu Dostawy ostatniego notowanego kontraktu terminowego tygodniowego aż do ostatniego dnia tego miesiąca.
 5. Kolejne okresy dostawy tworzone są dla dni, które pokrywają się w całości z notowanymi kontraktami terminowymi miesięcznymi i tworzą koszyki miesięczne.
 6. Jeśli okres dostawy ostatniego z notowanych kontraktów terminowych miesięcznych nie kończy się w ostatnim dniu kwartału to tworzy się koszyk z dni począwszy od dnia, który jest pierwszym następującym po ostatnim Dniu Dostawy ostatniego notowanego kontraktu terminowego miesięcznego aż do ostatniego dnia tego kwartału.
 7. Kolejne dni, których nie obejmują okresy dostawy notowanych kontraktów terminowych miesięcznych grupuje się w koszyki kwartalne.
 8. Jeśli okres dostawy ostatniego z notowanych kontraktów terminowych kwartalnych nie kończy się w ostatnim dniu sezonu (przez który rozumie się okres drugiego i trzeciego kwartału roku (sezon letni) lub ostatni kwartał roku wraz pierwszym kwartałem roku następnego (sezon zimowy) to tworzy się koszyk z dni począwszy od dnia, który jest pierwszym następującym po ostatnim Dniu Dostawy ostatniego notowanego kontraktu terminowego kwartalnego, aż do ostatniego dnia tego sezonu.
 9. Kolejne dni, których nie obejmują okresy dostawy notowanych kontraktów terminowych kwartalnych grupuje się w koszyki sezonowe.
 10. Okres od dnia, który jest pierwszym następującym po ostatnim Dniu Dostawy ostatniego notowanego kontraktu terminowego sezonowego aż do ostatniego dnia roku tworzy kolejny koszyk.
 11. Kolejne dni, których nie obejmują okresy dostawy notowanych kontraktów terminowych sezonowych grupuje się w koszyki roczne.

1. Kurs rozliczeniowy dla i – tego okresu dostawy energii elektrycznej obliczany jest w dni robocze wg następujących algorytmów:

- a) Dla wszystkich okresów dostawy, które nie pokrywają się z żadnym notowanym oraz umożliwiającym zawarcie Transakcji w danym dniu kontraktem terminowym, kurs rozliczeniowy wyznaczany jest:
 - i) jako średnia arytmetyczna wartości TGeBase z ostatnich 7 dni w przypadku kontraktów terminowych typu BASE;
 - ii) jako średnia arytmetyczna wartości TGePeak z ostatnich 5 dni roboczych w przypadku kontraktów terminowych typu PEAK5;
 - iii) jako średnia ważona z ostatnich 7 dni (wagami są liczby godzin, na podstawie których wyznaczany jest indeks na dany dzień), w tym: wartości TGeOffpeak (w przypadku dni roboczych) oraz wartości TGeBase (w przypadku dni wolnych od pracy) dla kontraktów terminowych typu OFFPEAK.
- b) Dla okresów dostawy pokrywających się wyłącznie z kontraktami terminowymi tygodniowymi będącymi w notowaniu na giełdzie kurs rozliczeniowy jest liczony jako kurs danego kontraktu terminowego tygodniowego odpowiadającego danemu okresowi dostawy. Jeśli kurs kontraktu terminowego tygodniowego nie istnieje, do obliczenia kursu rozliczeniowego dla okresu dostawy przyjmuje się kurs najbliższego poprzedzającego kontraktu terminowego tygodniowego. W przypadku, gdy kurs wszystkich kontraktów terminowych tygodniowych o bliższym okresie dostawy nie istnieje, kurs rozliczeniowy dla okresu dostawy liczony jest jak w ust. 1 lit. a).
- c) Dla pozostałych okresów dostawy dla kontraktów terminowych typu BASE, PEAK5, OFFPEAK kurs rozliczeniowy jest liczony jako średnia ważona kursów rozliczeniowych kontraktów terminowych będących w danym dniu w notowaniach TGE, odpowiadających danemu okresowi dostawy:

$$K_r = \frac{k_w * n_w + k_m * n_m + k_q * n_q + k_y * n_y}{N}$$

gdzie:

$k_{w,m,q,y}$ – kurs rozliczeniowy kontraktu terminowego

tygodniowego/miesięcznego/kwartalnego/rocznego wyznaczonego przez Giełdę.

$n_{w,m,q,y}$ – wolumen otwartych Pozycji na kontraktach terminowych

tygodniowych/miesięcznych/kwartalnych/rocznych wyrażony w MWh.

$$N = n_w + n_m + n_q + n_y$$

- d) Dla pozostałych okresów dostawy dla kontraktów terminowych typu OFFPEAK w przypadku, gdy nie istnieją otwarte Pozycje w kontraktach terminowych miesięcznych, kwartalnych lub rocznych, kurs wyznaczany jest według wzoru:

$$OFFPEAK = \frac{BASE \cdot 168 - PEAK5 \cdot 75}{93}$$

gdzie:

OFFPEAK - kurs rozliczeniowy zabezpieczający dany okres,

BASE i *PEAK5* - kursy rozliczeniowe wyznaczone przez Izbę dla produktów *BASE* oraz *PEAK5* odpowiadające danemu okresowi. W przypadku, gdy nie istnieje okres dostawy *PEAK5* odpowiadający danemu okresowi *OFFPEAK*, we wzorze przyjmuje się kurs rozliczeniowy dla poprzedniego okresu *PEAK5*.

Kursy rozliczeniowe dla koszyków, które pokrywają się z kontraktami terminowymi, w których są otwarte Pozycje, wyznaczane są według wzoru przedstawionego w ust. 1 lit. c).

- e) W przypadku, gdy nie jest możliwe wyznaczenie kursu według zasad opisanych powyżej, kurs rozliczeniowy dla okresu dostawy jest równy kursowi z poprzedniego okresu dostawy.
- f) Kursy rozliczeniowe ustalone do wyznaczenia depozytów w dni wolne od pracy równe są kursom ustalonym w dzień roboczy poprzedzający te dni.

§ 25

1. Kurs rozliczeniowy dla i – tego okresu dostawy Gazu obliczany jest w dni robocze wg następujących algorytmów:

- a) Dla wszystkich okresów dostawy, które nie pokrywają się z żadnym notowanym oraz umożliwiającym zawarcie Transakcji w danym dniu kontraktem terminowym, kurs rozliczeniowy wyznaczany jest jako średnia arytmetyczna wartości TGEgasDA z ostatnich 7 dni.

- b) W przypadku braku możliwości wyznaczenia kursów rozliczeniowych wspomnianych w ust. 1 lit. a) kursem rozliczeniowym jest ostatni kurs kontraktu terminowego miesięcznego wyznaczonego przez Giełdę, którego dostawa pokrywała się z wymienionymi w ust. 1 lit. a) okresami dostawy.
- c) Dla okresów dostawy pokrywających się wyłącznie z kontraktami terminowymi tygodniowymi będącymi w notowaniu na giełdzie kurs rozliczeniowy jest liczony jako kurs danego kontraktu terminowego tygodniowego odpowiadającego danemu okresowi dostawy. Jeśli kurs kontraktu terminowego tygodniowego nie istnieje, do obliczenia kursu rozliczeniowego dla okresu dostawy przyjmuje się kurs najbliższego poprzedzającego kontraktu terminowego tygodniowego. W przypadku, gdy kurs wszystkich kontraktów terminowych tygodniowych o bliższym okresie dostawy nie istnieje, kurs rozliczeniowy dla okresu dostawy liczony jest jak w ust. 1 lit. a).
- d) W przypadku, gdy istnieją dni, które następują po okresie notowania ostatniego notowanego kontraktu terminowego tygodniowego i które nie pokrywają się z okresem dostawy żadnego notowanego kontraktu terminowego miesięcznego, za kurs rozliczeniowy dla okresu składającego się z tych dni przyjmuje się kurs rozliczeniowy dla poprzedniego okresu dostawy.
- e) Dla pozostałych okresów dostawy, kurs rozliczeniowy jest liczony jako średnia ważona kursów rozliczeniowych kontraktów terminowych będących w danym dniu w notowaniach TGE, odpowiadających danemu okresowi dostawy:

$$K_r = \frac{k_w * n_w + k_m * n_m + k_q * n_q + k_s * n_s + k_y * n_y}{N}$$

gdzie:

$k_{w,m,q,s,y}$ - kurs rozliczeniowy kontraktu terminowego tygodniowego/miesięcznego/kwartalnego/sezonowego/rocznego wyznaczony przez Giełdę.

$n_{w,m,q,s,y}$ - wolumen otwartych Pozycji na kontraktach terminowych tygodniowych/miesięcznych/kwartalnych/sezonowych/rocznych wyrażony w MWh.

$$N = n_w + n_m + n_q + n_s + n_y$$

- f) W przypadku, gdy obliczony zgodnie z zasadami, o których mowa powyżej kurs nie istnieje, kurs rozliczeniowy dla okresu dostawy jest równy kursowi z poprzedniego okresu dostawy.

- g) Kursy rozliczeniowe ustalone przez Izbę do wyznaczenia depozytów w dni wolne od pracy równe są kursom ustalonym w dzień roboczy poprzedzający te dni.

§ 26

1. Ustalanie kursów rozliczeniowych dla okresów lub Dni Dostawy energii elektrycznej lub Gazu w warunkach szczególnych:
 - a) W przypadku, gdy ustalany przez Giełdę dzienny kurs rozliczeniowy kontraktu terminowego znacząco odchyli się od kursu z dnia poprzedniego oraz sytuacja taka znacząco wpływa (lub może wpływać) na kurs rozliczeniowy dla okresów dostaw, Zarząd IRGiT może dokonać korekty dziennego kursu rozliczeniowego kontraktu terminowego przyjętego do ustalenia kursu rozliczeniowego w danym dniu tak, aby odpowiadał on wartościom rynkowym lub przyjąć kurs z dnia poprzedniego.
 - b) W przypadku, gdy kurs rozliczeniowy dla i-tego okresu dostawy ustalony zgodnie z § 22 ust. 1 lub § 23 ust. 1 znacząco odchyli się od wartości rynkowych, Zarząd IRGiT może dokonać korekty tego kursu rozliczeniowego.

§ 27

1. Wymagany depozyt zabezpieczający może zostać pokryty środkami pieniężnymi oraz wniesionymi zabezpieczeniami niepieniężnymi na zasadach określonych w § 28. Środki pieniężne wpłacane na depozyty zabezpieczające są, z zastrzeżeniem § 5 ust. 3 i ust. 5, gromadzone na dedykowanych Członkom Izby subkontach Rachunku depozytów zabezpieczających w Banku Płatniku Izby. Aktualizacja wysokości wymaganych depozytów zabezpieczających publikowana jest codziennie do godziny 17:00 w Raporcie rozliczeniowym. W dni robocze o godzinach 11:00 oraz 13:00 w Systemie rozliczeniowym dokonywana jest prognoza wartości depozytów zabezpieczających w oparciu o śróddzienne kursy rozliczeniowe, które wyliczane są na podstawie wszystkich Transakcji zawartych na RTP do momentu wykonania prognozy. W przypadku, gdy prognozowana wartość zobowiązań z tytułu depozytów przekroczy łączną wartość wniesionych zabezpieczeń, Członek Izby zobowiązany jest do niezwłocznego uzupełnienia środków na subkoncie Rachunku depozytów zabezpieczających.
2. Członkowie Izby mają obowiązek regulowania zobowiązań wynikających z naliczonych depozytów zabezpieczających w najbliższym dniu roboczym w procesie realizacji paczki zleceń płatniczych nr 3, o której mowa w § 59 ust. 1 lit. c).
3. Jeżeli Członek Izby nie dysponuje środkami na pokrycie swoich zobowiązań, o których mowa w ust. 2, jest on zobowiązany na wezwanie Izby do niezwłocznego zredukowania liczby swoich Pozycji na RTP do stanu, w którym wartość zdeponowanych przez niego

środków pieniężnych i możliwa uznana wartość zabezpieczeń niepieniężnych będzie wystarczająca do pokrycia jego zobowiązań.

4. Jeżeli Członek Izby w terminie wyznaczonym przez Izbę nie uzupełni wymaganych środków na pokrycie swoich zobowiązań lub nie wykona polecenia Izby, o którym mowa w ust. 3, Zarząd IRGiT ma prawo zawiesić możliwość zawierania Transakcji przez tego Członka Izby lub wdrożyć procedury związane z jego niewypłacalnością.

Rejestr Zabezpieczeń Niepieniężnych

§ 28

1. Izba, działając na podstawie § 37 ust. 8 i ust. 9 oraz § 39 ust. 6 Regulaminu prowadzi Rejestr Zabezpieczeń Niepieniężnych wnoszonych przez poszczególnych Członków Izby.
2. W Rejestrze Zabezpieczeń Niepieniężnych mogą być rejestrowane jedynie zabezpieczenia niepieniężne wnoszone na pokrycie zobowiązań Członków Izby z tytułu wpłaty do funduszu gwarancyjnego, depozytów zabezpieczających oraz depozytów transakcyjnych.
3. Przedmiotem zabezpieczeń składanych przez Członków Izby w formie niepieniężnej z tytułu depozytu zabezpieczającego mogą być:
 - a) Prawa Majątkowe ŚP
 - b) uprawnienia do emisji CO₂,
 - c) gwarancje bankowe,
 - d) poręczenia udzielane przez podmioty trzecie,pod warunkiem, iż przedmiot zabezpieczenia, o którym mowa w lit. a) – d) zostanie zaakceptowany przez Izbę.
4. Przedmiotem zabezpieczeń składanych przez Członków Izby w formie niepieniężnej z tytułu Podstawowego limitu transakcyjnego, wpłaty do funduszu gwarancyjnego oraz depozytu historycznego mogą być jedynie gwarancje bankowe akceptowane przez Izbę.
5. Zabezpieczenia niepieniężne wniesione przez podmiot wchodzący w skład Grupy energetycznej w rozumieniu Regulaminu, który podpisał z Izbą umowę określającą zasady ustanawiania zabezpieczenia finansowego dla Grupy energetycznej, mogą być uznawane w Rejestrze Zabezpieczeń Niepieniężnych jako zabezpieczenia niepieniężne dla innych podmiotów z tej Grupy energetycznej. Podział zabezpieczeń pomiędzy

podmioty odbywa się na warunkach określonych w uchwale Zarządu, o której mowa w § 39 ust. 7. Regulaminu.

6. W szczególnych przypadkach, uzasadnionych bezpieczeństwem rozliczeń, Zarząd Izby może postanowić o braku dalszego akceptowania wniesionych zabezpieczeń niepieniężnych i wezwać Członka Izby do uzupełnienia środków w formie pieniężnej w wyznaczonym terminie.

§ 29

1. Członek Izby działający na rachunek własny oraz równocześnie na rachunek klientów lub jako reprezentant Członka Giełdy, składając zabezpieczenie niepieniężne jest zobowiązany do:
 - a) wskazania celu składanego zabezpieczenia (tj. wpłata na fundusz gwarancyjny, depozyty zabezpieczające, depozyt historyczny, Podstawowy limit transakcyjny),
 - b) wskazania rodzaju działalności, na poczet której wnoszone jest zabezpieczenie (tj. działalność na rachunek własny, działalność na rachunek klientów, działalność jako reprezentant Członka Giełdy),
 - c) wskazania klientów lub reprezentowanych Członków Giełdy, na poczet których składane jest zabezpieczenie.
2. Każda zmiana w zakresie wskazanego rodzaju działalności, o którym mowa w ust. 1 lit. b), na poczet którego składane jest zabezpieczenie, wymaga przesłania przez Członka Izby dyspozycji w formie wiadomości wysłanej na adres mailowy Działu Zarządzania Ryzykiem. W przypadku wpłynięcia dyspozycji, o której mowa w zdaniu poprzednim do godziny 15:00 danego dnia roboczego, IRGiT dokonuje wykreślenia z Rejestru Zabezpieczeń Niepieniężnych zabezpieczenia objętego dyspozycją w tym samym dniu, natomiast jego wpisanie do Rejestru Zabezpieczeń Niepieniężnych w poczet zabezpieczeń dedykowanych wskazanemu w dyspozycji rodzajowi działalności następuje w dniu roboczym następującym po dniu wykreślenia. Dyspozycje, które wpłynęły po godzinie 15:00 bądź w dni wolne od pracy, rozpatrywane są w kolejnym najbliższym dniu roboczym.
3. Jeżeli Członek Izby przy składaniu zabezpieczenia w formie gwarancji bankowej nie zadeklaruje celu składanego zabezpieczenia lub zadeklaruje, że wniesione środki niepieniężne mają być przeznaczone zarówno na depozyt zabezpieczający, depozyt historyczny jak i Podstawowy limit transakcyjny, to przyjmuje się, że złożone na zabezpieczenie środki w formie niepieniężnej w pierwszej kolejności przeznacza się na pokrycie zobowiązań z tytułu depozytów zabezpieczających, a w drugiej kolejności na

pokrycie zobowiązań z tytułu depozytu historycznego. Ewentualna nadwyżka środków zaliczana jest na poczet Podstawowego limitu transakcyjnego.

4. Gwarancje bankowe wnoszone z tytułu wpłaty do funduszu gwarancyjnego nie mogą zostać uznane za zabezpieczenie składane z innego tytułu. Nadwyżka środków ponad wymaganą wartość wpłaty do funduszu gwarancyjnego wynikająca z wniesienia gwarancji bankowej na jej pokrycie nie jest przeznaczana na pokrycie zobowiązań z innych tytułów.

§ 30

1. Izba akceptuje jako zabezpieczenie niepieniężne zobowiązań z tytułu depozytów zabezpieczających Prawa Majątkowe do Świadectw Pochodzenia dla energii elektrycznej wyprodukowanej w odnawialnych źródłach energii, ewidencjonowane w Rejestrze Świadectw Pochodzenia w instrumencie PMOZE_A.
2. Wniesienie przez Członka Izby na zabezpieczenie Praw Majątkowych ze Świadectw Pochodzenia i ich rejestracja w Rejestrze Zabezpieczeń Niepieniężnych następują na podstawie:
 - a) wniosku o zablokowanie Praw Majątkowych ze Świadectw Pochodzenia na zabezpieczenie zobowiązań z tytułu depozytów zabezpieczających, złożonego w Rejestrze Świadectw Pochodzenia przez Członka Izby wnoszącego Prawa Majątkowe ze Świadectw Pochodzenia jako zabezpieczenie, oraz
 - b) podpisania pomiędzy Członkiem Izby a Izbą umowy przeniesienia na zabezpieczenie Praw Majątkowych ze Świadectw Pochodzenia składanych na zabezpieczenie.
3. Zaliczenie na poczet wniesionych przez danego Członka Izby zabezpieczeń Praw Majątkowych ze Świadectw Pochodzenia dokonywane jest po otrzymaniu przez Izbę z Rejestru Świadectw Pochodzenia informacji o rodzaju i liczbie zablokowanych Praw Majątkowych ze Świadectw Pochodzenia wniesionych na zabezpieczenie oraz pod warunkami wymienionymi w ust. 2 powyżej.
4. Zaliczeniu na poczet zabezpieczeń, o którym mowa w ust. 3, podlega część wartości rynkowej Praw Majątkowych ze Świadectw Pochodzenia ustalana w następujący sposób:

$$W_i = Lpm_i * Wr_i * (1 - WR_i)$$

gdzie:

W_i – wartość zabezpieczeń wniesionych w Prawach Majątkowych,

Lpm_i – liczba Praw Majątkowych określonego rodzaju,

Wr_i – wartość rynkowa Praw Majątkowych ze Świadczeń Pochodzenia będących przedmiotem obrotu na giełdzie wyznaczana na podstawie ostatniego indeksu dla transakcji sesyjnych,

WR_i – wskaźnik redukcji dla danego rodzaju Praw Majątkowych z przedziału (0,1) podawany w komunikatach Działu Zarządzania Ryzykiem IRGiT.

5. Wartość uznanego zabezpieczenia W_i sumuje się z innymi zabezpieczeniami wniesionymi w formie niepieniężnej przez danego Członka Izby.
6. Wycofanie przez Członka Izby Praw Majątkowych ze Świadczeń Pochodzenia z Rejestru Zabezpieczeń Niepieniężnych, następuje na podstawie wniosku złożonego przez tego Członka do Rejestru Świadczeń Pochodzenia za pośrednictwem i zgodą Izby, pod warunkiem jednak, że wartość pozostałych środków zaliczonych na poczet zabezpieczenia jest równa co najmniej, odpowiednio, minimalnej lub wymaganej wartości tego zabezpieczenia, albo że Członek Izby uprzednio uzupełnił to zabezpieczenie, odpowiednio, do jego wartości minimalnej lub wymaganej.
7. Do momentu wycofania o którym mowa w ust. 6, Prawa Majątkowe ze Świadczeń Pochodzenia, których wartość przestała być uwzględniana przy ustalaniu wartości zabezpieczenia złożonego przez Członka Izby, pozostają przedmiotem tego zabezpieczenia i mogą zostać wykorzystane zgodnie z celami jego ustanowienia.

§ 31

1. Przedmiotem zabezpieczeń składanych przez Członków Izby w formie niepieniężnej mogą być uprawnienia do emisji CO₂ zdefiniowane jako:

EUA – uprawnienia do wprowadzenia do powietrza gazów cieplarnianych w rozumieniu dyrektywy 2003/87/WE Parlamentu Europejskiego i Rady z dnia 13 października 2003 r. ustanawiającej system handlu przydziałami emisji gazów cieplarnianych we Wspólnocie, oraz zmieniającej Dyrektywę Rady 96/61/WE, zdeponowane w Rejestrze Unii (w rozumieniu Rozporządzenia Komisji UE nr 389/2013 z dnia 2 maja 2013 r. ustanawiającego rejestr Unii zgodnie z dyrektywą 2003/87/WE Parlamentu Europejskiego i Rady, decyzjami nr 280/2004/WE i nr 406/2009/WE Parlamentu Europejskiego i Rady oraz uchylającego rozporządzenia Komisji (UE) nr 920/2010 i nr 1193/2011).
2. Wniesienie przez Członka Izby na zabezpieczenie uprawnień do emisji CO₂ i rejestracja w Rejestrze Zabezpieczeń Niepieniężnych następują na podstawie:
 - a) zlecenia do Rejestru Unii przez Członka Izby składającego zabezpieczenia w formie uprawnień do emisji CO₂ transferu tych uprawnień na rachunek wskazany przez Izbę, oraz

- b) podpisania pomiędzy Członkiem Izby a Izbą umowy przeniesienia na zabezpieczenie uprawnień do emisji CO₂ składanych na zabezpieczenie.
3. Zaliczenie na poczet zabezpieczeń uprawnień do emisji CO₂ następuje po spełnieniu wszystkich warunków wymienionych w ust. 2 oraz pod warunkiem otrzymania przez Izbę transferu uprawnień do emisji CO₂ będących przedmiotem przeniesienia na zabezpieczenie na rachunek Izby w Rejestrze Unii.
4. Zaliczeniu na poczet zabezpieczeń, o których mowa w ust. 1, podlega część wartości rynkowej uprawnień ustalana w następujący sposób:

$$W_{up} = Cz * I_{up} * F_{ex} * (1 - WR_{EUA})$$

gdzie:

- W_{up} – wartość zabezpieczeń wniesionych w uprawnieniach do emisji CO₂;
- Cz – kurs rozliczeniowy z dnia poprzedzającego wycenę zabezpieczenia, przy czym w pierwszej kolejności wykorzystuje się kurs uprawnień do emisji EUA notowanych na rynku spot giełdy European Energy Exchange, a w przypadku gdy kurs ten nie jest dostępny to kurs rozliczeniowy dziennego kontraktu futures na uprawnienia EUA z giełdy Intercontinental Exchange (w przypadku gdy w danym dniu żaden z powyższych kursów nie jest dostępny, opisane powyżej czynności wykonuje się z uwzględnieniem kursów z dnia poprzedzającego ten dzień);
- I_{up} – ilość przeniesionych na rachunek Izby w Rejestrze Unii uprawnień do emisji CO₂;
- F_{ex} – kurs średni EUR/PLN publikowany przez Narodowy Bank Polski z danego dnia;
- WR_{EUA} – wskaźnik redukcji dla zabezpieczeń wnoszonych w uprawnieniach do emisji CO₂ z przedziału (0,1) podawany w komunikatach Działu Zarządzania Ryzykiem IRGiT.
5. Wartość W_{up} sumuje się z innymi zabezpieczeniami wniesionymi w formie niepieniężnej przez danego Członka Izby.
6. Wycofanie z Rejestru Zabezpieczeń Niepieniężnych i zwolnienie uprawnień do emisji CO₂ następuje na podstawie wniosku Członka Izby do Izby. Wniosek jest akceptowany pod warunkiem, że wymagany depozyt zabezpieczający danego Członka Izby jest pokryty przy wykorzystaniu pozostałych zabezpieczeń aktualnie wniesionych przez ten podmiot.
7. Do momentu zwolnienia uprawnień do emisji CO₂, których wartość przestała być uwzględniana przy ustalaniu wartości zabezpieczenia złożonego przez danego Członka

Izby, uprawnienia te pozostają przedmiotem zabezpieczenia i mogą zostać wykorzystane zgodnie z celami jego ustanowienia.

§ 32

1. W przypadkach, o których mowa w § 28 ust. 3 oraz ust. 4 przedmiotem zabezpieczeń składanych przez Członków Izby w formie niepieniężnej oraz rejestrowanych w Rejestrze Zabezpieczeń Niepieniężnych mogą być gwarancje bankowe spełniające następujące warunki:
 - a) udzielającym gwarancji może być wyłącznie bank akceptowany przez Izbę, który w szczególności nie jest powiązany kapitałowo (należący do tej samej grupy kapitałowej) z podmiotem, dla którego wystawiona jest gwarancja bankowa lub też nie jest powiązany kapitałowo z Członkiem Izby prowadzącym działalność na rachunek klienta lub Członkiem Izby reprezentującym Członka Giełdy, dla którego wystawiona jest gwarancja bankowa,
 - b) udzielającym gwarancji może być wyłącznie bank posiadający siedzibę lub oddział na terenie Rzeczypospolitej Polskiej albo poza granicami Rzeczypospolitej Polskiej o ile posiada on odpowiednie uzgodnienia z Bankiem Płatnikiem Izby lub Bankiem Płatnikiem Członka Izby w zakresie komunikacji międzybankowej za pośrednictwem systemu SWIFT,
 - c) udzielającym gwarancji może być wyłącznie bank posiadający odpowiedni stopień jakości kredytowej, określany na zasadach opisanych w ust. 2,
 - d) gwarancja bankowa musi zawierać bezwarunkowe i nieodwołalne zobowiązanie banku do natychmiastowej zapłaty na pierwsze żądanie Izby kwoty do maksymalnej wysokości określonej w gwarancji,
 - e) gwarancja bankowa musi być zgodna ze wzorem gwarancji bankowej akceptowanym przez Izbę, określanym odrębnie dla gwarancji pierwszej i drugiej klasy płynności, o których mowa w ust. 3,
 - f) kwota świadczenia pieniężnego, na które została wystawiona gwarancja bankowa nie może być niższa niż 100 000 zł (słownie: sto tysięcy polskich złotych),
 - g) termin obowiązywania gwarancji bankowej uznanej jako zabezpieczenie z tytułu wpłaty na fundusz gwarancyjny powinien wynosić co najmniej 45 dni od daty aktualizacji, o której mowa w § 45c Regulaminu.
2. Przez odpowiedni stopień jakości kredytowej uznaje się wyznaczony na podstawie długoterminowej oceny ratingowej przyznawanej przez agencje ratingowe Fitch,

Moody's oraz Standard&Poor's stopień jakości kredytowej, który zgodnie z poniższą tabelą jest mniejszy niż 6.

S&P	Fitch	Moody's	stopień jakości kredytowej	ocena poziomu ryzyka
AAA	AAA	Aaa	1	Akceptowalne
AA+	AA+	Aa1	1	Akceptowalne
AA	AA	Aa2	2	Akceptowalne
AA-	AA-	Aa3	2	Akceptowalne
A+	A+	A1	3	Akceptowalne
A	A	A2	3	Akceptowalne
A-	A-	A3	3	Akceptowalne
BBB+	BBB+	Baa1	4	Akceptowalne
BBB	BBB	Baa2	4	Akceptowalne
BBB-	BBB-	Baa3	4	Akceptowalne
BB+	BB+	Ba1	5	Warunkowe
BB	BB	Ba2	5	Warunkowe
BB-	BB-	Ba3	5	Warunkowe
B+	B+	B1	6	Nieakceptowalne
B	B	B2	6	Nieakceptowalne
B-	B-	B3	6	Nieakceptowalne
CCC+	CCC+	Caa1	6	Nieakceptowalne
CCC	CCC	Caa2	6	Nieakceptowalne
CCC-	CCC-	Caa3	6	Nieakceptowalne
CC	CC	Ca	6	Nieakceptowalne
C	C	Ca	6	Nieakceptowalne
RD	DDD	C	6	Nieakceptowalne

gdzie:

- a) warunkowa ocena poziomu ryzyka oznacza, że w odniesieniu do banków, które posiadają stopień jakości kredytowej na poziomie 5, łączna wartość obowiązujących gwarancji wystawionych przez dany bank dla jednego Członka Izby nie może przekroczyć kwoty 13 mln zł (słownie: trzynaście milionów polskich złotych);

- b) w przypadku, gdy bank posiada oceny ratingowe nadane przez różne agencje ratingowe, przyjmuje się ocenę, której przypisany jest najwyższy stopień jakości kredytowej;
 - c) w przypadku, gdy dany bank nie posiada żadnej oceny ratingowej jego stopień jakości kredytowej wynosi 6.
3. Przez natychmiastową zapłatę rozumie się uznanie rachunku bankowego wskazanego przez Izbę:
- a) w dniu zgłoszenia żądania, jeżeli zgłoszenie nastąpiło do godz. 9:30 CET, albo w dniu następnym, jeżeli zgłoszenie nastąpiło po godz. 9:30 CET (gwarancje pierwszej klasy płynności) lub
 - b) w ciągu 2 dni roboczych od zgłoszenia żądania, jeżeli zgłoszenie nastąpiło do godz. 9.30 CET, albo w ciągu 3 dni roboczych, jeżeli zgłoszenie nastąpiło po godz. 9.30 CET (gwarancje drugiej klasy płynności).
4. Członek Izby jest zobowiązany do przekazania Izbie aktualnych pełnomocnictw osób udzielających gwarancji bankowych w imieniu banku oraz wszystkich niezbędnych dokumentów wymaganych przez Izbę w celu przeprowadzenia procesu oceny banku wystawcy gwarancji przez Izbę. Na żądanie Członka Izby, Izba udziela informacji dotyczącej potencjalnego akceptowania banku wskazanego przez tego Członka, jako wystawcy gwarancji bankowej stanowiącej przedmiot zabezpieczenia.
5. W przypadku, gdy w okresie obowiązywania gwarancji bankowej przyjętej na poczet zabezpieczenia, bank który jej udzielił przestał spełniać warunki akceptacji przez Izbę, Członek Izby na wezwanie Izby zobowiązany jest do niezwłocznego, nie później niż w ciągu 14 dni roboczych, wniesienia innego zabezpieczenia akceptowanego przez Izbę.

§ 33

1. Celem złożenia zabezpieczenia w formie gwarancji bankowej, Członek Izby zobowiązany jest do określenia tytułu zabezpieczenia oraz do przekazania Izbie projektu dokumentu gwarancji bankowej.
2. Ostateczna akceptacja gwarancji bankowej, jako zabezpieczenia składanego w formie niepieniężnej wymaga zgody IRGiT i zarejestrowania w Rejestrze Zabezpieczeń Niepieniężnych, z zastrzeżeniem postanowień ust. 3.
3. Gwarancje bankowe składane z tytułu wpłaty na Fundusz Gwarancyjny uznaje się jako zabezpieczenie niepieniężne od terminu pierwszej aktualizacji, o której mowa w § 45a Regulaminu następującej po dacie akceptacji gwarancji bankowej na zasadach określonych w ust. 2 powyżej pod warunkiem, że termin obowiązywania gwarancji

bankowej wynosi co najmniej 45 dni od tej aktualizacji. W przypadku, gdy dana gwarancja bankowa uznana jako zabezpieczenie niepieniężne wpłaty na fundusz gwarancyjny nie spełnia wymogu obowiązywania w terminie 45 dni od kolejnej aktualizacji, Członek Izby jest zobowiązany do złożenia gwarancji bankowej spełniającej ten wymóg lub dokonania aktualizacji wpłaty na fundusz gwarancyjny w środkach pieniężnych.

4. W przypadku zmiany treści uznanej przez Izbę gwarancji bankowej, postanowienia ust. 1 i ust. 2 stosuje się odpowiednio, z zastrzeżeniem, iż obniżenie kwoty gwarancji bankowej wniesionej na poczet wpłaty do funduszu gwarancyjnego pomiędzy kolejnymi aktualizacjami funduszu gwarancyjnego jest dopuszczalne wyłącznie do kwoty, która została uznana jako wpłata na fundusz gwarancyjny.
5. Wycofanie gwarancji bankowej uznanej jako wniesione zabezpieczenie niepieniężne przed końcem terminu jej obowiązywania wymaga zgody Izby. Zwrot gwarancji bankowej wniesionej na poczet wpłaty do funduszu gwarancyjnego następuje nie wcześniej niż w 4 dniu roboczym następującym po dniu aktualizacji wpłat do funduszu gwarancyjnego, o której mowa w § 45a Regulaminu na podstawie wniosku Członka Izby złożonego do IRGiT najpóźniej w ostatnim roboczym dniu miesiąca poprzedzającego dzień tej aktualizacji oraz pod warunkiem dokonania przez Członka Izby wpłaty na fundusz gwarancyjny w środkach pieniężnych.
6. Członek Izby, który złożył zabezpieczenie w formie gwarancji bankowej z tytułu innego niż na poczet wpłaty do funduszu gwarancyjnego, w celu dalszego korzystania z tej formy wnoszenia zabezpieczeń, zobowiązany jest najpóźniej na 3 dni robocze przed końcem okresu obowiązywania tej gwarancji lub jeśli ostatni dzień obowiązywania gwarancji przypada w dzień wolny od pracy na 3 dni robocze przed ostatnim dniem roboczym poprzedzającym ten dzień, złożyć nową gwarancję bankową, której okres obowiązywania rozpoczyna się najpóźniej w dniu następującym po ostatnim dniu okresu obowiązywania obowiązującej gwarancji, lub aneks do obowiązującej gwarancji bankowej wydłużający okres jej obowiązywania. W przypadku niespełnienia tego warunku na 2 dni robocze przed końcem okresu obowiązywania gwarancji lub jeżeli ostatni dzień obowiązywania gwarancji przypada w dzień wolny od pracy na 2 dni robocze przed ostatnim dniem roboczym poprzedzającym ten dzień, Izba ma prawo do usunięcia gwarancji z Rejestru Zabezpieczeń Niepieniężnych.
7. W przypadku gdy nowy dokument gwarancji bankowej lub aneks do obowiązującej gwarancji, o których mowa w ust. 6, wystawiony jest na niższą kwotę niż kwota gwarancji bankowej, której kończy się termin obowiązywania, Izba ma prawo do wpisania do Rejestru Zabezpieczeń Niepieniężnych niższej kwoty począwszy od drugiego dnia roboczego przed końcem okresu obowiązywania gwarancji.

§ 34

1. Przedmiotem zabezpieczeń składanych przez Członków Izby w formie niepieniężnej oraz rejestrowanych w Rejestrze Zabezpieczeń Niepieniężnych mogą być poręczenia, o których mowa w § 28 ust. 3, z uwzględnieniem poniższych wymogów:
 - a) poręczenie może zostać udzielone przez klienta Domu Maklerskiego lub Towarowego Domu Maklerskiego będących Rozliczającymi Członkami Izby prowadzącymi działalność na rachunek tego klienta, bądź przez Członka Giełdy, który jest reprezentowany przez tego Rozliczającego Członka Izby;
 - b) poręczenie musi zostać przez poręczyciela zabezpieczone w jednej z następujących form:
 - i) umową przeniesienia na zabezpieczenie Praw Majątkowych ze Świadczeń Pochodzenia, gdzie wartość zabezpieczeń ustala się na zasadach określonych w § 30 ust. 4 i 5, lub
 - ii) umową przeniesienia na zabezpieczenie uprawnień do emisji CO₂, gdzie wartość zabezpieczeń ustala się na zasadach określonych w § 31 ust. 4 i 5, lub
 - iii) gwarancją bankową wystawioną przez akceptowany przez Izbę bank.
 - c) poręczenie udzielone jest jako poręczenie bezwarunkowe, płatne na pierwsze żądanie;
 - d) poręczenie udzielane jest na zasadach określonych w projekcie umowy ustalonej i akceptowanej przez Izbę.
2. Klient Domu Maklerskiego lub Towarowego Domu Maklerskiego oraz Członek Giełdy, o których mowa w ust. 1 lit a), składa do Izby poręczenie za pośrednictwem odpowiednio Domu Maklerskiego lub Towarowego Domu Maklerskiego bądź Członka Izby pełniącego funkcję Rozliczającego Członka Izby.
3. Poręczenia udzielane przez klienta Domu Maklerskiego lub Towarowego Domu Maklerskiego oraz przez reprezentowanego Członka Giełdy mogą być przeznaczone tylko na pokrycie zobowiązań z tytułu depozytów zabezpieczających Transakcje rozliczane przez danego Członka Izby na rzecz odpowiednio tego klienta lub reprezentowanego Członka Giełdy.

Limity koncentracji zabezpieczeń niepieniężnych

§ 35

1. Uznana całkowita wartość zabezpieczeń składanych w formie Praw Majątkowych ze Świadectw Pochodzenia oraz uprawnień do emisji CO₂ nie może być większa niż 65% wartości wymaganych depozytów zabezpieczających danego Członka Izby, z zastrzeżeniem postanowień ust. 5.
2. Uznana całkowita wartość zabezpieczeń wnoszonych w formie gwarancji bankowych spełniających warunek o którym mowa w § 32 ust. 3 lit a) (gwarancje pierwszej klasy płynności), z zastrzeżeniem postanowień ust. 5, nie może stanowić więcej niż:
 - a) 90% wartości wymaganych depozytów zabezpieczających danego Członka Izby,
 - b) 50% wartości Podstawowego limitu transakcyjnego danego Członka Izby,
 - c) 50% wartości wymaganego depozytu historycznego dla danego Członka Izby,
 - d) 60% wartości wymaganej wpłaty do funduszu gwarancyjnego danego Członka Izby.
3. Uznana całkowita wartość zabezpieczeń wnoszonych w formie gwarancji bankowych spełniających warunek o którym mowa w § 32 ust. 3 lit b) (gwarancje drugiej klasy płynności), z zastrzeżeniem postanowień ust. 5, nie może stanowić więcej niż:
 - a) 70% wartości wymaganych depozytów zabezpieczających danego Członka Izby,
 - b) 0% wartości Podstawowego limitu transakcyjnego danego Członka Izby,
 - c) 0% wartości wymaganego depozytu historycznego dla danego Członka Izby,
 - d) 0% wartości wymaganej wpłaty do funduszu gwarancyjnego danego Członka Izby.
4. Z zastrzeżeniem postanowień ust. 5, uznana wartość poręczenia udzielanego przez podmioty trzecie, zabezpieczonego:
 - a) Prawami Majątkowymi ze Świadectw Pochodzenia oraz uprawnień do emisji CO₂ - nie może być wyższa niż 65% wartości depozytów zabezpieczających zabezpieczanych tym poręczeniem;
 - b) gwarancjami bankowymi - nie może być wyższa niż 90% wartości depozytów zabezpieczających zabezpieczanych tym poręczeniem.
5. W przypadku, gdy Członek Izby w celu pokrycia zobowiązań z tytułu depozytów zabezpieczających wnosi zabezpieczenia niepieniężne w więcej niż jednej z form, o których mowa w § 28 ust. 3, uznana wartość każdego z tych zabezpieczeń określa się według następującej kolejności:

- a) Prawa Majątkowe ŚP oraz uprawnienia do emisji CO₂, w tym również wniesione jako zabezpieczenie poręczenia, o którym mowa w § 34,
- b) gwarancje bankowe drugiej klasy płynności, w tym również wniesione jako zabezpieczenie poręczenia, o którym mowa w § 34,
- c) gwarancje bankowe pierwszej klasy płynności, w tym również wniesione jako zabezpieczenie poręczenia, o którym mowa w § 34,

przy czym:

- i. wartość zabezpieczeń niepieniężnych, uznana we wcześniejszej kolejności zgodnie z kolejnością określoną powyżej, pomniejsza maksymalną możliwą wartość uznania zabezpieczeń niepieniężnych uznawanych w kolejności dalszej,
 - ii. kolejność wnoszenia przez Członka Izby zabezpieczeń niepieniężnych nie wpływa na określoną powyżej kolejność uznawania ich wartości. W przypadku wniesienia przez Członka Izby zabezpieczenia niepieniężnego w kolejnej formie, uznana wartość zabezpieczeń niepieniężnych uprzednio wniesionych przez ten podmiot jest określana ponownie, zgodnie z określoną powyżej kolejnością uznawania wartości każdego z tych zabezpieczeń.
6. W przypadku Członków Izby prowadzących działalność zarówno na rachunek własny jak i działalność inną niż na rachunek własny, uznana wartość zabezpieczeń niepieniężnych określa się odrębnie dla tych rodzajów działalności, przy czym w przypadku działalności innej niż na rachunek własny, uznana wartość zabezpieczeń niepieniężnych kalkulowana jest odrębnie dla każdego klienta lub reprezentowanego Członka Giełdy z zachowaniem zasad, o których mowa w ust. 2. - 5.
7. Wartość uznanych na depozyt zabezpieczający zabezpieczeń niepieniężnych w każdej z form, o których mowa w § 28 ust. 3, obliczana jest zgodnie z zasadami określonymi w ust. 1 – 6 powyżej, na podstawie wzoru:

$$WUZ_i = \min (WZ_i; DZ * PU_i - WUZ_{<n_i}; DZ - WUZ_{<n_i})$$

gdzie:

- WUZ_i – wartość zabezpieczeń w formie i uznanych na poczet depozytu zabezpieczającego,
- WZ_i – wartość zabezpieczeń w formie i wniesionych na poczet depozytu zabezpieczającego,
- DZ – wartość wymagana depozytu zabezpieczającego,
- PU_i – wartość procentowa określona w ust. 1 – 4, określona dla każdej formy zabezpieczeń i , oznaczająca że uznana wartość zabezpieczenia w formie i

nie może być większa niż PU_i wartości wymaganego depozytu zabezpieczającego,

$WUZ_{<n_i}$ – (gdzie n_i jest znacznikiem kolejności uznawania zabezpieczeń w formie i) wartość uznanych na poczet depozytów zabezpieczających zabezpieczeń niepieniężnych, które zostały uznane we wcześniejszej kolejności zgodnie z kolejnością zdefiniowaną w ust. 5,

przy czym, w przypadku, gdy Członek Izby wniósł zabezpieczenia niepieniężne jednocześnie w formie Praw Majątkowych ŚP oraz uprawnień do emisji CO₂, w tym również jako zabezpieczenie poręczenia, o którym mowa w § 34, to wartość uznanych zabezpieczeń niepieniężnych dla tych grup form zabezpieczeń wyznaczana jest w sposób zagregowany.

8. Mając na uwadze bezpieczeństwo rozliczeń, Zarząd Izby może podjąć decyzję o ustanowieniu innych maksymalnych wartości uznania poszczególnych form zabezpieczeń niepieniężnych na poziomie danego Członka Izby lub Izby.

§ 36

1. Dla zabezpieczeń składanych w formie Praw Majątkowych ze Świadectw Pochodzenia oraz zabezpieczeń w formie uprawnień do emisji CO₂ Izba stosuje limity koncentracji na poziomie Członka Izby oraz limit koncentracji na poziomie Izby.
2. Limit koncentracji na poziomie Członka Izby oznacza maksymalny wolumen Praw Majątkowych ze Świadectw Pochodzenia lub uprawnień do emisji CO₂, jaki może być wniesiony przez każdego Członka Izby, przy uwzględnieniu zabezpieczeń wniesionych zarówno w związku z działalnością prowadzoną na rachunek własny, jak i na rachunek inny niż własny.
3. Limit koncentracji na poziomie Izby oznacza maksymalny wolumen Praw Majątkowych ze Świadectw Pochodzenia lub uprawnień do emisji CO₂, jaki może być ogółem wniesiony do IRGiT.
4. Wartości limitów koncentracji Praw Majątkowych ze Świadectw Pochodzenia oraz uprawnień do emisji CO₂ określa poniższa tabela:

Rodzaj zabezpieczenia	Typ limitu	Limit koncentracji
uprawnienia do emisji CO ₂ – EUA	Limit na poziomie Izby	50 000 000 EUA
uprawnienia do emisji CO ₂ – EUA	Limit na poziomie Członka Izby	15 000 000 EUA
Prawa Majątkowe ze Świadectw Pochodzenia – PМОZE_A	Limit na poziomie Izby	3 000 000 MWh
Prawa Majątkowe ze Świadectw Pochodzenia – PМОZE_A	Limit na poziomie Członka Izby	240 000 MWh

5. Jeżeli w wyniku wniesienia zabezpieczenia w danej formie niepieniężnej, nastąpiłoby przekroczenie wartości danego limitu koncentracji, o którym mowa w ust. 4, Izba przyjmuje zabezpieczenie jedynie do wysokości wartości limitu koncentracji.

Fundusz gwarancyjny

§ 37

1. Izba działając na podstawie § 41 Regulaminu organizuje fundusz gwarancyjny dla zabezpieczania Transakcji, których przedmiotem dostawy jest energia elektryczna lub Gaz, zawieranych na następujących rynkach:
 - a) Rynek Dnia Następnego i Bieżącego,
 - b) Rynek Dnia Następnego i Bieżącego gazu,
 - c) Rynek Terminowy Produktów.
2. Minimalna wartość wpłaty do funduszu gwarancyjnego wynosi 10 000 złotych, a w przypadku podmiotów dopuszczonych do działania w zakresie Rynku Terminowego Produktów 30 000 złotych.
3. Pierwsza wpłata do funduszu gwarancyjnego stanowi trzykrotną wartość wpłaty minimalnej, o której mowa w ust. 2.
4. Członek Izby wnosi pierwszą wpłatę do funduszu gwarancyjnego najpóźniej na dwa dni przed dniem wskazanym przez Giełdę, jako dzień rozpoczęcia przez Członka Izby lub podmiot, którego Członek Izby będzie reprezentował w Izbie jako Rozliczający Członek Izby, działalności w zakresie rynków określonych w ust. 1.
5. Wymagana wpłata danego Członka Izby do funduszu gwarancyjnego wyznaczana jest poprzez podzielenie łącznej wartości wpłat na fundusz gwarancyjny, o której mowa w ust. 6, proporcjonalnie do wysokości średnich niepokrytych ryzyk poszczególnych Członków Izby uczestniczących w tym funduszu z okresu ostatniego miesiąca. W wyniku powyższego proporcjonalnego podziału uzyskuje się wartość mnożnika m_{FGGIR} , który publikowany jest poprzez Komunikat Dyrektora Działu Zarządzania Ryzykiem.
6. Łączna wartość wpłat na fundusz gwarancyjny wyznaczona jest jako pierwsza co do wielkości w okresie ostatnich 60 dni wartość, stanowiąca większą z dwóch wartości ustalonych dla każdego z tych dni:
 - a) pierwszą co do wielkości wartość ryzyka niepokrytego Członka Izby lub grupy Członków Izby, określoną w danym dniu zgodnie z ust. 7 albo

- b) sumę drugiej i trzeciej co do wielkości wartości ryzyka niepokrytego Członków Izby lub grup Członków Izby określonych w danym dniu zgodnie z ust. 7.
7. Wartość ryzyka niepokrytego wyznacza się jako stratę stress testową, określoną zgodnie z ust. 9, pomniejszoną o wartość depozytu uzupełniającego wyznaczonego dla zawartych przez danego Członka Izby Transakcji objętych funduszem gwarancyjnym i powiększoną o wartość depozytu zabezpieczającego, określaną przy uwzględnieniu wszystkich Transakcji objętych funduszem gwarancyjnym zawartych przez tego Członka Izby.
 8. Dla celów kalkulacji o której mowa w ust. 6, dla każdej grupy energetycznej, wobec której stosowana jest kompensacja depozytów na podstawie § 39 ust. 7 Regulaminu Giełdowej Izby Rozrachunkowej wartość ryzyka niepokrytego wyznaczana jest na poziomie grupy.
 9. Dla każdego Członka Izby, prowadzącego działalność zarówno na rachunek własny jak i działalność inną niż na rachunek własny, wartość niepokrytego ryzyka wyznaczana jest jako suma niepokrytych ryzyk wynikających z każdej z tych działalności .
 10. Dla każdego Członka Izby wyznaczana jest wartość straty stress testowej, jako wartość uzyskana przy zamykaniu Pozycji tego Członka Izby, w przypadku realizacji najbardziej niekorzystnego scenariusza testów warunków skrajnych.
 11. Wpłaty na fundusz gwarancyjny dokonywane są z zastrzeżeniem postanowień ust. 15, na rachunek Spółki prowadzony w Deutsche Bank Polska S.A. o numerze:

69 1880 0009 0000 0013 0091 0004

lub poprzez wniesienie gwarancji bankowych, zgodnie z postanowieniami § 33.
 12. Zarząd Spółki na podstawie wniosku złożonego przez Dom maklerski lub Towarowy dom maklerski może wyrazić zgodę na zdeponowanie wpłaty do funduszu gwarancyjnego na rachunku bankowym zainteresowanego podmiotu w Banku Płatniku Członka Izby. Zasady i warunki wyrażenia zgody określane są w uchwale Zarządu Izby.
 13. W przypadku zmiany umowy o członkostwo, polegającej na rezygnacji z prowadzenia przez dany podmiot działalności jako Członek Izby w zakresie wszystkich rynków określonych w ust. 1, zwrot wpłaty do funduszu gwarancyjnego następuje na wniosek tego podmiotu, najpóźniej w terminie kolejnej aktualizacji wpłaty do funduszu, pod warunkiem wykonania przez niego wszystkich zobowiązań wynikających z członkostwa w Izbie.
 14. Zwrot wpłaty dokonywany jest na rachunek bankowy wskazany we wniosku, o którym mowa w ust. 16, a w przypadku braku takiego wskazania, na Rachunek rozliczeniowy danego podmiotu w Banku Płatniku Członka Izby.

ROZDZIAŁ II

ZASADY POSTĘPOWANIA W SYTUACJI WYSTĄPIENIA PRZYPADKU NARUSZENIA

§ 38

1. W sytuacji, gdy wobec danego Członka Izby stwierdzony został Przypadek naruszenia, Izba może podjąć działania określone w § 54 Regulaminu.
2. Szczegółowe informacje dotyczące działań podejmowanych przez IRGiT oraz zasad postępowania w sytuacji wystąpienia przesłanki do stwierdzenia Przypadku naruszenia określają Zasady postępowania w sytuacji wystąpienia Przypadku naruszenia, przyjmowane przez Zarząd IRGiT w drodze uchwały.
3. W celu zabezpieczenia rozrachunków finansowych wynikających z rozliczeń Transakcji, Izba zgodnie z § 53 ust. 2 i § 54 ust. 1 Regulaminu ma prawo do regulowania zobowiązań i należności Członka Izby poprzez odpowiednio obciążanie lub uznanie subkonta Rachunku depozytów transakcyjnych w BPI przypisanego do danego Członka Izby.
4. Podjęcie decyzji, o której mowa w ust. 3 powyżej nie wyłącza możliwości obciążania przez Izbę rachunku rozliczeniowego Członka Izby w BPCI w celu pokrycia jego bieżących lub przyszłych zobowiązań wynikających z Transakcji, za których rozliczenie odpowiada ten Członek Izby.
5. Izba niezwłocznie informuje Członka Izby o konieczności wykorzystania jego należności na zasadach określonych w ust. 3 powyżej.

ROZDZIAŁ III

REJESTRACJA OPERACJI ZWIĄZANYCH Z OBROTEM TOWARAMI GIEŁDOWYMI

§ 39

1. Izba prowadzi odrębne Konta ewidencyjne dla poszczególnych Członków Izby.
2. W przypadku, gdy Członek Izby prowadzi działalność na rachunek klientów lub pełni funkcję reprezentanta Członka Giełdy, Izba prowadzi dla tego Członka Izby odrębne Konta ewidencyjne dedykowane odpowiednio każdemu z jego klientów lub Członków Giełdy reprezentowanych przez tego Członka Izby, z zastrzeżeniem postanowień w ust. 4-6.

3. Dla Transakcji zawieranych na RDB, RDN, RTPE oraz RPM Izba tworzy odrębne, zbiorcze Konto ewidencyjne oraz przyporządkowane do niego Konto rozliczeniowe.
4. W przypadku, gdy na Koncie ewidencyjnym rejestrowane są Pozycje, wynikające z zawartych Transakcji na RDB, RDN i RTPE, w Systemie rozliczeniowym zostaje skonfigurowana Jednostka Grafikowa przyporządkowana do tego Konta ewidencyjnego.
5. Dla Transakcji zawieranych na RDBg, RDNg oraz RTPG Izba tworzy odrębne, zbiorcze Konto ewidencyjne dla każdego z punktów dostawy Gazu oraz przyporządkowane do niego, wspólne Konto rozliczeniowe.
6. W przypadku, gdy na Koncie ewidencyjnym rejestrowane są Pozycje, wynikające z zawartych Transakcji na RDBg, RDNg i RTPG, w Systemie rozliczeniowym zostaje skonfigurowany Kod ZUP przyporządkowany do tego Konta ewidencyjnego.

§ 40

1. Dla Kont ewidencyjnych, służących do rejestrowania Pozycji wynikających z Transakcji, o których mowa w § 39 ust. 4 i 6, Izba tworzy przyporządkowane do tych kont Konta dostawy, pod którymi skonfigurowana jest odpowiednio Jednostka Grafikowa lub Kod ZUP.
2. W przypadku, gdy Członek Izby prowadzi jednocześnie działalność na rynkach, których przedmiotem dostawy jest energia elektryczna oraz Gaz, Izba tworzy dwa oddzielne Konta dostawy służące obsłudze tych działalności.
3. W przypadku, gdy Członek Izby nie posiada własnej Jednostki Grafikowej lub Kodu ZUP może on korzystać z Jednostki Grafikowej lub Kodu ZUP należącej do innego podmiotu, z którym zawarł on odpowiednią umowę o udostępnienie Jednostki Grafikowej lub Kodu ZUP.
4. W ramach jednego Konta dostawy może być skonfigurowana więcej niż jedna Jednostka Grafikowa pod warunkiem, że wszystkie Jednostki Grafikowe skonfigurowane pod danym Kontem dostawy są własnością jednego podmiotu.
5. W ramach jednego Konta dostawy może być skonfigurowany jeden Kod ZUP. W przypadku, gdy spółka jest właścicielem kilku Kodów ZUP, Izba tworzy w Systemie rozliczeniowym oddzielne Konto dostawy dla każdego z tych kodów.
6. Dla Transakcji zawieranych na RDBg, RDNg i RTPG Izba tworzy odrębne Konto dostawy dla każdego z punktów dostawy Gazu i przyporządkowuje je do odrębnych Kont ewidencyjnych, o których mowa w § 39 ust. 5.

7. Jedno Konto dostawy może być przyporządkowane do więcej niż jednego Konta ewidencyjnego.
8. W przypadku, zaistnienia sytuacji, na skutek której Członek Izby, jego klient lub reprezentowany Członek Giełdy nie może realizować dostawy fizycznej energii elektrycznej lub Gazu poprzez wykorzystanie Jednostki Grafikowej lub Kodu ZUP przypisanych do ich Konta ewidencyjnego, Członek Izby zobowiązany jest wskazać Izbie odpowiednio inną Jednostkę Grafikową lub Kod ZUP, na które może być realizowana fizyczna dostawa energii elektrycznej lub Gazu.
9. Dla każdego Konta ewidencyjnego Izba tworzy przyporządkowane do niego Konto rozliczeniowe, służące do rejestrowania zobowiązań i należności wynikających z dziennych rozliczeń Transakcji oraz zobowiązań Rozliczającego Członka Izby z tytułu naliczonych depozytów zabezpieczających wynikających z otwartych Pozycji.
10. Dla każdego Członka Izby Izba prowadzi Konto rozrachunków finansowych, z zastrzeżeniem, że w przypadku prowadzenia przez Rozliczającego Członka Izby działalności jednocześnie na rachunek własny oraz na rachunek inny niż własny, Izba prowadzi dwa oddzielne Konta rozrachunków finansowych dla tych rodzajów działalności. Do Konta rozrachunków finansowych przyporządkowane jest odpowiednio Konto rozliczeniowe Członka Izby działającego na rachunek własny albo wszystkie Konta rozliczeniowe dedykowane jego klientom lub reprezentowanym Członkom Giełdy.
11. Konto rozrachunków finansowych służy do rejestrowania wartości zobowiązań i należności Rozliczającego Członka Izby, na podstawie których Izba przygotowuje zlecenia płatnicze przekazywane do Banku Rozliczeniowego w celu rozrachunku finansowego rozliczanych przez Izbę Transakcji. Konto rozrachunków finansowych przyporządkowane jest do odpowiedniego Rachunku rozliczeniowego Członka Izby w Banku Płatniku Członka Izby, za pośrednictwem którego Członek ten reguluje swoje zobowiązania wobec Izby.
12. Dla każdego Członka Izby Izba prowadzi Konto zabezpieczeń, z zastrzeżeniem, że w przypadku prowadzenia przez Rozliczającego Członka Izby działalności jednocześnie na rachunek własny oraz na rachunek inny niż własny, Izba prowadzi dwa oddzielne Konta zabezpieczeń dla tych rodzajów działalności. .
13. Konto zabezpieczeń służy do rejestrowania łącznej wartości zabezpieczeń wniesionych przez Członka Izby w środkach pieniężnych, jak również wniesionych w innych formach zabezpieczeń niepieniężnych uznanych przez Izbę i zarejestrowanych w Rejestrze Zabezpieczeń Niepieniężnych.

ROZDZIAŁ IV

PODZIAŁ POZYCJI KONTRAKTÓW TERMINOWYCH Z RTP, KTÓRYCH PRZEDMIOTEM OBROTU JEST GAZ

§ 41

1. Podział Pozycji z kontraktów rocznych na kontrakty kwartalne:

Na jeden dzień przed wykonaniem kontraktu rocznego, w procesie bieżących rozliczeń Izba dokonuje podziału zarejestrowanych przez Izbę Pozycji z kontraktu rocznego o najbliższym okresie dostawy na analogiczną ilość Pozycji na czterech najbliższych kontraktach o kwartalnym okresie dostawy, tym samym łącząc Pozycje z podzielonego kontraktu rocznego z wcześniej zarejestrowanymi przez Izbę Pozycjami na kontraktach kwartalnych o pokrywających się okresach dostawy z ulegającym podziałowi kontraktem rocznym.

2. Podział Pozycji z kontraktów sezonowych na kontrakty kwartalne:

Na jeden dzień przed wykonaniem kontraktu sezonowego, w procesie bieżących rozliczeń Izba dokonuje podziału zarejestrowanych przez Izbę Pozycji z kontraktu sezonowego o najbliższym okresie dostawy na analogiczną ilość Pozycji na dwóch najbliższych kontraktach o kwartalnym okresie dostawy, tym samym łącząc Pozycje z podzielonego kontraktu sezonowego z wcześniej zarejestrowanymi przez Izbę Pozycjami na kontraktach kwartalnych o pokrywających się okresach dostawy z ulegającym podziałowi kontraktem sezonowym.

3. Podział Pozycji z kontraktów kwartalnych na kontrakty miesięczne:

Na jeden dzień przed wykonaniem kontraktu kwartalnego, w procesie bieżących rozliczeń Izba dokonuje podziału zarejestrowanych przez Izbę Pozycji z kontraktu kwartalnego o najbliższym okresie dostawy na analogiczną ilość Pozycji na trzech najbliższych kontraktach o miesięcznym okresie dostawy, tym samym łącząc Pozycje z podzielonego kontraktu kwartalnego z wcześniej zarejestrowanymi przez Izbę Pozycjami na kontraktach miesięcznych o pokrywających się okresach dostawy z ulegającym podziałowi kontraktem kwartalnym.

ROZDZIAŁ V

SPOSÓB I TRYB ROZLICZANIA TRANSAKCJI

Postanowienia ogólne

§ 42

1. Rozliczenie Transakcji zawieranych na rynkach prowadzonych przez TGE nie polega na wstąpieniu Izby w prawa i obowiązki stron tych Transakcji. W procesie rozliczeń Izba staje się stroną rozliczeń na potrzeby prowadzonej obsługi finansowej zawartych Transakcji.
2. Naliczenie i rozliczenie podatku VAT oraz podatku akcyzowego następuje zgodnie z obowiązującymi przepisami.
3. Izba świadczy usługę samofakturowania dla Członków Izby, którzy podpisali z Izbą odpowiednią umowę upoważniającą IRGiT do wystawiania w ich imieniu i na ich rachunek faktur, faktur korygujących i duplikatów. Członkowie Izby, którzy nie podpisali wyżej wymienionej umowy, są zobowiązani do wystawiania faktur zgodnie z Harmonogramem wystawiania faktur stanowiącym załącznik nr 2 do niniejszych Szczegółowych zasad rozliczeń i rozrachunku. W przypadkach szczególnych, przede wszystkim w okresach świątecznych, Izba może wprowadzić zmiany do Harmonogramu wystawiania faktur. Zmiany te są przesyłane Członkom Izby za pośrednictwem poczty elektronicznej z odpowiednim wyprzedzeniem.
4. Transakcje zawarte na giełdzie rozliczane są przez Izbę w polskich złotych, z uwzględnieniem ust. 5.
5. W przypadku Transakcji zawartych na RDB, w ramach którego instrumenty notowane są w walucie euro, wartość zawartych Transakcji, na potrzeby przeprowadzenia procesu rozliczeń i rozrachunku, przeliczana jest przez Izbę w oparciu o Kurs średni euro, publikowany przez Narodowy Bank Polski dla dnia poprzedzającego Dzień Dostawy. W przypadku, gdy Dzień Dostawy przypada na dzień ustawowo wolny od pracy lub pierwszy dzień roboczy następujący po dniu wolnym od pracy wartość zawartych Transakcji przeliczana jest po Kursie średnim euro opublikowanym przez Narodowy Bank Polski w ostatnim dniu roboczym poprzedzającym dzień ustawowo wolny od pracy.

§ 43

1. Członek Izby posiada co najmniej jedno Konto rozliczeniowe w Systemie rozliczeniowym, na którym prowadzone są rozliczenia Transakcji zawartych na RDN, RDB, RDNg, RDBg, RPM i RTP, z uwzględnieniem § 39 ust. 3 i 5. W przypadku prowadzenia działalności na rachunek klientów lub jako reprezentant Członka Giełdy, Członek Izby posiada oddzielne Konta rozliczeniowe dla każdego z klientów lub reprezentowanych Członków Giełdy.
2. W procesie rozliczenia następuje kompensacja pomiędzy należnościami i zobowiązaniami poszczególnych Członków Izby, wynikającymi z Transakcji zawartych na RDN, RDB, RDNg, RDBg, RPM i RTP, z zastrzeżeniem ust. 3.
3. W przypadku, gdy Członek Izby prowadzi jednocześnie działalność na rachunek własny jak i na rachunek inny niż własny, Izba prowadzi rozliczenia Transakcji osobno dla tych rodzajów działalności. Izba nie dokonuje kompensaty pomiędzy należnościami i zobowiązaniami Członka Izby wynikającymi z wykonywanej przez niego działalności na rachunek własny oraz działalności na rachunek klientów lub reprezentowanych Członków Giełdy.

§ 44

1. Proces rozliczeń RPM, RDBg, RDN, RDNg i RTP rozpoczyna się o godzinie 15:30 po otrzymaniu przez Izbę od Giełdy danych dotyczących wszystkich Transakcji zawartych na giełdzie w danym Dniu Obrotu i potwierdzenia ostateczności tych danych.
2. Proces rozliczeń RDB rozpoczyna się o godzinie 13:00 po otrzymaniu przez Izbę od Giełdy danych dotyczących wszystkich Transakcji zawartych na giełdzie pomiędzy godziną 13:00 w Dniu N-1 a godziną 13:00 w Dniu N i potwierdzenia ostateczności tych danych.
3. Z chwilą potwierdzenia przez Giełdę danych dotyczących Transakcji, o których mowa w ust. 1 oraz ust. 2 stają się one nieodwołalne dla Giełdy i podmiotów trzecich.
4. Po zakończeniu procesu rozliczeń wszystkich rynków w Dniu N (w dni robocze do godziny 18:30, natomiast w dni wolne od pracy do godziny 17:30) Izba udostępnia w Systemie rozliczeniowym zaktualizowane dokumenty, o których mowa w § 35 ust. 1 Regulaminu w formie Raportu rozliczeniowego. W sytuacjach nadzwyczajnych godziny udostępnienia Raportu rozliczeniowego mogą ulec zmianie.

§ 45

1. Członek Izby zobowiązany jest wskazać Izbie Rachunek rozliczeniowy w BPCI, z zastrzeżeniem § 5 ust. 3. W przypadku, gdy Członek Izby prowadzi jednocześnie działalność na rachunek własny jak i działalność na rachunek inny niż własny, Członek Izby zobowiązany jest wskazać Izbie dwa odrębne Rachunki rozliczeniowe dedykowane dla tych rodzajów działalności.
2. Członek Izby zobowiązany jest do udzielenia BPCI pełnomocnictwa do składania dyspozycji w zakresie dokonania przelewu środków z Rachunku rozliczeniowego Członka Izby na Rachunek techniczny w danym BPCI w wysokości wskazanej przez Izbę w Raporcie rozliczeniowym.

Zasady ustalania wysokości należności i zobowiązań z tytułu Transakcji zawartych na RDN

§ 46

1. W każdym Dniu Obrotu po zarejestrowaniu Pozycji z Transakcji, za których rozliczenie odpowiada dany Rozliczający Członek Izby, Izba na poszczególnych Kontach rozliczeniowych Rozliczającego Członka Izby i odpowiednio jego klientów lub reprezentowanych Członków Giełdy, dokonuje bieżących rozliczeń Transakcji sesyjnych zawartych na RDN w Dniu Obrotu.
2. Suma sald rozliczeń poszczególnych Kont rozliczeniowych, za których rozliczenie odpowiada dany Rozliczający Członek Izby, jest określana jako różnica wartości Transakcji sprzedaży i kupna zawartych na RDN w Dniu Obrotu przy jednoczesnym powiększeniu o wartość podatku VAT.
3. Dla Podmiotów zagranicznych, o ile nic innego nie wynika z obowiązujących przepisów prawa, saldo rozliczeń nie jest powiększane o podatek VAT.
4. Wartość Transakcji zawartych na RDN obliczana jest jako iloczyn wolumenu Transakcji, nominału instrumentu liczonego w MWh oraz kursu Transakcji wyrażonego jako PLN/MWh.

Zasady ustalania wysokości należności i zobowiązań z tytułu Transakcji zawartych na RDB

§ 47

1. W każdym Dniu N po zarejestrowaniu Pozycji z Transakcji, za których rozliczenie odpowiada dany Rozliczający Członek Izby, Izba na poszczególnych Kontach rozliczeniowych Rozliczającego Członka Izby i odpowiednio jego klientów lub reprezentowanych Członków Giełdy dokonuje rozliczeń Transakcji zawartych na RDB pomiędzy godziną 13:00 w Dniu N-1 a godziną 13:00 w Dniu N.
2. W przypadku, gdy przedmiotem Transakcji zawartych na RDB jest kontrakt blokowy, rozliczeniu podlegają osobno poszczególne godziny tego kontraktu.
3. Suma sald rozliczeń poszczególnych Kont rozliczeniowych, za których rozliczenie odpowiada dany Rozliczający Członek Izby, jest określana jako różnica wartości Transakcji sprzedaży i kupna zawartych na RDB pomiędzy godziną 13:00 w Dniu N-1 a godziną 13:00 w Dniu N, przy jednoczesnym powiększeniu o wartość podatku VAT.
4. Dla Podmiotów zagranicznych, o ile nic innego nie wynika z obowiązujących przepisów prawa, saldo rozliczeń nie jest powiększane o podatek VAT.
5. Wartość Transakcji zawartych na RDB obliczana jest jako iloczyn wolumenu Transakcji, nominału instrumentu liczonego w MWh oraz kursu Transakcji wyrażonego jako PLN/MWh.

Zasady ustalania wysokości należności i zobowiązań z tytułu realizacji Transakcji zawartych na RTP

§ 48

1. W każdym roboczym Dniu N Izba na poszczególnych Kontach rozliczeniowych Rozliczającego Członka Izby i odpowiednio jego klientów lub reprezentowanych Członków Giełdy, dokonuje bieżących rozliczeń Transakcji sesyjnych i pozasesyjnych, dla których otrzymała polecenie rozliczenia, których dostawa nastąpi w Dniu N+1. W pierwszym dniu roboczym następującym po dniu wolnym od pracy Izba dokonuje rozliczeń Transakcji sesyjnych które nie zostały rozliczone do Dnia N+1.
2. Suma sald rozliczeń poszczególnych Kont rozliczeniowych, za których rozliczenie odpowiada dany Rozliczający Członek Izby, jest określana jako różnica wartości dostarczanej w Dniu N+1 energii elektrycznej lub Gazu wynikającej z Transakcji sprzedaży i kupna zawartych na RTP, przy jednoczesnym powiększeniu o wartość

podatku VAT oraz podatku akcyzowego naliczonego zgodnie z obowiązującymi przepisami.

3. Dla Podmiotów zagranicznych, o ile nic innego nie wynika z obowiązujących przepisów prawa, saldo rozliczeń nie jest powiększane o podatek VAT, jest natomiast, o ile wymagają tego przepisy prawa, powiększane o podatek akcyzowy.
4. Wartość Transakcji zawartych na RTP (przedmiotem których jest energia elektryczna lub Gaz) obliczana jest jako iloczyn wolumenu Transakcji, nominału instrumentu liczonego w MWh oraz kursu Transakcji wyrażonego jako PLN/MWh.

Zasady ustalania wysokości należności i zobowiązań z tytułu Transakcji zawartych na RPM

§ 49

1. W każdym dniu zawarcia Transakcji, po zarejestrowaniu Pozycji z Transakcji, za których rozliczenie odpowiada dany Rozliczający Członek Izby, Izba na poszczególnych Kontach rozliczeniowych Rozliczającego Członka Izby i odpowiednio jego klientów lub reprezentowanych Członków Giełdy dokonuje bieżących rozliczeń Transakcji sesyjnych zawartych w Dniu Obrotu na RPM i pozasesyjnych, dla których otrzymała polecenie rozliczenia.
2. Suma sald rozliczeń poszczególnych Kont rozliczeniowych, za których rozliczenie odpowiada dany Rozliczający Członek Izby, jest określana jako różnica wartości Transakcji sprzedaży i kupna zawartych na RPM w Dniu Obrotu bądź w ramach transakcji pozasesyjnych, dla których Izba otrzymała polecenie rozliczenia, przy jednoczesnym powiększeniu o wartość podatku VAT.
3. Dla Podmiotów zagranicznych, o ile nic innego nie wynika z obowiązujących przepisów prawa, saldo rozliczeń nie jest powiększane o podatek VAT.
4. Wartość Transakcji zawartych na RPM obliczana jest jako:
 - a) Iloczyn wolumenu Transakcji liczonego w kWh oraz kursu Transakcji wyrażonego jako PLN/MWh podzielony przez 1 000, dla Praw Majątkowych ŚP ze świadectw pochodzenia, w rozumieniu przepisów Ustawy Prawo Energetyczne,
 - b) Iloczyn wolumenu Transakcji liczonego w Toe oraz kursu Transakcji wyrażonego jako PLN/Toe podzielony przez 1 000, dla Praw Majątkowych ŚP ze świadectw efektywności energetycznej, w rozumieniu przepisów Ustawy o efektywności energetycznej.

Zasady ustalania wysokości należności i zobowiązań z tytułu Transakcji zawartych na RDNg i RDBg

§ 50

1. W każdym Dniu Obrotu po zarejestrowaniu Pozycji z Transakcji, za których rozliczenie odpowiada dany Rozliczający Członek Izby, Izba na poszczególnych Kontach rozliczeniowych Rozliczającego Członka Izby i odpowiednio jego klientów lub reprezentowanych Członków Giełdy dokonuje bieżących rozliczeń Transakcji sesyjnych zawartych na RDNg i RDBg w Dniu Obrotu.
2. Suma sald rozliczeń poszczególnych Kont rozliczeniowych, za których rozliczenie odpowiada dany Rozliczający Członek Izby, jest określana jako różnica wartości Transakcji sprzedaży i kupna zawartych na RDNg i RDBg w Dniu Obrotu przy jednoczesnym powiększeniu o wartość podatku VAT oraz podatku akcyzowego naliczonego zgodnie z obowiązującymi przepisami.
3. Dla Podmiotów zagranicznych, o ile nic innego nie wynika z obowiązujących przepisów prawa, saldo rozliczeń nie jest powiększane o podatek VAT, jest natomiast, o ile wymagają tego przepisy prawa, powiększane o podatek akcyzowy.
4. Wartość Transakcji zawartych na RDNg i RDBg obliczana jest jako iloczyn wolumenu Transakcji, nominału instrumentu liczonego w MWh oraz kursu Transakcji wyrażonego jako PLN/MWh.

ROZDZIAŁ VI

SPOSÓB I TRYB ROZRACHUNKU TRANSAKCJI

§ 51

1. Funkcję Banku Płatnika Izby dla rozrachunków pieniężnych Transakcji oraz aktualizacji depozytów zabezpieczających pełni Deutsche Bank Polska S.A.
2. Rozrachunek pieniężny Transakcji oraz aktualizacja depozytów zabezpieczających dla wszystkich Rozliczających Członków Izby, będących stroną Transakcji zawartych na RDN, RDB, RDBg, RDNg, RPM i RTP, Izba prowadzi w polskich złotych, za pośrednictwem BPI oraz wszystkich BPCI.

3. W celu zapewnienia bezpiecznego i sprawnego przebiegu rozrachunków pieniężnych Transakcji oraz aktualizacji depozytów zabezpieczających Izba współpracuje z BPI oraz wszystkimi BPCI zgodnie z Harmonogramem.
4. Rozrachunek pieniężny Transakcji z Zagraniczną izbą rozliczeniową może być prowadzony poza Bankiem Rozliczeniowym. W takim przypadku Zagraniczna izba rozliczeniowa jest zobowiązana do regulowania swoich zobowiązań poprzez wpłatę środków bezpośrednio na rachunek wskazany przez IRGiT przed dokonaniem rozrachunku pieniężnego przez Izbę w terminie określonym uchwałą Zarządu IRGiT.
5. Zobowiązania bądź należności Zagranicznej izby rozliczeniowej mogą być powiększone lub pomniejszone o płatności wynikające z Transakcji zawartych na giełdzie, które wykonywane będą poza Krajowym Systemem.

Zasady przekazywania informacji pomiędzy Izbą, BPI oraz BPCI

§ 52

1. W każdy dzień roboczy Izba przygotowuje dane do rozrachunku pieniężnego i aktualizacji depozytów zabezpieczających, wykonywanych za pośrednictwem Banku Płatnika Izby we współpracy ze wszystkimi BPCI. Dane mają formę Raportów kontrolnych.
2. Raporty kontrolne zawierają płatności wszystkich Rozliczających Członków Izby wynikające z aktualizacji depozytów zabezpieczających dla RTP oraz salda płatności obliczone jako suma sald rozliczeń Transakcji z rynków RDN, RDB, RDNg, RDBg, RPM i RTP, w ramach danej działalności. Raporty kontrolne są przekazywane do poszczególnych Banków Płatników Członków Izby i stanowią podstawę rozrachunku realizowanego przez Izbę za pośrednictwem BPI i BPCI.

§ 53

1. Do Raportów kontrolnych, sporządzanych w roboczym Dniu N, wliczane są zobowiązania i należności poszczególnych Członków Izby, wynikające z:
 - a) aktualizacji w Dniu N depozytów zabezpieczających dla kontraktów terminowych zawartych na RTP;
 - b) Transakcji zawartych na RPM, RDBg z dostawą w Dniu N;
 - c) Transakcji zawartych na RDN, RDNg i RTP z dostawą na Dzień N+1;

- d) Transakcji zawartych na RDB z dostawą na Dzień N-1.
2. W przypadku, gdy roboczy Dzień N jest pierwszym dniem roboczym następującym po dniu wolnym od pracy do Raportu kontrolnego wliczane są dodatkowo zobowiązania i należności wynikające z:
- a) Transakcji zawartych na RDBg z dostawą w każdy dzień wolny poprzedzający roboczy Dzień N;
 - b) Transakcji zawartych na RDN, RDNg i RTP z dostawą na Dzień N+1 w stosunku do każdego dnia wolnego poprzedzającego roboczy Dzień N;
 - c) Transakcji zawartych na RDB z dostawą w każdy dzień wolny od pracy poprzedzający Dzień N-1 oraz ostatni dzień roboczy bezpośrednio poprzedzający dni wolne od pracy.
3. Raporty kontrolne mogą zostać rozszerzone przez Izbę o wszelkie zobowiązania bądź należności Rozliczających Członków Izby wobec Izby lub Giełdy wynikające z ich członkostwa w Izbie lub Giełdzie, w tym wynikające z tytułu należności, o których mowa w ust. 1 i 2 powyżej, w sytuacji określonej w § 38 ust 3 i 4.
4. Raporty kontrolne przekazywane są do poszczególnych BPCI w robocze Dni N do godziny 17:30. Raporty kontrolne przekazywane w pierwszy roboczy dzień po dniu wolnym od pracy zawierają skompensowane saldo płatności wyliczone w dni wolne od pracy i pierwszy następujący po nich dzień roboczy.
5. W przypadku dokonania przez Giełdę rekalkulacji Ceny Rozliczeniowej opisanej w „Szczegółowych zasadach obrotu i rozliczeń dla energii elektrycznej na Rynku Dnia Następnego” Raporty kontrolne mogą zostać przekazane do BPCI po godzinie 17:30. W takim przypadku Izba informuje Rozliczających Członków Izby, BPI oraz BPCI o zaistniałej sytuacji.
6. Raporty kontrolne dla poszczególnych BPCI stanowią potwierdzenie informacji uwzględnionych w Raporcie rozliczeniowym.
7. W pierwszym dniu roboczym po dniu przekazania Raportów kontrolnych do poszczególnych BPCI wykonują one operacje zgodnie z Harmonogramem oraz dyspozycjami zawartymi w paczkach zleceń zrealizowanych przy współpracy z BPI.

§ 54

1. Podstawą wymiany informacji pomiędzy BPI, a BPCI są następujące Komunikaty SWIFT:

- a) SWIFT MT101 – wysyłany przez BPCI zawiera wszystkie zlecenia płatnicze do zrealizowania przez BPCI;
 - b) SWIFT MT942 – wysyłany przez BPCI zawiera informacje o wszystkich operacjach wykonanych na Rachunku technicznym, do momentu jego wygenerowania;
 - c) SWIFT MT940 – wysyłany przez BPCI, zawiera informacje o wszystkich operacjach wykonanych na Rachunku technicznym.
2. BPCI realizuje dyspozycje płatnicze otrzymane od BPI w formie Komunikatów SWIFT MT 101. Dyspozycje te są zgodne z Raportami kontrolnymi.

§ 55

1. BPCI ma prawo zastrzec wykonanie zlecenia płatniczego obciążającego Rachunek rozliczeniowy wybranego Członka Izby, na zasadach i w sposób określony w umowie BPCI z IRGiT.
2. Zastrzeżenie płatności dla rozrachunku pieniężnego Transakcji zawartych na giełdzie, o których mowa w § 59 ust. 1 lit. a), może nastąpić tylko w przypadku, gdy dodatkowe zabezpieczenia płynności, o których mowa w § 59 ust. 3 nie wystarczają na pokrycie zobowiązań Rozliczającego Członka Izby.
3. Zastrzeżenie płatności dla aktualizacji depozytów zabezpieczających, o których mowa w § 59 ust. 1 lit. c) może nastąpić w przypadku, gdy Członek Izby nie zapewnił odpowiedniej ilości środków na swoim Rachunku rozliczeniowym.
4. W wypadku zastrzeżenia płatności przez BPCI, wartości przelewu pomiędzy Rachunkiem technicznym i Rachunkiem rozliczeniowym w Raporcie kontrolnym wysłanym przez Izbę do BPCI zgodnie z § 53 ust. 4., a rzeczywistą kwotą dyspozycji wysłaną przez BPI za pomocą Komunikatu SWIFT MT 101, mogą być różne. W takim wypadku Izba wysyła do BPCI, który zastrzegł płatność korektę Raportu kontrolnego.
5. W wypadku wystąpienia zastrzeżenia płatności dla rozrachunku pieniężnego Transakcji giełdowych, o którym mowa w ust. 2 powyżej Izba w pierwszej kolejności korzysta ze środków pieniężnych zgromadzonych przez Rozliczającego Członka Izby na Rachunku depozytów transakcyjnych. W przypadku, gdy środki pieniężne Rozliczającego Członka Izby zdeponowane na Rachunku depozytów transakcyjnych podzielone są na Podstawowy limit transakcyjny, Limit transakcyjny RCG oraz Limit transakcyjny dedykowany RDB, w pierwszej kolejności Izba pokrywa zobowiązania Rozliczającego Członka Izby środkami pieniężnymi stanowiącymi Podstawowy limit transakcyjny, jednocześnie pomniejszając ten limit o kwotę zastrzeżenia płatności. W przypadku, gdy kwota zastrzeżenia płatności jest wyższa niż wysokość Podstawowego limitu

transakcyjnego, Izba w następnej kolejności wykorzystuje środki pieniężne stanowiące Limity transakcyjne RCG Członków Giełdy reprezentowanych przez tego Członka Izby, pomniejszając najpierw Podstawowy limit transakcyjny RCG a następnie Limit transakcyjny RCG dedykowany RDB, a w dalszej kolejności Limit transakcyjny dedykowany RDB tego Członka Izby, w celu pokrycia kwoty zastrzeżonej płatności. Jeżeli kwota zastrzeżonej płatności jest wyższa niż suma wykorzystywanych na Limit transakcyjny środków pieniężnych zdeponowanych przez Rozliczającego Członka Izby na Rachunku depozytów transakcyjnych, Izba pokrywa brakującą kwotę zastrzeżenia płatności środkami pieniężnymi danego Członka Izby, stanowiącymi depozyt dostawy oraz depozyt historyczny.

6. W przypadku wykorzystania środków stanowiących depozyt dostawy i depozyt historyczny, o których mowa § 10 oraz § 11, do pokrycia zastrzeżonego zlecenia płatniczego, o którym mowa w § 55 ust. 2., Rozliczający Członek Izby zobowiązany jest do uzupełnienia wartości depozytu dostawy i depozytu historycznego do wymaganego poziomu nie później niż do godz. 16:00 w dniu wystąpienia zastrzeżenia. Brak wniesienia Wpłaty odtworzeniowej lub brak możliwości jej pokrycia poprzez pomniejszenie Podstawowego limitu transakcyjnego, Limitu transakcyjnego RCG oraz Limitu transakcyjnego dedykowanego RDB danego Rozliczającego Członka Izby może stanowić przesłankę do stwierdzenia przez Izbę Przepadku naruszenia w rozumieniu Regulaminu oraz podjęcia działań, o których mowa w § 54 Regulaminu..
7. W przypadku, gdy z zastrzeżeniem § 5 ust. 5 wszystkie środki na subkoncie Rachunku depozytów transakcyjnych są niewystarczające do pokrycia zastrzeżonego zlecenia płatniczego danego Członka Izby, IRGiT do przeprowadzenia rozrachunku wykorzystuje środki pieniężne zgromadzone na subkoncie Rachunku depozytów zabezpieczających danego Rozliczającego Członka Izby.
8. W przypadku, gdy z zastrzeżeniem § 5 ust. 5 zarówno środki na subkoncie Rachunku depozytów transakcyjnych oraz środki na subkoncie Rachunku depozytów zabezpieczających są niewystarczające do pokrycia zastrzeżonego zlecenia płatniczego danego Członka Izby, Izba wykorzystuje do przeprowadzenia rozrachunku środki własne o których mowa w § 45o Regulaminu.
9. W dalszej kolejności, Izba wzywa Członka Izby do zwrotu wykorzystanych środków o których mowa w ust. 8 oraz uzupełnienia depozytów zabezpieczających, depozytu dostawy, depozytu historycznego oraz minimalnej wpłaty na depozyty transakcyjne do wymaganych wartości. Dodatkowo, gdy wykorzystane zostały środki, o których mowa w ust. 8, Członek Izby zobowiązany jest zwrócić kwotę naliczonych odsetek lub opłat bankowych powstałych z tego tytułu.

10. W wypadku wystąpienia zastrzeżenia płatniczego dla rozrachunku pieniężnego Transakcji giełdowych, o którym mowa w ust. 2 powyżej lub wystąpienia zastrzeżenia płatności dla aktualizacji depozytów zabezpieczających, o którym mowa w ust. 3 powyżej, Izba może dokonać niezwłocznego wykorzystania wszystkich zabezpieczeń niepieniężnych wniesionych przez tego Członka Izby w poczet zabezpieczenia depozytu transakcyjnego i depozytu zabezpieczającego.
11. Brak zwrotu przez Rozliczającego Członka Izby wykorzystanych środków o których mowa w ust. 8 lub brak uzupełnienia depozytów zabezpieczających, depozytu dostawy, depozytu historycznego oraz minimalnej wpłaty na depozyty transakcyjne do wymaganych wartości może stanowić przesłankę do stwierdzenia Przypadku naruszenia w rozumieniu Regulaminu.

§ 56

1. Po wykonaniu każdej z paczek zleceń płatniczych, o których mowa w § 59 ust. 1, każdy BPCI wysyła Komunikat SWIFT MT 942 dla Rachunku technicznego zgodnie z Harmonogramem.
2. Po zakończeniu procesu rozrachunku, BPCI wysyła Komunikat SWIFT MT 940 dla Rachunku technicznego zgodnie z Harmonogramem.
3. BPCI, który złożył pisemne zobowiązanie, do wysyłania Komunikatów SWIFT MT 942 oraz MT 940 z Rachunku rozliczeniowego domu maklerskiego lub towarowego domu maklerskiego wykonuje operacje zgodnie z Harmonogramem.

Obsługa Rozliczających Członków Izby w ramach rozrachunku pieniężnego

§ 57

1. Do obsługi finansowej Rozliczającego Członka Izby dedykowane są następujące rachunki bankowe:
 - a) Subkonto Rachunku depozytów transakcyjnych w Banku Płatniku Izby;
 - b) Rachunek rozliczeniowy w BPCI;
 - c) Subkonto Rachunku depozytów zabezpieczających w BPI, jeśli dany Członek Izby jest dopuszczony do działania na RTP.

2. Rachunkiem Członka Izby uznawanym lub obciążanym z tytułu rozliczeń Transakcji oraz z tytułu aktualizacji wymaganych depozytów zabezpieczających dla RTP jest Rachunek rozliczeniowy w BPCI, z zastrzeżeniem § 5 ust. 3.
3. Na subkontach Rachunku depozytów transakcyjnych znajdują się środki stanowiące depozyt dostawy, depozyt historyczny oraz środki pieniężne stanowiące podstawę wyznaczania Limitów transakcyjnych Rozliczających Członków Izby, z zastrzeżeniem § 5 ust. 5. Wpłaty na subkonto Rachunku depozytów transakcyjnych są wykonywane przez Rozliczającego Członka Izby.
4. Na subkontach Rachunku depozytów zabezpieczających znajdują się środki pieniężne stanowiące pokrycie depozytów zabezpieczających dla RTP wymaganych od Rozliczających Członków Izby, z zastrzeżeniem § 5 ust. 5. Wpłaty i wypłaty z subkonta Rachunku depozytów zabezpieczających są wykonywane automatycznie przez Izbę.
5. W celu wykonywania rozrachunku Rozliczających Członków Izby w BPCI, IRGiT posiada Rachunek techniczny w każdym BPCI oraz Rachunek rozliczeniowy w BPI.

§ 58

1. W wypadku, gdy z tytułu rozliczeń Transakcji oraz z tytułu aktualizacji depozytów zabezpieczających Rozliczający Członek Izby posiada:
 - a) Saldo zobowiązań, wtedy rachunkiem obciążanym jest Rachunek rozliczeniowy, zaś uznawanym Rachunek techniczny;
 - b) Saldo należności, wtedy rachunkiem obciążanym jest Rachunek techniczny, zaś uznawanym Rachunek rozliczeniowy.
2. Transfery międzybankowe wykonywane są jako salda zobowiązań i należności wszystkich Członków Izby w BPCI, za pośrednictwem Rachunku rozliczeniowego Izby w BPI.

§ 59

1. Dyspozycje płatnicze zgodne z Raportami kontrolnymi przekazywane są do realizacji przez BPCI w podziale na cztery paczki zleceń:
 - a) Paczka zleceń płatniczych numer 1 – dotyczy rozrachunku Transakcji zawartych na giełdzie i zawiera zlecenia przelewów obciążających Rachunki rozliczeniowe w BPCI dla Członków Izby, posiadających saldo zobowiązań;
 - b) Paczka zleceń płatniczych numer 2 – dotyczy rozrachunku Transakcji zawartych na giełdzie i zawiera zlecenia przelewów uznających Rachunki rozliczeniowe w BPCI dla

Członków Izby, posiadających saldo należności oraz zlecenia transferów międzybankowych za pośrednictwem Rachunku rozliczeniowego Izby w BPI;

- c) Paczka zleceń płatniczych numer 3 – dotyczy aktualizacji depozytów zabezpieczających dla RTP i zawiera zlecenia przelewów obciążających Rachunki rozliczeniowe w BPCI dla Członków Izby, posiadających saldo zobowiązań oraz obciążających subkonta Rachunku depozytów zabezpieczających dla Członków Izby, posiadających saldo należności;
 - d) Paczka zleceń płatniczych numer 4 – dotyczy aktualizacji depozytów zabezpieczających dla RTP i zawiera zlecenia przelewów uznających Rachunki rozliczeniowe w BPCI dla Członków Izby, posiadających saldo należności oraz uznających subkonta Rachunku depozytów zabezpieczających dla Członków Izby, posiadających saldo zobowiązań oraz zlecenie transferów międzybankowych za pośrednictwem Rachunku rozliczeniowego Izby w BPI.
2. IRGiT przekazuje do realizacji dyspozycje płatnicze, o których mowa ust. 1 zgodnie z Harmonogramem.
 3. Członkowie Izby, przy współpracy z wybranymi przez siebie BPCI, zobowiązani są do utrzymywania i zabezpieczania odpowiedniej płynności finansowej na Rachunkach rozliczeniowych, w sposób umożliwiający realizację zleceń płatniczych, o których mowa w ust. 1, zgodnie z Harmonogramem. Niewywiązanie się z obowiązku Członka Izby określonego w zdaniu pierwszym może stanowić przesłankę do stwierdzenia przez Izbę Przypadku naruszenia w rozumieniu Regulaminu oraz podjęcia działań, o których mowa w § 54 Regulaminu.
 4. Rozrachunek pieniężny Zagranicznej izby rozliczeniowej, prowadzony poza Bankiem Rozliczeniowym realizowany jest poprzez pobranie środków wpłaconych na konto wskazane przez IRGiT w przypadku posiadania przez Zagraniczną izbę rozliczeniową salda zobowiązań oraz poprzez wpłatę środków przez Izbę na konto wskazane przez Zagraniczną izbę rozliczeniową w przypadku posiadania przez Zagraniczną izbę rozliczeniową salda należności.

Rozrachunek energii elektrycznej

§ 60

1. Transakcje, których przedmiotem jest energia elektryczna, rozliczane przez Izbę, zgłaszane są saldem do OSPe w podziale na Jednostki Grafikowe przydzielone przez OSPe Rozliczającym Członkom Izby i odpowiednio ich klientom, reprezentowanym przez Członków Izby Członkom Giełdy oraz Giełdzie.
2. Przed wysłaniem zgłoszenia do OSPe w dniu zawarcia Transakcji (Dzień T), Izba umożliwia Rozliczającym Członkom Izby dokonywanie w Systemie rozliczeniowym zmian w zakresie edycji opisu Transakcji, podziału wolumenu Transakcji oraz przeniesienia Transakcji pomiędzy Kontami ewidencyjnymi utworzonymi dla danego Członka Izby w zakresie danego rodzaju prowadzonej działalności, służącymi do rejestrowania Transakcji, o których mowa w § 39 ust. 3. Zmiany, o których mowa powyżej mogą być przeprowadzane w określonych poniżej ramach czasowych:
 - Transakcje zawarte na RDB z dostawą w Dniu T – nie później niż na 2 godziny przed rozpoczęciem dostawy;
 - Transakcje zawarte na RDB z dostawą w Dniu T +1 - do 22:00
 - Transakcje zawarte na RDN z dostawą w Dniu T+1 – do 13:50;
 - Transakcje zawarte na RDN z dostawą w Dniu T+2 i T+3 – do 15:30
 - Transakcje zawarte na RTPE – do 15:30.
3. Wszelkie zmiany na grafikach z dostawą energii elektrycznej dla dnia następnego, dokonane po godzinie 13:50, nie zostaną uwzględnione w zgłoszeniu przekazanym do OSPe.
4. Zgłoszenie wykonywane jest na Jednostkach Grafikowych należących do Giełdy. Zmiana Jednostek Grafikowych, na które zgłaszane będą Transakcje, dokonywana jest uchwałą Zarządu IRGiT i jest podawana do wiadomości Rozliczających Członków Izby najpóźniej na tydzień przed jej dokonaniem.
5. Szczegółowe zasady rozrachunku energii elektrycznej określone są w IRiESPe oraz w odpowiednich Szczegółowych Zasadach Obrotu i Rozliczeń Towarowej Giełdy Energii S.A.

Rozrachunek Praw Majątkowych ŚP na Rynku Praw Majątkowych

§ 61

1. W Dniu N po zakończeniu rozliczenia Transakcji Izba przekazuje do Rejestru Świadczeń Pochodzenia plik zawierający salda zobowiązań i należności poszczególnych Rozliczających Członków Izby wyrażone w Prawach Majątkowych ŚP.
2. Do godziny 13:30 w dniu zawarcia Transakcji, Rozliczający Członkowie Izby mogą dokonywać w Systemie rozliczeniowym zmian w zakresie edycji opisu Transakcji oraz podziału wolumenu Transakcji. Wszelkie zmiany dokonane przez Rozliczającego Członka Izby po godzinie 13:30 mogą zostać nieuwzględnione przez Rejestr Świadczeń Pochodzenia.
3. Realizacja Transakcji zawartych na RPM następuje poprzez zmianę stanu posiadania poszczególnych Praw Majątkowych ŚP na Kontach ewidencyjnych Rozliczających Członków Izby w odpowiednim rejestrze prowadzonym przez Giełdę:
 - a) rejestrze świadectw pochodzenia, o którym mowa w Ustawie Prawo Energetyczne,
 - b) rejestrze świadectw efektywności energetycznej, o którym mowa w Ustawie o efektywności energetycznej.
4. W przypadku zawarcia Transakcji przez Rozliczającego Członka Izby na rachunek klienta lub reprezentowanego Członka Giełdy, proces przeksięgowania Praw Majątkowych ŚP jest dokonywany z wykorzystaniem Konta ewidencyjnego klienta lub reprezentowanego Członka Giełdy w Rejestrze Świadczeń Pochodzenia.

Zawieszenie rozliczeń Transakcji. Postępowanie w przypadku braku dostatecznej ilości Praw Majątkowych ŚP na koncie Członka Rejestru Świadczeń Pochodzenia w trybie normalnym. Transakcja kupna na TGE brakującej ilości Praw Majątkowych ŚP w trybie Transakcji pozasesyjnej lub sesyjnej na RPM

§ 62

1. W przypadku konieczności zawieszenia rozliczenia przez Izbę Transakcji giełdowej z RPM z powodu braku w Rejestrze Świadczeń Pochodzenia dostatecznej ilości Praw Majątkowych ŚP Rozliczającego Członka Izby, IRGiT niezwłocznie komunikuje się ze stronami Transakcji, nie później niż w dniu następującym po dniu zawarcia takiej Transakcji do godziny 9:00.

2. W przypadku, gdy stroną Transakcji zobowiązaną do dokupienia Praw Majątkowych ŚP jest Członek Izby prowadzący działalność na rachunek inny niż własny, realizuje on Zlecenie na rzecz klienta lub reprezentowanego Członka Giełdy, na rachunek którego dokonał sprzedaży.
3. W przypadku, gdy stroną Transakcji zobowiązaną do dokupienia Praw Majątkowych ŚP jest inny Rozliczający Członek Izby niż wskazany w ust. 2, realizuje on Zlecenie na własny rachunek.
4. Izba blokuje, na własnym rachunku w Banku Rozliczeniowym, środki pieniężne wpłacone przez stronę kupującą na rozliczenie Transakcji, która została zawieszona.
5. Środki pieniężne, o których mowa w ust. 4, wykorzystane zostają do rozrachunku pieniężnego Transakcji kupna brakującej ilości Praw Majątkowych ŚP. Strona zobowiązana do dokupienia Praw Majątkowych ŚP pokrywa różnicę kursową przy rozrachunku pieniężnym tej Transakcji.
6. Strona zobowiązana do dokupienia brakującej ilości Praw Majątkowych ŚP, na bieżąco informuje Izbę o podjętych działaniach i ich rezultatach.
7. Uzupelnienie brakującej ilości Praw Majątkowych ŚP następuje poprzez złożenie przez Rozliczającego Członka Izby Zlecenia kupna i zawarcie Transakcji sesyjnej lub pozasesyjnej rozliczanej na TGE. Strona kupująca zobowiązana jest niezwłocznie poinformować Izbę o złożeniu Zlecenia w Systemie Informatycznym Giełdy oraz przekazać jej pisemne potwierdzenie tego Zlecenia.
8. Uzupelnienie brakującej ilości Praw Majątkowych ŚP powinno nastąpić co najmniej w najbliższym Dniu Obrotu na giełdzie przewidywanym w harmonogramie. Brak uzupelnienia odpowiedniej ilości Praw Majątkowych ŚP może stanowić przesłankę do stwierdzenia Przypadku naruszenia w rozumieniu Regulaminu.

Transakcja kupna brakującej ilości Praw Majątkowych ŚP w trybie dodatkowym Transakcji pozasesyjnej na RPM

§ 63

1. Zarząd Giełdy w porozumieniu z Izbą może zezwolić na zawarcie Transakcji pozasesyjnej, na pisemny wniosek podmiotu zobowiązanego do kupna brakującej ilości Praw Majątkowych ŚP.
2. Transakcja pozasesyjna zostaje zawarta na RPM i rozliczona przez Izbę poza ustalonymi w odpowiednich regulacjach Giełdy i Izby dniami.

Tryb postępowania po wykonaniu dokupienia Praw Majątkowych ŚP

§ 64

1. Po zawarciu Transakcji dokupienia Praw Majątkowych ŚP następuje ostateczne rozliczenie przez Izbę Transakcji, które zostało zawieszona.
2. Transakcja dokupienia Praw Majątkowych ŚP zostaje rozliczona finansowo oraz w Prawach Majątkowych ŚP.
3. W przypadku Transakcji dokupienia Praw Majątkowych ŚP w trybie Transakcji pozasesyjnej, rozliczenie w Prawach Majątkowych ŚP następuje niezwłocznie po zawarciu Transakcji. Rozliczenie finansowe następuje w najbliższym terminie wykonywania rozrachunku pieniężnego przez Bank Rozliczeniowy.
4. Po rozliczeniu Transakcji nabycia dodatkowych Praw Majątkowych ŚP wykonywane jest rozliczenie Transakcji, której rozliczenie zostało zawieszona, poprzez rozliczenie finansowe i wprowadzenie do systemu informatycznego rejestru parametrów takiej Transakcji.
5. Rozliczenia finansowe dokonywane są z wykorzystaniem środków pieniężnych, o których mowa w § 62 ust. 4 oraz korygowane są o ewentualne różnice kursowe. Izba oblicza korektę oraz wystawia stosowne dokumenty płatnicze.

Rozrachunek Gazu

§ 65

1. Transakcje, których przedmiotem jest Gaz, rozliczane przez Izbę, zgłaszane są saldem do OSPg w podziale na Kody ZUP przydzielone przez OSPg Rozliczającym Członkom Izby i odpowiednio ich klientom lub reprezentowanym Członkom Giełdy.
2. Przed wysłaniem zgłoszenia do OSPg w dniu zawarcia Transakcji, Izba umożliwia Rozliczającym Członkom Izby dokonywanie w Systemie rozliczeniowym zmian w zakresie edycji opisu Transakcji, podziału wolumenu Transakcji oraz przeniesienia Transakcji pomiędzy Kontami ewidencyjnymi utworzonymi dla danego Członka Izby w zakresie danego rodzaju prowadzonej działalności, służącymi do rejestrowania Transakcji, o których mowa w § 39 ust. 5. Zmiany, o których mowa powyżej mogą być przeprowadzane w określonych poniżej ramach czasowych:

- Transakcje zawarte na RDBg –do 15:30;
 - Transakcje zawarte na RDNg – do 15:30;
 - Transakcje zawarte na RTPG – do 15:30.
3. Zgłoszenie wykonywane jest przez TGE w imieniu Rozliczających Członków Izby oraz odpowiednio ich klientów i reprezentowanych Członków Giełdy poprzez złożenie Nominacji, na podstawie danych uzyskanych z Systemu rozliczeniowego Izby.
4. Szczegółowe zasady dostawy Gazu określone są w IRiESPg oraz w odpowiednich Szczegółowych Zasadach Obrotu i Rozliczeń Towarowej Giełdy Energii S.A.

Rozrachunek i rozliczenie Transakcji w obrocie energią elektryczną zawieranych na giełdach i wykonywanych poza Krajowym Systemem

§ 66

1. W ramach organizacji i prowadzenia rozliczeń Transakcji zawieranych w obrocie energią elektryczną na giełdzie, które są wykonywane poza Krajowym Systemem, Izba w szczególności:
- a) ustala wielkość świadczeń niepieniężnych, do spełnienia których są zobowiązani, lub do których uzyskania są uprawnieni Rozliczający Członkowie Izby dla danego połączenia międzysystemowego (w rozumieniu ust.2 poniżej),
 - b) ustala wielkość świadczeń pieniężnych Rozliczających Członków Izby wynikających z ustalenia wielkości świadczeń, o których mowa w lit. a),
 - c) umożliwia spełnienie świadczeń, o których mowa w lit. b), poprzez przygotowanie dyspozycji powodujących uznanie lub obciążenie rachunków bankowych wskazanych przez Rozliczających Członków Izby lub poprzez uznanie lub obciążenie odpowiedniego rachunku bankowego Izby,
 - d) w zakresie określonym w Regulaminie organizuje i zarządza systemem gwarantowania rozliczeń, w tym ustala wartość Limitów transakcyjnych dla poszczególnych Rozliczających Członków Izby lub Zagranicznych izb rozliczeniowych na dany dzień,
 - e) wystawia lub akceptuje w imieniu Rozliczających Członków Izby odpowiednie dokumenty księgowe obejmujące świadczenia pieniężne, o których mowa w lit. b).

2. Zgłaszanie dostaw do OSPe dokonywane jest w podziale na Jednostki Grafikowe przydzielone przez OSPe Członkom Izby lub odpowiednio ich klientom lub reprezentowanym Członkom Giełdy, z uwzględnieniem dostaw realizowanych z wykorzystaniem połączeń międzysystemowych. Za połączenie międzysystemowe rozumie się udostępnianie przez Giełdę dla celów handlowych zdolności przesyłowych przez połączenie pomiędzy krajowym systemem elektroenergetycznym przesyłowym i systemami przesyłowymi państw sąsiednich.
3. Podmiotem odpowiedzialnym za zapewnienie odpowiednich mocy przesyłowych w połączeniach międzysystemowych pozwalających na wykonanie przez Członków Izby świadczeń niepieniężnych wynikających z Transakcji rozliczanych przez Izbę jest dana giełda. Zasady udostępnienia mocy przesyłowych dla Członków Izby określa Izba w umowie dotyczącej rozliczania Transakcji zawieranej z daną giełdą.

ROZDZIAŁ VII

INNE OPERACJE

Transfer Pozycji

§ 67

1. Transfer Pozycji polega na przeniesieniu zapisów wyrażających stany posiadania Pozycji w towarach giełdowych z Konta ewidencyjnego prowadzonego dla Rozliczającego Członka Izby na inne Konto ewidencyjne prowadzone dla tego samego lub innego podmiotu, bez przeniesienia własności towarów giełdowych. Transfer Pozycji odbywa się poprzez zmianę Konta ewidencyjnego przypisanego wszystkim Transakcjom, które składają się na Pozycję wskazaną do transferu.
2. Transfer wykonywany jest przez Izbę na podstawie złożonego pisemnego wniosku Członka Izby, na którego kontach zarejestrowane są te Pozycje, zaakceptowanego przez Członka Izby, który przyjmuje status Rozliczającego Członka Izby w zakresie tych Pozycji.
3. Wniosek, o którym mowa w ust. 2, powinien wskazywać nazwy Kont ewidencyjnych, z których i na które ma być dokonany transfer oraz zawierać informacje dotyczące nazwy instrumentu, ilości kontraktów, numeru, typu oraz kursu Transakcji.
4. Izba może zażądać od Członka Izby przedstawienia w określonym terminie, odpowiednich wyjaśnień i dokumentów potwierdzających zajście określonego zdarzenia lub dokonanie czynności uzasadniających dokonanie transferu.

5. Izba może wykonać transfer Pozycji – w przypadkach, gdy dopuszczają to właściwe przepisy prawa – polegający na przeniesieniu zapisów wyrażających stany posiadania Pozycji w towarach giełdowych z Konta ewidencyjnego prowadzonego dla Rozliczającego Członka Izby na Konto ewidencyjne prowadzone dla innego Rozliczającego Członka Izby, w związku z ich nabyciem na skutek określonego zdarzenia prawnego, z przeniesieniem prawa własności towarów giełdowych.
6. Transfer, o którym mowa w ust. 5, wykonywany jest przez Izbę na podstawie złożonego pisemnego wniosku zarówno przez Rozliczającego Członka Izby, który przyjmuje transfer jak i Rozliczającego Członka Izby, z którego konta transfer jest wykonywany. Wniosek powinien wskazywać nazwy Kont ewidencyjnych, z których i na które ma być dokonany transfer oraz zawierać informacje dotyczące nazwy instrumentu, ilości kontraktów, numeru, typu oraz kursu Transakcji. Dodatkowo do wniosku Rozliczający Członek Izby załącza odpowiednie dokumenty potwierdzające zajście określonego zdarzenia lub dokonanie czynności, których przedstawienia zażąda Izba w terminie wskazanym przez Izbę.
7. Wniosek o transfer należy złożyć nie później niż 10 dni roboczych przed planowaną datą transferu. W uzasadnionych przypadkach Izba może zezwolić na złożenie wniosku w innym niż wskazany w zdaniu poprzednim terminie.
8. W terminie 5 dni roboczych od dnia wpłynięcia kompletnego wniosku o transfer, Izba podejmuje decyzję w sprawie wykonania transferu. Izba może odmówić wykonania transferu w każdej chwili w uzasadnionych przypadkach, w szczególności gdy zachodzi okoliczność uzasadniona bezpieczeństwem rozliczeń.
9. Warunkiem wykonania transferu Pozycji jest przeprowadzenie przez Izbę odpowiednich testów weryfikacyjnych, mających na celu zapewnienie bezpiecznego i poprawnego przeniesienia, pomiędzy Kontami ewidencyjnymi Członków Izby, danych dotyczących otwartych Pozycji będących przedmiotem transferu.
10. W przypadku wyrażenia przez Izbę zgody na transfer Pozycji, jest on wykonywany w ostatnim tygodniu miesiąca, w dniu wyznaczonym przez Izbę, po przeprowadzeniu procesu rozliczeń. W uzasadnionych przypadkach Izba może wyznaczyć w danym miesiącu inny termin wykonywania transferu Pozycji, niż termin, o którym mowa w zdaniu poprzednim.
11. Wniosek o wykonanie transferu może zostać odwołany nie później niż na dwa dni przed dniem wykonania transferu do godziny 15:00. Wycofanie wniosku wymaga formy pisemnej.
12. W przypadku wyrażenia przez Izbę zgody na transfer Pozycji, Członek Izby, który przyjmuje status Członka Rozliczającego w zakresie transferowanych Pozycji,

zobowiązany jest zapewnić w dniu wskazanym przez Izbę w informacji, o której mowa w ust. 13, odpowiednią wartość zabezpieczeń w zakresie tych Pozycji, z zastrzeżeniem postanowień ust. 14.

13. Informacja na temat wysokości wymaganych zabezpieczeń, o których mowa w ust. 12, oraz numeru subkonta Rachunku depozytów zabezpieczających, na które zabezpieczenie powinno zostać wniesione, podawana jest do wiadomości Członka Izby, który przyjmuje status Rozliczającego Członka Izby w zakresie transferowanych Pozycji w dniu roboczym poprzedzającym dzień wykonania transferu.
14. Członkowie Izby, o których mowa w ust. 2, celem zapewnienia odpowiedniej wartości zabezpieczeń transferowanych Pozycji, mogą złożyć wniosek o transfer zabezpieczeń pieniężnych pomiędzy subkontami Rachunku depozytów zabezpieczających dedykowanych tym Członkom Izby. W przypadku, gdy stroną transferu Pozycji jest Członek Izby, który uzyskał zgodę Zarządu, o której mowa w § 11 ust. 2 Regulaminu GIR, rachunkiem obciążanym lub uznawanym z tytułu transferu zabezpieczeń jest rachunek rozliczeniowy tego Członka Izby.
15. Transfer zabezpieczeń wykonywany jest przez Izbę na podstawie wniosku, o którym mowa w ust. 14, złożonego nie później niż 10 dni roboczych przed planowaną datą transferu Pozycji, pod warunkiem zachowania bezpieczeństwa rozliczeń.

Działania Izby w przypadku wystąpienia ograniczeń w poborze lub dostawach energii elektrycznej lub Gazu

§ 68

1. W przypadku wystąpienia ograniczeń w poborze lub dostawach energii elektrycznej lub Gazu, Rozliczający Członkowie Izby, ich klienci lub reprezentowani Członkowie Giełdy objęci takim ograniczeniem nie są zwolnieni z obowiązków wynikających z posiadania Pozycji otwartych na RTP (których przedmiotem obrotu jest energia elektryczna lub Gaz), na RDN lub RDNg, chyba że zostanie podjęta decyzja o zawieszeniu rozrachunków, o której mowa w ust. 2. Jeśli Rozliczający Członek Izby, jego klient lub reprezentowany Członek Giełdy nie mają możliwości zbilansowania dostaw za pomocą dostępnych na giełdzie instrumentów, wtedy podlega on usłudze bilansowania (fizycznego i handlowego), przewidzianej w IRiESPe lub IRiESPg. W takim też przypadku przepisy niniejszych Szczegółowych zasad rozliczeń i rozrachunku stosuje się odpowiednio do rozliczeń oraz rozrachunku Transakcji, których przedmiotem jest energia elektryczna lub Gaz.

2. W przypadku powzięcia przez Izbę informacji o wprowadzeniu lub wystąpieniu ograniczeń w poborze lub dostawie energii elektrycznej lub Gazu, Izba zastrzega sobie możliwość, w ustalonym zakresie, zawieszenia na czas określony dokonywania rozrachunków lub rozliczeń Transakcji, których przedmiotem jest energia elektryczna lub Gaz. Po ustaniu przyczyny podjęcia decyzji o wprowadzeniu zawieszenia, o którym mowa w niniejszym punkcie, Zarząd IRGiT podejmie decyzję o wznowieniu prowadzenia rozrachunków lub rozliczeń Transakcji.
3. W okresie zawieszenia przez Izbę dokonywania rozrachunku lub rozliczeń, o którym mowa w ust. 2, Izba nie będzie wykonywała:
 - a) rozrachunku energii elektrycznej, o którym mowa w § 60 lub rozrachunku Gazu, o którym mowa w § 65;
 - b) rozrachunku finansowego dla Transakcji zawartych na RDN, RDB, RDNg, RDBg lub RTP (w przypadku, gdy przedmiotem jest energia elektryczna lub Gaz), których dostawa pokrywa się z okresem zawieszenia. Dodatkowo Izba dla wskazanego okresu zawieszenia nie będzie wystawiała faktur VAT dla Transakcji, których przedmiotem jest energia elektryczna lub Gaz.
4. Decyzja w zakresie, o którym mowa w ust. 2, podjęta zostanie w drodze uchwały Zarządu IRGiT.

Działania Izby w przypadku zawieszenia świadczenia usług przesyłowych przez OSPe lub OSPg dla Członka Izby lub w przypadku wypowiedzenia umowy Członkowi Izby przez podmiot udostępniający Członkowi Jednostkę Grafikową lub Kod ZUP

§ 69

1. W przypadku otrzymania przez Izbę informacji o wstrzymaniu przez OSPe lub OSPg świadczenia usług przesyłowych dla Jednostek Grafikowych lub Kodów ZUP wykorzystywanych przez Członka Izby, jego klienta lub Członka Giełdy, którego reprezentuje lub w przypadku otrzymania przez Izbę informacji o wypowiedzeniu umowy Członowi Izby, jego klientowi lub Członkowi Giełdy, którego ten Członek Izby reprezentuje przez podmiot udostępniający Jednostkę Grafikową lub Kod ZUP, Izba uniemożliwi od wskazanej daty dostawy danemu Członkowi Izby, klientowi Członka Izby lub reprezentowanemu Członkowi Giełdy zgłaszanie zarejestrowanych na tych Jednostkach Grafikowych lub Kodach ZUP Pozycji.
2. Członek Izby, który na Kontach ewidencyjnych w Izbie, pod którymi zdefiniowane są Jednostki Grafikowe lub Kody ZUP, dla których OSPe lub OSPg wstrzymał świadczenie usług przesyłowych lub w stosunku do których podmiot udostępniający Członkowi Izby Jednostkę Grafikową lub Kod ZUP wypowiedział umowę, posiada zarejestrowane Pozycje do wykonania, zobowiązany jest na wezwanie Izby do zamknięcia tych Pozycji najpóźniej do godziny 11:40 na jeden dzień przed ich datą dostawy.
3. Sytuacja w której Członek Izby, o którym mowa w ust. 2, nie zamknął Pozycji do godziny 11:40 na jeden dzień przed datą dostawy może stanowić przesłankę do stwierdzenia Przypadku naruszenia w rozumieniu Regulaminu. W związku z czym Izba może podjąć działania, o których mowa w treści Regulaminu, a w szczególności podjąć działania w imieniu Członka Izby w celu zamknięcia otwartych Pozycji.
4. Rozliczający Członek Izby jest zobligowany do wskazania w terminie 2 miesięcy od daty wstrzymania świadczenia usług przez OSPe lub OSPg bądź wypowiedzenia umowy przez podmiot udostępniający Członkowi Izby Jednostkę Grafikową lub Kod ZUP, odpowiednio, innej Jednostki Grafikowej lub Kodu ZUP umożliwiających realizację rozrachunku energii elektrycznej lub Gazu, które zostaną przydzielone do Konta ewidencyjnego określonego w ust. 2.
5. Izba ma prawo dezaktywować Konto ewidencyjne, do którego była przydzielona Jednostka Grafikowa lub Kod ZUP, dla których OSPe lub OSPg wstrzymał świadczenie usług przesyłowych lub w stosunku do których podmiot udostępniający Członkowi Izby

Jednostkę Grafikową lub Kod ZUP wypowiedział umowę, jeżeli nie został zachowany termin wskazany w ust. 4 powyżej.

Działania Izby w przypadku nieprzyjęcia przez OSPe lub OSPg zgłoszenia do fizycznej realizacji Transakcji, których przedmiotem jest energia elektryczna lub Gaz

§ 70

1. W przypadku nieprzyjęcia do fizycznej realizacji przez OSPe zgłoszenia, o którym mowa w § 60, lub nieprzyjęcia do fizycznej realizacji przez OSPg zgłoszenia, o którym mowa w § 65, Izba zastrzega sobie możliwość zawieszenia na czas określony dokonywania rozrachunków lub rozliczeń Transakcji, których przedmiotem jest energia elektryczna lub Gaz. Zawieszenie, o którym mowa w zdaniu powyżej, może dotyczyć wszystkich Transakcji lub części Transakcji, w stosunku do których zaistniały przyczyny, o których mowa w zdaniu pierwszym, pokrywających się z datą dostawy nieprzyjętych zgłoszeń do fizycznej realizacji przez OSPe lub OSPg. Po ustaniu przyczyny podjęcia decyzji o wprowadzeniu zawieszenia, o którym mowa w niniejszym ustępie, Zarząd IRGiT podejmie decyzję o wznowieniu prowadzenia rozrachunków lub rozliczeń Transakcji.
2. W okresie zawieszenia przez Izbę dokonywania rozrachunku lub rozliczeń, o którym mowa w § 68 ust. 2, Izba nie będzie wykonywała:
 - a) rozrachunku energii elektrycznej, o którym mowa w § 60, lub rozrachunku Gazu, o którym mowa w § 65;
 - b) rozrachunku finansowego dla Transakcji zawartych na RDN, RDB, RDNg, RDBg lub RTP (w przypadku, gdy przedmiotem jest energia elektryczna lub Gaz), których dostawa pokrywa się z okresem zawieszenia. Dodatkowo Izba dla wskazanego okresu zawieszenia nie będzie wystawiała faktur VAT dla Transakcji, których przedmiotem jest energia elektryczna lub Gaz.
3. Decyzja w zakresie, o którym mowa w ust.1, podjęta zostanie w drodze uchwały Zarządu IRGiT.

**Załącznik nr 1 do Szczegółowych Zasad Rozliczeń i Rozrachunku Giełdowej Izby
Rozrachunkowej - Harmonogram Rozliczeń**

Godzina	Zadanie	Wykonawca
Dzień N		
17:00	Wysłanie Komunikatów SWIFT MT 942 do BPI (tylko dla rachunków domów maklerskich oraz towarowych domów maklerskich, które uzyskały zgodę na zasadach określonych w § 11 ust. 2 Regulaminu)	BPCI
Do 17:30	Przekazanie Raportów kontrolnych do BPCI	IRGiT
Do 18:00	Przekazanie do realizacji paczki zleceń płatniczych numer 1	IRGiT
Dzień N+1		
Do 8:30	Wysłanie Komunikatów SWIFT MT 940 do BPI (tylko dla rachunków domów maklerskich oraz towarowych domów maklerskich, które uzyskały zgodę na zasadach określonych w § 11 ust. 2 Regulaminu)	BPCI
Do 8:30	Księgowanie płatności z paczki zleceń płatniczych numer 1 (księgowania wewnętrzne)	BPCI
Do 9:00	Zgłaszanie zastrzeżeń zleceń płatniczych z paczki numer 1	BPCI
Do 9:00	Wysłanie Komunikatu SWIFT MT 942 z rachunku technicznego Izby do BPI	BPCI
Do 10:30	Przekazanie do realizacji paczki zleceń płatniczych numer 2	IRGiT
10:30-12:00	Księgowanie płatności oraz przesłanie środków zgodnie z paczką zleceń płatniczych numer 2	BPCI, BPI
11:30-12:00	Przekazanie do realizacji paczki zleceń płatniczych numer 3	IRGiT
Do 12:30	Wysłanie Komunikatu SWIFT MT 942 z rachunku technicznego Izby do BPI	BPCI
12:00-13:00	Księgowanie płatności z paczki zleceń płatniczych numer 3 (księgowania wewnętrzne)	BPCI, BPI
Do 13:30	Zgłaszanie zastrzeżeń zleceń płatniczych z paczki numer 3	BPCI
Do 13:30	Wysłanie Komunikatu SWIFT MT 942 z rachunku technicznego Izby do BPI	BPCI
Do 15:00	Przekazanie do realizacji paczki zleceń płatniczych numer 4	IRGiT
15:00-16:00	Księgowanie płatności oraz przesłanie środków zgodnie z paczką zleceń numer 4	BPCI
Do 16:30	Wysłanie Komunikatu SWIFT MT 942 z rachunku technicznego Izby do BPI	BPCI
Dzień N+2		
Do 8:30	Wysłanie Komunikatu SWIFT MT 940 z rachunku technicznego Izby do BPI	BPCI

Załącznik nr 2 do Szczegółowych zasad rozliczeń i rozrachunku Giełdowej Izby Rozrachunkowej - Harmonogram Wystawiania Faktur

1. Harmonogram dla Rynku Dnia Bieżącego (RDB)

Rozliczany rynek	Dane na fakturze transakcyjnej		BPI - zlecenia płatnicze	
	Okres dostawy	Dzień wystawienia faktury	Dzień przekazania zleceń płatniczych do BPI	Dzień realizacji zleceń płatniczych przez BPI
RDB	Piątek	Piątek	Poniedziałek	Wtorek
RDB	Sobota-Niedziela	Poniedziałek	Poniedziałek	Wtorek
RDB	Poniedziałek	Poniedziałek	Wtorek	Środa
RDB	Wtorek	Wtorek	Środa	Czwartek
RDB	Środa	Środa	Czwartek	Piątek
RDB	Czwartek	Czwartek	Piątek	Poniedziałek

2. Harmonogram dla Rynku Dnia Bieżącego (RDBG)

Rozliczany rynek	Dane na fakturze transakcyjnej		BPI - zlecenia płatnicze	
	Okres dostawy	Dzień wystawienia faktury	Dzień przekazania zleceń płatniczych do BPI	Dzień realizacji zleceń płatniczych przez BPI
RDBG	Piątek-Piątek	Poniedziałek	Piątek	Poniedziałek
RDBG	Sobota-Poniedziałek	Wtorek	Poniedziałek	Wtorek
RDBG	Wtorek-Wtorek	Środa	Wtorek	Środa
RDBG	Środa-Środa	Czwartek	Środa	Czwartek
RDBG	Czwartek-Czwartek	Piątek	Czwartek	Piątek

3. Harmonogram dla Rynku Dnia Następnego (RDN oraz RDNg)

Rozliczany rynek	Dane na fakturze transakcyjnej		BPI - zlecenia płatnicze	
	Okres dostawy	Dzień wystawienia faktury	Dzień przekazania zleceń płatniczych do BPI	Dzień realizacji zleceń płatniczych przez BPI
RDN/ RDNg	Sobota	Poniedziałek	Piątek	Poniedziałek
RDN/ RDNg	Niedziela-Wtorek	Wtorek	Poniedziałek	Wtorek
RDN/ RDNg	Środa-Środa	Środa	Wtorek	Środa
RDN/ RDNg	Czwartek-Czwartek	Czwartek	Środa	Czwartek
RDN/ RDNg	Piątek-Piątek	Piątek	Czwartek	Piątek

4. Harmonogram dla Rynku Terminowego Produktów z dostawą energii elektrycznej i Rynku Terminowego Produktów z dostawą gazu (łącznie zwanych RTP)

Rozliczany rynek	Dane na fakturze transakcyjnej		BPI - zlecenia płatnicze	
	Okres dostawy	Dzień wystawienia faktury	Dzień przekazania zleceń płatniczych do BPI	Dzień realizacji zleceń płatniczych przez BPI
RTP	Sobota	Poniedziałek	Piątek	Poniedziałek
RTP	Niedziela-Wtorek	Wtorek	Poniedziałek	Wtorek
RTP	Środa-Środa	Środa	Wtorek	Środa
RTP	Czwartek-Czwartek	Czwartek	Środa	Czwartek
RTP	Piątek-Piątek	Piątek	Czwartek	Piątek

5. Harmonogram dla Rynku Praw Majątkowych (RPM)

Rozliczany rynek	Dane na fakturze transakcyjnej		BPI - zlecenia płatnicze	
	Okres dostawy	Dzień wystawienia faktury	Dzień przekazania zleceń płatniczych do BPI	Dzień realizacji zleceń płatniczych przez BPI
RPM	Sobota-Poniedziałek	Wtorek	Poniedziałek	Wtorek
RPM	Wtorek-Wtorek	Środa	Wtorek	Środa
RPM	Środa-Środa	Czwartek	Środa	Czwartek
RPM	Czwartek-Czwartek	Piątek	Czwartek	Piątek

Załącznik nr 3a do Szczegółowych zasad rozliczeń i rozrachunku Giełdowej Izby Rozrachunkowej – Wzór formularza deklaracji wyznaczenia Limitu transakcyjnego dedykowanego RDB (XBID)

Kod Członka Izby	Nazwa Członka Izby	Kod Reprezentowanego Członek Giełdy***	Typ dyspozycji	Dopłata środków na subkonto Rachunku depozytów transakcyjnych****	Deklarowana wartość (w zł) Limitu transakcyjnego dedykowanego RDB (XBID)

*** W przypadku Członków Izby prowadzących działalność jako reprezentant Członka Giełdy.

**** W przypadku dyspozycji Zwiększenia Limitu transakcyjnego dedykowanego RDB (XBID) przy założeniu dopłaty środków, przelew na subkonto Rachunku depozytów transakcyjnych powinien zostać zaksięgowany do godziny 12:00 w dniu zwiększenia

Izba udostępnia powyższy formularz w formie elektronicznej na stronie internetowej IRGiT. Wypełniony formularz powinien zostać wysłany na adresy: drr@irgit.pl oraz dzr@irgit.pl.

**Załącznik nr 3b do Szczegółowych zasad rozliczeń i rozrachunku Giełdowej Izby
Rozrachunkowej – Wzór formularza deklaracji wyznaczenia Limitu
transakcyjnego dedykowanego RCG**

Kod Członka Izby	Nazwa Członka Izby	Kod Reprezentowanego Członka Giełdy	Typ dyspozycji	Deklarowana wartość (w zł) Limitu transakcyjnego dedykowanego RCG