

**Wyciąg z protokołu z posiedzenia Komitetu ds. Ryzyka
przy Izbie Rozliczeniowej Giełd Towarowych S.A.
z dnia 20 czerwca 2023 r.**

Osoby obecne podczas posiedzenia¹:

Członkowie Komitetu ds. Ryzyka:

1. Tomasz Wieczorek – Przewodniczący Komitetu, Przedstawiciel Izby Rozliczeniowej Giełd Towarowych
2. Paweł Lont – Członek Komitetu, Przedstawiciel European Federation of Energy Traders
3. Maciej Maciejko – Członek Komitetu, Przedstawiciel Związku Pracodawców Prywatnych Energetyki Konfederacji Lewiatan
4. Katarzyna Piłat – Członek Komitetu, Przedstawiciel Izby Gospodarczej Gazownictwa
5. Leszek Prachniak – Członek Komitetu, Przedstawiciel Towarowej Giełdy Energii
6. Robert Sikorski – Członek Komitetu, Przedstawiciel Towarzystwa Gospodarczego Polskie Elektrownie
7. Iwona Ustach – Członek Komitetu, Przedstawiciel Izby Domów Maklerskich
8. Arkadiusz Wronka – Członek Komitetu, Przedstawiciel Towarzystwa Obrotu Energią

Osoby zaproszone na posiedzenie:

1. Aleksandra Celińska – Dział Zarządzania Ryzykiem IRGiT
2. Iwona Jaroszek – Biuro Rozwoju i Obsługi Członków TGE
3. Katarzyna Matuszewska – Przedstawiciel Izby Domów Maklerskich
4. Jarosław Michalak – Przedstawiciel Towarzystwa Gospodarczego Polskie Elektrownie
5. Krzysztof Opara – Dział Rozliczeń i Rozrachunku IRGiT
6. Dominika Trzcńska – Dział Zarządzania Ryzykiem IRGiT

¹ Posiedzenie Komitetu odbyło się stacjonarnie oraz w ramach telekonferencji.

Przebieg spotkania:

1. Członkowie Komitetu zostali poinformowani o statusie realizacji rekomendacji z poprzednich posiedzeń Komitetu, które zostały przesłane do Członków Komitetu przed posiedzeniem.
2. Członkowie Komitetu zostali zapoznani z wybranymi statystykami dotyczącymi obszaru zabezpieczeń i zarządzania ryzykiem w IRGiT, obejmującymi łączną wartość wymaganych zabezpieczeń oraz strukturę i zmienność w czasie wniesionych zabezpieczeń.
3. Członkowie Komitetu zostali zapoznani z analizą dotyczącą skali przyjmowanych gwarancji bankowych w ramach danych poziomów ocen ratingowych stosowanych przez IRGiT. Członkowie Komitetu zarekomendowali utrzymanie obowiązującego limitu kwoty gwarancji bankowej stosowanego w przypadku banków o warunkowej ocenie poziomu ryzyka.
4. Członkowie Komitetu zostali zapoznani ze szczegółowymi kwestiami związanymi z ryzykiem płynności rozliczeń w IRGiT .
5. Członkowie Komitetu zostali zapoznani z przeprowadzonymi analizami w zakresie możliwości zastosowania alternatywnych zasad wyznaczania współczynników uznania zabezpieczeń niepieniężnych. Członkowie Komitetu zarekomendowali przygotowanie przez Izbę finalnych propozycji dotyczących modelu (np. poziomu ufności, minimalna i maksymalna wartości poziomów współczynników uznania).
6. Członkowie Komitetu zostali zapoznani z propozycją docelowego rozwiązania umożliwiającego wykorzystanie części funduszu gwarancyjnego w sytuacji konieczności zapewnienia płynności rozliczeń. Członkowie Komitetu zlecili przygotowanie dalszych analiz w zakresie opisu scenariuszy, w których fundusz gwarancyjny mógłby być wykorzystany na potrzeby płynnościowe.
7. Członkowie Komitetu zostali zapoznani ze specyfikacją nowych instrumentów, które stanowią rozszerzenie listy instrumentów notowanych na Rynku Terminowym Produktów z dostawą energii elektrycznej na OTF o produkty pochodne instrumentu PEAK – L-PEAK (LowPEAK) oraz H-PEAK (HighPEAK).

Termin kolejnego posiedzenia Komitetu ds. Ryzyka zostanie ustalony w późniejszym terminie.

Więcej informacji na temat Komitetu ds. Ryzyka: <https://www.irgit.pl/komitet-ds-ryzyka>