Komunikat Nr 21/DZR/2023

z dnia 4 grudnia 2023 r.

w sprawie zmiany komunikatu Nr 5/DZR/2023 z dnia 30 marca 2023 r.

w sprawie określenia algorytmu wyznaczania wartości depozytu historycznego pomiędzy NEMO, działającym w jego imieniu kontrahentem centralnym („CCP") lub operatorem sieci przesyłowych („TSO") funkcjonującym jako Agent Przesyłowy

Izba Rozliczeniowa Giełd Towarowych S.A. („Izba") na potrzeby wyliczenia wymaganych przez Towarową Giełdę Energii S.A. („TGE") zabezpieczeń pomiędzy NEMO, działającym w jego imieniu kontrahentem centralnym („CCP") lub operatorem sieci przesyłowych („TSO") funkcjonującym jako Agent Przesyłowy w rozumieniu Rozporządzenia Komisji (UE) 2015/1222 z dnia 24 lipca 2015 r. ustanawiającego wytyczne dotyczące alokacji zdolności przesyłowych i zarządzania ograniczeniami przesyłowymi, określa algorytm wyznaczania wymaganej od tych podmiotów wartości depozytu historycznego na zasadach przedstawionych poniżej:

1. Wymagana wartość depozytu historycznego dla NEMO lub działającego w jego imieniu CCP wyznaczana jest przez Izbę codziennie zgodnie z poniższym algorytmem:

$$DH_t = \max\left((DA_{t+1} + ID_{t-1}) * pD; (DA_t + ID_{t-2}) * pD; \dots; (DA_{t-28} + ID_{t-30}) * pD; DH_{min}\right)$$

   gdzie:

   DH_t – wartość depozytu historycznego wyznaczona w dniu t,

   DA_t – wartość transakcji zawieranych pomiędzy TGE a NEMO lub CCP na rynku dnia następnego z datą dostawy t, gdzie wartość transakcji kupna oznacza się znakiem dodatnim, a wartość transakcji sprzedaży oznacza się znakiem ujemnym (w EUR),

   ID_t – wartość transakcji zawieranych pomiędzy TGE a NEMO lub CCP na rynku dnia bieżącego z datą dostawy t, gdzie wartość transakcji kupna oznacza się znakiem dodatnim, a wartość transakcji sprzedaży oznacza się znakiem ujemnym (w EUR),

   pD – parametr liczby dni określony na poziomie równym 6,

   DH_{min} – minimalna wartość depozytu historycznego wynosząca 30 000 EUR.

2. Zasady wyznaczania wartości depozytu historycznego określone w ust. 1 obowiązują od dnia 18 grudnia 2023 r.
3. Izba zastrzega sobie możliwość zmiany zasad wyznaczania wartości depozytu historycznego.