

Zmiany w regulacjach IRGiT

Podsumowanie

Izba Rozliczeniowa Giełd Towarowych S.A. („IRGiT”) wprowadza zmiany do Regulaminu Giełdowej Izby Rozrachunkowej (Rynek towarowy) (dalej „Regulamin GIR”) oraz Szczegółowych zasad rozliczeń i rozrachunku Giełdowej Izby Rozrachunkowej (dalej „Szczegółowe zasady rozliczeń”), mające na celu:

- wdrożenie wydłużenia notowań na Rynku Dnia Bieżącego gazu (dalej „RDBg”) do godziny 20:00, poprzez dostosowanie harmonogramu rozliczeń i rozrachunku finansowego oraz harmonogramu wystawiania faktur, a także modyfikację algorytmu wyznaczania depozytu historycznego,
- doprecyzowanie zasad uwzględnienia przez IRGiT obniżenia wartości gwarancji bankowych uznanych jako zabezpieczenie niepieniężne lub jako zabezpieczenie umowy poręczenia.

Wprowadzane zmiany wchodzi w życie z dniem 30 września 2026 r.

W przypadku pytań prosimy o kontakt.

Dział Zarządzania Ryzykiem	22 341 98 20
Dział Rozliczeń i Rozrachunku	22 341 99 80
Biuro Członków Giełdy	22 341 99 21

Szczegółowy opis zmian

Opis zmian w Regulaminie Giełdowej Izby Rozrachunkowej (Rynek towarowy)

1. Zmiany wynikające z wdrożenia wydłużenia notowań na RDBg do godziny 20:00

Celem zmian jest wdrożenie nowego harmonogramu realizacji rozrachunku finansowego dla RDBg, w odpowiedzi na potrzeby zgłaszane przez uczestników rynku dotyczące wydłużenia sesji na tym rynku.

Do Regulaminu GIR wprowadzono zmiany polegające na dostosowaniu zapisów § 47 ust. 1, dotyczących realizacji rozrachunków pieniężnych dla transakcji zawartych na RDBg.

W konsekwencji wprowadzanych zmian, od 30 września 2026 r. harmonogram rozliczeń oraz rozrachunku pieniężnego dla RDBg będzie następujący:

- rozliczenie transakcji zawartych do godziny 15:30 realizowane będzie w dobie dostawy,
- transakcje zawarte po godzinie 15:30 rozliczane będą w dniu następującym po dobie dostawy,
- rozrachunek pieniężny transakcji przeprowadzany będzie dwa dni po dobie dostawy (analogicznie jak dla transakcji zawartych na Rynku Dnia Bieżącego).

Opis zmian w Szczegółowych zasadach rozliczeń i rozrachunku Giełdowej Izby Rozrachunkowej

1. Zmiany wynikające z wdrożenia wydłużenia notowań na RDBg do godziny 20:00

Celem zmian jest dostosowanie harmonogramu rozliczeń i rozrachunku finansowego oraz harmonogramu wystawiania faktur dla RDBg, a także modyfikacja algorytmu wyznaczania depozytu historycznego.

W związku z powyższym, w Szczegółowych zasadach rozliczeń wprowadzono następujące zmiany:

- 1) w § 11 ust. 2 uwzględniono zmianę algorytmu wyznaczania depozytu historycznego, w ramach której do kalkulacji wartości transakcji netto dla danego

dnia uwzględniane będą transakcje zawarte na RDBg z dobą dostawy na dzień poprzedzający datę kalkulacji,

- 2) w § 13 ust. 1 i 2 wprowadzono zmiany w zakresie wyznaczania wartości nadwyżki zabezpieczeń wniesionych na depozyty transakcyjne uwzględniające nowy harmonogram rozliczeń RDBg, oparty o rozliczenie w dobie dostawy transakcji zawartych do godziny 15:30 i w dniu następującym po dobie dostawy transakcji zawartych po godzinie 15:30,
- 3) w § 39 ust. 8 wprowadzono zmiany polegające na wydłużeniu do godziny 20:00 możliwości dokonywania w Systemie rozliczeniowym zmian dla transakcji zawartych na RDBg w zakresie edycji opisu transakcji, podziału wolumenu transakcji oraz przeniesienia transakcji pomiędzy Kontami ewidencyjnymi,
- 4) w ramach § 44 wyodrębniony został moment rozpoczęcia procesu rozliczeń RDBg wraz z zakresem transakcji podlegających temu procesowi,
- 5) dodano nowy § 50b, w którym opisane zostały zasady ustalania wysokości należności i zobowiązań z tytułu transakcji zawartych na RDBg w oparciu o nowy harmonogram rozliczeń dla tego rynku,
- 6) w konsekwencji zmiany harmonogramu rozliczeń i rozrachunku RDBg, modyfikacji ulega zakres zobowiązań i należności poszczególnych Członków Izby wliczanych do Raportów kontrolnych przekazywanych przez IRGiT do poszczególnych Banków Płatników, o czym mowa w § 53 ust. 1 i 2,
- 7) w związku z nowym harmonogramem rozliczeń RDBg dostosowany został również harmonogram wystawiania faktur dla RDBg określony w Załączniku nr 2.

2. Zmiany dotyczące zasad obniżenia wartości gwarancji bankowych

Celem zmian jest doprecyzowanie zapisów dotyczących terminu uwzględnienia przez IRGiT w Rejestrze Zabezpieczeń Niepieniężnych obniżenia wartości gwarancji bankowych wniesionych jako zabezpieczenie niepieniężne lub jako zabezpieczenie umowy poręczenia.

W związku z powyższym, w § 33 ust. 8 oraz § 34 ust. 6 wprowadzono następujące rozróżnienie:

- 1) w przypadku obniżenia kwoty gwarancji bankowej wynikającego z zakończenia okresu obowiązywania dotychczasowej gwarancji bankowej, termin obniżenia kwoty gwarancji bankowej w Rejestrze Zabezpieczeń Niepieniężnych przypada odpowiednio na drugi dzień roboczy lub, w przypadku gwarancji bankowej

stanowiącej zabezpieczenie umowy poręczenia, na piąty dzień roboczy przed końcem okresu jej obowiązywania,

- 2) w przypadku obniżenia kwoty gwarancji bankowej z przyczyn innych niż zakończenie okresu obowiązywania gwarancji bankowej, termin uwzględnienia obniżenia kwoty gwarancji bankowej w Rejestrze Zabezpieczeń Niepieniężnych określać będzie każdorazowo IRGiT.