

Wejście w życie nowych Szczegółowych Zasad Rozliczeń rynków prowadzonych przez TGE S.A. oraz zmiana algorytmu obliczania depozytu historycznego

Podsumowanie

W związku z zakończeniem obrotu na Rynku Terminowym Praw Majątkowych, Izba dokonała aktualizacji regulacji w tym zakresie, a w szczególności zmieniła metodologię wyznaczania depozytów zabezpieczających dla kontraktów zawartych na tym rynku.

Dodatkowo, w związku z przeprowadzonymi analizami ryzyka związanego z aktywnością podmiotów działających w systemie SAPRI, Izba zmieniła treść uchwały określającej algorytm obliczania depozytu historycznego. Nowa uchwała pozwala na obniżenie poziomu wymaganego depozytu historycznego.

Szczegóły zmian znajdują się w dalszej części dokumentu.

W przypadku pytań prosimy o kontakt.

Biuro IRGiT	22 341 99 01
Dział Rozliczeń i Rozrachunku	22 341 99 80
Dział Zarządzania Ryzykiem	22 341 99 67

Szczegółowe Zasady Rozliczeń

W związku z planowanym na 28 grudnia 2017 r. zakończeniem obrotu na Rynku Terminowym Praw Majątkowych („RTPM”) Izba przyjęła nową wersję Szczegółowych Zasad Rozliczeń rynków prowadzonych przez TGE S.A. („SZR”). Zmiany w SZR polegają na usunięciu zapisów dotyczących dokonywania zmian na transakcjach zawartych na RTPM oraz na dostosowaniu metodologii wyznaczania depozytów dla kontraktów na Prawa Majątkowe. Depozyty zabezpieczające będą obliczane na podstawie cen indeksu OZEX_A, a nie jak do tej pory na podstawie kursów rozliczeniowych notowanych kontraktów.

Nowa wersja Szczegółowych Zasad Rozliczeń rynków prowadzonych przez TGE S.A. będzie obowiązywać od dnia 28 grudnia 2017 r.

Depozyt historyczny

Izba przyjęła nową wersję Uchwały w sprawie określenia algorytmu wyznaczania wartości i trybu regulacji depozytu historycznego oraz określenia listy typów instrumentów w odniesieniu do których stosowany jest depozyt historyczny („Uchwała”). Zmiany w Uchwale polegają na usunięciu zapisów odnoszących się do zwiększania parametru liczby dni w przypadkach kiedy występuje ciąg trzech lub czterech dni wolnych od pracy. Zmieniona Uchwała pozwala na obniżenie poziomu wymaganego depozytu historycznego.

Nowa Uchwała w sprawie depozytu historycznego będzie obowiązywać od dnia 19 grudnia.