
Zmiana struktury rynków na TGE

Zasady rozliczeń i ich gwarantowania

Zabezpieczenie – RTTE i RTTG na OTF

- ◆ **Brak zmian** w systemie zabezpieczeń
- ◆ Możliwość wnoszenia zabezpieczeń niepieniężnych na depozyty zabezpieczające
- ◆ **Gwarancje bankowe** będą akceptowalnym rodzajem zabezpieczeń niepieniężnych

Zabezpieczenie – forwardy na OZE

- ◆ Zabezpieczenie transakcji na rynku „forwardów na OZE” rozliczanego w ramach IRR będzie zbliżone do zasad zabezpieczenia funkcjonujących na GIR
- ◆ Depozyty zabezpieczający (depozyty wstępne i depozyty uzupełniające) – możliwość wnoszenia zabezpieczeń niepieniężnych w formie **gwarancji bankowych**
- ◆ Depozyt dostawy
- ◆ Fundusz gwarancyjny
- ◆ **Blokada PM** – obniżenie wymogów depozytowych

Jakie są opinie Członków Izby na temat funkcjonującego modelu zabezpieczania dostawy PM?

Rozliczenie – forwardy na OZE

- ◆ Rozliczenie transakcji na rynku „forwardów na OZE” w ramach IRR będzie zbliżone do zasad funkcjonujących na GIR
- ◆ Rozrachunek pieniężny przeprowadzany będzie w złotych polskich
- ◆ **Na jeden dzień przed** określonym przez Giełdę **terminem wykonania kontraktu**, Izba na poszczególnych Kontach obrachunkowych Rozliczającego Uczestnika Izby i odpowiednio jego klientów, dokonuje rozliczeń zawartych transakcji
- ◆ Suma sald rozliczeń poszczególnych Kont obrachunkowych, za których rozliczenie odpowiada dany Rozliczający Uczestnik Izby, jest określana jako wartość transakcji sprzedaży danej serii, pomniejszonych o wartość transakcji kupna tej samej serii instrumentu
- ◆ Wartość zawartych transakcji obliczana jest jako iloczyn wolumenu kontraktów, nominału instrumentu liczonego w GWh oraz kursu transakcji wyrażonego jako PLN/MWh

Rachunki bankowe

♦ Standardowy model wnoszenia zabezpieczeń:

- ✓ Subkonto depozytów transakcyjnych w BPI (Deutsche Bank Polska S.A.)
- ✓ Subkonto depozytów zabezpieczających w BPI (Deutsche Bank Polska S.A.)
- ✓ Rachunek rozliczeniowy w BPUI

♦ Alternatywny model wnoszenia zabezpieczeń:

- ✓ Rachunek rozliczeniowy w BPUI

♦ Lista Banków Płatników Uczestników Izby:

- ✓ Deutsche Bank Polska S.A.
- ✓ ING Bank Śląski S.A.
- ✓ Raiffeisen Bank Polska S.A.
- ✓ Powszechna Kasa Oszczędności Bank Polski S.A.
- ✓ Bank Handlowy w Warszawie S.A.
- ✓ Getin Noble Bank S.A.

Dziękujemy za uwagę

Dział Rozliczeń i Rozrachunku

drd@irgit.pl

+48 22 341 99 80

Dział Zarządzania Ryzykiem

dzr@irgit.pl

+48 22 341 98 20