

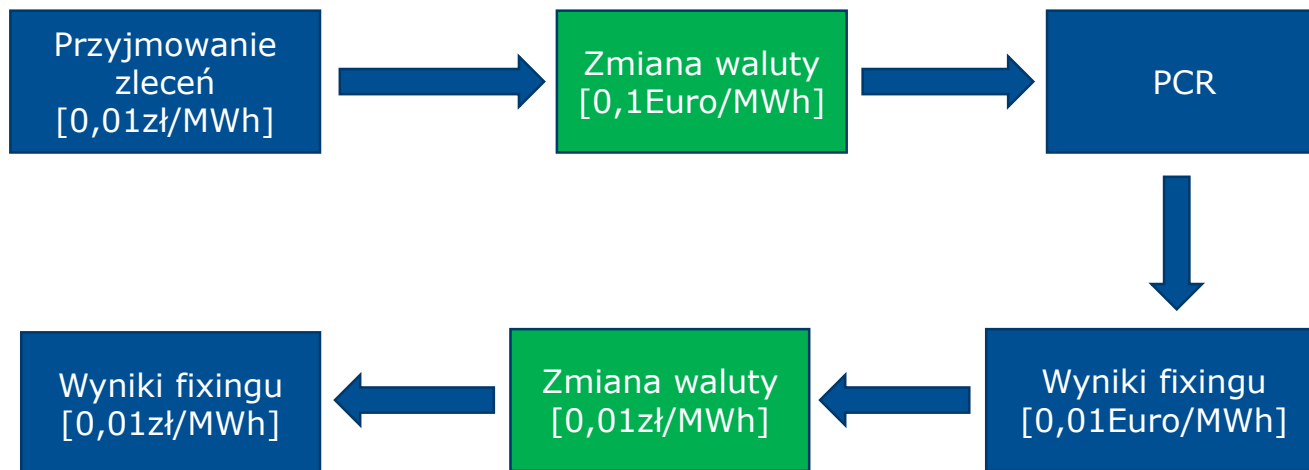
Stosowane kursy wymiany walut w modelu PCR

Łukasz Skwarko
Starszy Specjalista ds. Notowań

Komitet Rynku Energii Elektrycznej
Komitet Rynku Gazu

Warszawa, 25 stycznia 2017





- ◆ TGE będzie otrzymywać z banku 3 kursy dla pary walutowej EUR/PLN: kurs kupna, kurs sprzedaży oraz kurs średni
- ◆ Przeliczenie zleceń z PLN na EUR dla instrumentów RDS będzie odbywać się na podstawie kursu średniego zarówno dla zleceń kupna jak i dla zleceń sprzedaży, z dokładnością do 2 miejsc po przecinku
- ◆ Przykład:

Buy	Sell	Average
4,3800	4,3600	4,3700

- ◆ 1. Zlecenie kupna po cenie 121,85 zł.
 $121,85/4,37 = 27,88$ EUR
- ◆ 2. Zlecenie sprzedaży po cenie 121,85 zł.
 $121,85/4,37 = 27,88$ EUR

Wymiana walut w modelu PCR - wyniki



- ◆ Wyniki będą przeliczane na PLN po kursie kupna lub sprzedaży w zależności od kierunku przepływu energii dla danego instrumentu godzinowego
- ◆ Import do PL – kurs kupna
- ◆ Eksport z PL – kurs sprzedaży
- ◆ Brak przepływu – kurs średni
- ◆ Przykład:

Buy	Sell	Average
4,3800	4,3600	4,3700

H**	Przepływ	Kierunek	Cena EUR	Użyty kurs	Cena PLN
H01	100	Import	29,67	4,38	129,95
H02	-100	Eksport	29,67	4,36	129,36
H03	0	Brak	29,67	4,37	129,66

Wymiana walut w modelu PCR – wpływ na wyniki



Faza Pre-Coupling				Faza Post-Coupling					Różnica Wyniki - Limit		
Typ	Limit ceny	Kurs	Limit po przeliczeniu	Cena PCR	Import (kurs kupna)	Eksport (kurs sprzedaży)	Brak przepływu (kurs średni)	Różnica I-E	Import	Eksport	Brak przepływu
K	145,85	Średni 4,37	33,38	33,38	146,18	145,52	145,85	0,67	-0,33	0,33	0
S	145,85	Średni 4,37	33,38	33,38	146,18	145,52	145,85	0,67	0,33	0,33	0

Buy	Sell	Average
4,3800	4,3600	4,3700

Dziękuję za uwagę

