

# Aplikacja TGE-MIFID2 i raportowanie

**Biuro Operacji Giełdowych**



# Agenda

- ❖ Aplikacja TGE-MIFID2
- ❖ Dostęp do Aplikacji TGE-MIFID2
- ❖ Uzupełnianie Short Code

# Aplikacja TGE-MIFID2

Informacje ogólne o Aplikacji TGE-MIFID2



- **Aplikacja TGE MIFID2** - aplikacja obsługująca procesy związane z wypełnieniem wymogów Rozporządzenia MIFIR w odniesieniu do oznaczenia raportowanych transakcji, nałożonych na spółkę obrotu
- Obowiązek raportowania spoczywa na podmiotach zawierających transakcje na instrumentach finansowych
- Witryna Użytkownika – moduł Aplikacji umożliwi Członkowi OTF przekazanie informacji o używanych kodach (short-code) i ich mapowaniu na dane szczegółowe (long-code) oraz podgląd wygenerowanych raportów w imieniu Członka Giełdy/ Członka OTF

- Aplikacją zarządza osoba upoważniona przez Członka Giełdy, **nie musi** to być makler.
- Aplikacja służy do wprowadzania Short Code, Long Code oraz generowania raportów zleceń i transakcji.
- Członek Giełdy samodzielnie wprowadza dane do aplikacji i jest odpowiedzialny za ich poprawność. Odpowiada również za poprawność i kompletność raportów generowanych za pomocą aplikacji.
- Członkowie Giełdy będą mieli możliwość weryfikacji i poprawy danych zawartych w raporcie zleceń. Dopiero po zatwierdzeniu danych w raporcie zleceń i opublikowaniu go jako ostatecznego będzie generowany raport transakcji.
- W aplikacji musi zostać podany Short Code definiujący każdego maklera upoważnionego do składania zleceń w imieniu Członka Giełdy na RIF, **może to być login maklera** z systemu X-Stream.



- TGE jest administratorem danych osobowych przekazywanych za pośrednictwem Aplikacji TGE-MIFID2 (long-code'y).
- Dane będą przetwarzane w celu raportowania transakcji zawieranych na Towarowej Giełdzie Energii przez Członków Giełdy oraz innych uczestników rynku giełdowego.
- Członkowie Giełdy zapewnią giełdzie możliwość przetwarzania danych osobowych, wprowadzanych do Aplikacji w formie long-code'ów, poprzez uzyskanie zgody na przetwarzanie danych od właścicieli danych osobowych.

# Dostęp do TGE-MIFID2

Szczegółowe informacje w zakresie dostępu  
do aplikacji



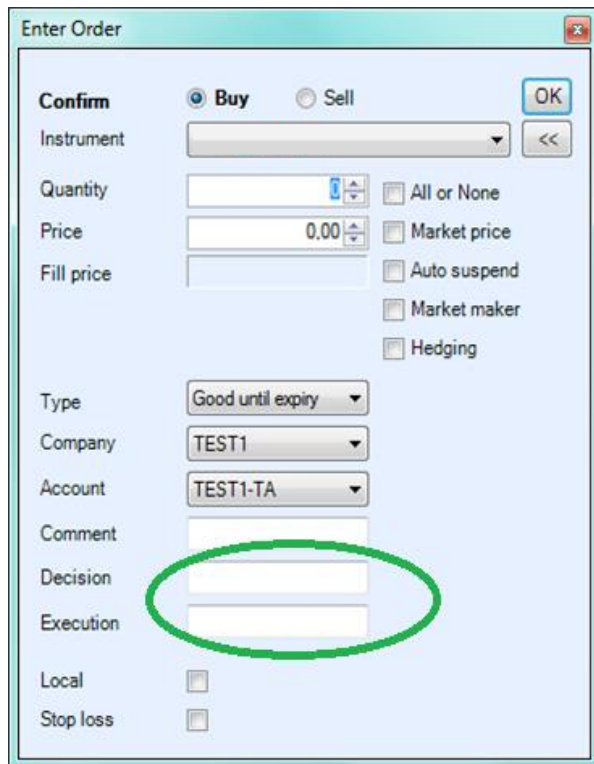
- Aplikacja Aplikacji TGE-MIFID2 służy do raportowania zleceń i transakcji realizowanych na instrumentach finansowych na Rynku Instrumentów Finansowych i Zorganizowanej Platformie Obrotu.
- Dostęp do Aplikacji TGE-MIFID2 jest nadawany równoległe z dostępem do systemu notującego Członkom Giełdy, w odniesieniu do których TGE jest zobowiązana do raportowania, lub którzy zdecydowali się powierzyć giełdzie raportowanie w ich imieniu do organów nadzoru.
- **Witryna Użytkownika** umożliwia Członkowi Giełdy przekazanie informacji o używanych kodach (short-code) i ich mapowaniu na dane szczegółowe (long-code) oraz podgląd i modyfikację wygenerowanych raportów w imieniu Członka Giełdy.
- Dostęp do Witryny Użytkownika nadawany jest wyłącznie osobom upoważnionym przez Członka Giełdy do administrowania w jego imieniu bazą kodów spółki oraz modyfikowania raportów.
- Członek Giełdy samodzielnie wprowadza informacje o używanych przez spółkę kodach (w tym kodach klientów – w przypadku domów maklerskich) i odpowiada za ich kompletność i poprawność.
- Członek Giełdy odpowiada również za kompletność i poprawność raportów generowanych przez giełdę w ich imieniu.

# Uzupełnianie Short Code

Informacje o sposobach i zasadach  
wprowadzania Short Code



1. Każde zlecenie Członka Giełdy składane na RIF i F\_RTPM powinno zawierać:



The screenshot shows the 'Enter Order' window with the following fields and options:

- Confirm**: Buy (selected), Sell
- Instrument**: Dropdown menu
- Quantity**: Input field with a spinner, and checkboxes for 'All or None', 'Market price', 'Auto suspend', 'Market maker', and 'Hedging'.
- Price**: Input field with a spinner, showing '0,00'.
- Fill price**: Input field
- Type**: Dropdown menu with 'Good until expiry' selected.
- Company**: Dropdown menu with 'TEST1' selected.
- Account**: Dropdown menu with 'TEST1-TA' selected.
- Comment**: Input field
- Decision**: Input field (highlighted with a green oval)
- Execution**: Input field (highlighted with a green oval)
- Local**: Checkbox
- Stop loss**: Checkbox

- Oznaczenie instrumentu (C\_EUA-20 lub F-OZE)
- rodzaj zlecenia (kupno / sprzedaż)
- konto (TA)
- wolumen
- cenę (w PLN z dokładnością do grosza)
- termin ważności (do dnia, do końca notowań, itp.)
- oznaczenie klienta Członka Giełdy, na rachunek którego przekazywane jest zlecenie na giełdę (Short Code)
- oznaczenie osoby fizycznej lub algorytmu odpowiedzialnych za podjęcie decyzji inwestycyjnej
- oznaczenie osoby fizycznej lub algorytmu odpowiedzialnych u Członka Giełdy za wykonanie danego zlecenia

Jeżeli pole decision bądź execution zostanie puste w raporcie zostanie uzupełnione loginem maklera

2. Pole „decision” podczas składania zlecenia może:

a) zostać puste, wówczas aplikacja uzupełni je loginem maklera jak Short Code,

b) zostać uzupełnione Short Code zdefiniowanym w aplikacji,

c) zostać uzupełnione specjalnym Short Code – out of firm, przez co w aplikacji pole to zostanie puste.

3. Pole „execution” można uzupełniać analogicznie do pola „decision”.

4. Pole „execution” wykorzystywane jest również w algo tradingu, jako miejsce w którym wpisywany jest algorytm za pomocą, którego zlecenia składane są na rynek.

## **Dziękujemy za uwagę**

Biuro Operacji Giełdowych

Towarowa Giełda Energii S.A.

ul. Książęca 4, 00-498 Warszawa

DN@tge.pl

