



Szczegółowe zasady anulowania transakcji

*Zatwierdzone Uchwałą Zarządu nr 237/23/20 z dnia 23 kwietnia 2020 r.
Wchodzą w życie z dniem 1 maja 2020 r.*

Słownik

Członek Giełdy - Członek Giełdy dopuszczony do działania na Rynku Towarów Giełdowych TGE;

Członek OTF – rozumie się przez to podmiot posiadający status Członka OTF zgodnie z Regulaminem OTF;

Regulamin– Regulamin obrotu Rynku Towarów Giełdowych lub Regulamin obrotu Zorganizowanej Platformy Obrotu Towarowej Giełdy Energii S.A.;

RDN – Rynek Dnia Następnego prowadzony w ramach Rynku Towarów Giełdowych;

RDNg – Rynek Dnia Następnego Gazu prowadzony w ramach Rynku Towarów Giełdowych;

RDBg – Rynek Dnia Bieżącego Gazu prowadzony w ramach Rynku Towarów Giełdowych;

RPM – Rynek Praw Majątkowych prowadzony w ramach Rynku Towarów Giełdowych;

OTF - rozumie się przez to Zorganizowaną Platformę Obrotu, o której mowa w art. 3 lit. 10b) ustawy o obrocie instrumentami finansowymi, prowadzoną przez Towarową Giełdę Energii S.A.;

RTPE - Rynek Terminowy Produktów z dostawą energii elektrycznej prowadzony na OTF przez Giełdę;

RTPG - Rynek Terminowy Produktów z dostawą gazu prowadzony na OTF przez Giełdę;

RTPM – Rynek Terminowy Praw Majątkowych dla instrumentów finansowych, których instrumentem bazowym są prawa majątkowe wynikające ze Świadectw Pochodzenia dla energii elektrycznej wytworzonej w odnawialnych źródłach energii prowadzony na OTF przez Giełdę;

TGE, Giełda – Towarowa Giełda Energii S.A.;

Wniosek – wniosek o anulowanie błędnej transakcji;

Wycofanie – wniosek o wycofanie wniosku o anulowanie błędnej transakcji;

I. Zakres obowiązywania Szczegółowych zasad anulowania transakcji

§ 1

1. Z zastrzeżeniem ust. 2, Szczegółowe zasady anulowania transakcji stosuje się do transakcji zawartych na poszczególnych rynkach w ramach Rynku Towarów Giełdowych lub Zorganizowanej Platformy Obrotu Towarowej Giełdy Energii S.A.
2. Transakcje zawarte w ramach Rynku Dnia Bieżącego nie podlegają anulowaniu.

II. Tryb postępowania w przypadku złożenia wniosku o anulowanie błędnej transakcji

Złożenie Wniosku

§ 2

1. Wniosek o anulowanie błędnej transakcji („Wniosek”) może zostać złożony przez Członka Giełdy/ Członka OTF, który złożył błędne zlecenie.
2. Przez błędne zlecenie należy rozumieć zlecenie złożone przez Członka Giełdy/ Członka OTF, w wyniku którego doszło do zawarcia błędnej transakcji.
3. Złożenie Wniosku nie może nastąpić później niż w terminie 15 minut od zawarcia błędnej transakcji.
4. Wniosek może zostać wycofany do czasu podjęcia decyzji o anulowaniu transakcji lub o odmowie wyrażenia zgody na anulowanie transakcji.
5. Wniosek o anulowanie błędnej transakcji oraz Wniosek o wycofanie wniosku o anulowanie błędnej transakcji („Wycofanie”) należy złożyć według wzoru (odpowiednio Załączniki nr 1 i 2).

§ 3

1. Członek Giełdy/Członek OTF w jednym Wniosku może wnosić o anulowanie wszystkich błędnych transakcji zawartych na podstawie jednego błędnego zlecenia, o którym mowa w § 2 ust. 2.
2. W przypadku złożenia błędnego zlecenia, które zostało powielone na kilku instrumentach godzinowych o takiej samej dacie dostawy, wnioski o anulowanie błędnych transakcji zawartych w wyniku złożenia takiego zlecenia będą traktowane jako jeden wniosek.

§ 4

1. Wniosek o anulowanie błędnej transakcji („Wniosek”) oraz wniosek o wycofanie wniosku o anulowanie błędnej transakcji („Wycofanie”), o których mowa w § 2 należy przesłać do Towarowej Giełdy Energii S.A. („Giełda”) w formie:
 - a) formularza w postaci pliku pdf (stanowiącego odpowiednio Załącznik nr 1 i 2) za pośrednictwem poczty elektronicznej na adres DN@tge.pl, lub
 - b) skanu wypełnionego formularza (stanowiącego odpowiednio Załącznik nr 1 i 2) za pośrednictwem poczty elektronicznej na adres DN@tge.pl.
2. Wniosek o anulowanie błędnej transakcji należy wysłać ze zgłoszonego do Giełdy adresu poczty elektronicznej maklera wypełniającego wniosek, z zastrzeżeniem czasu wskazanego w § 2 ust. 3.
3. Przesłanie wniosku o anulowanie błędnej transakcji należy niezwłocznie potwierdzić telefonicznie dzwoniąc na numer, który jest podany na wniosku (stanowiącego Załącznik nr 1).
4. Wniosek o wycofanie wniosku o anulowanie błędnej transakcji należy wysłać ze zgłoszonego do Giełdy adresu poczty elektronicznej maklera wypełniającego wniosek, z zastrzeżeniem § 2 ust. 4.
5. Przesłanie wycofania wniosku o anulowanie błędnej transakcji należy niezwłocznie potwierdzić telefonicznie dzwoniąc na numer, który jest podany na wniosku (Wzór wniosku stanowi Załącznik nr 2 do niniejszego dokumentu).
6. Wniosek lub Wycofanie uznaje się za złożony wówczas gdy zostanie dostarczony zgodnie z ust.1. i potwierdzony telefonicznie odpowiednio z ust. 3 lub ust. 5.

§ 5

Giełda informuje Członków Giełdy/Członków OTF o złożeniu wniosku o anulowanie błędnej transakcji za pośrednictwem systemu informatycznego giełdy lub poczty elektronicznej, wskazując kod instrumentu, którego dotyczy Wniosek oraz numery transakcji, które mogą zostać anulowane, o których mowa w § 7.

§ 6

Giełda nie ujawnia nazwy Członka Giełdy/ Członka OTF, który złożył Wniosek o anulowanie błędnej transakcji.

Weryfikacja Wniosku

§ 7

1. Giełda weryfikuje poprawność złożonego Wniosku o anulowanie błędnej transakcji.
2. W przypadku, gdy wniosek nie jest poprawny, Giełda telefonicznie informuje o tym Członka Giełdy/Członka OTF, wzywając do uzupełnienia zaistniałych braków.

3. Złożenie poprawionego Wniosku jest możliwe, jeżeli nie upłynął termin określony w § 2 ust. 3.
4. W przypadku, gdy Wniosek o anulowanie błędnej transakcji jest poprawny, Giełda informuje o złożeniu Wniosku drugą stroną błędnej transakcji, wskazując w szczególności:
 - a) oznaczenie (kod) instrumentu
 - b) numery transakcji, które mogą zostać anulowane
 - c) termin przekazania odpowiedzi w formie Oświadczenia woli, o wyrażeniu zgody na anulowanie błędnej transakcji albo o nie wyrażeniu takiej zgody.

Anulowanie transakcji

§ 8

Transakcja błędna może zostać anulowana, jeżeli zgodę na jej anulowanie wyrazi Członek Giełdy/Członek OTF, który był drugą stroną tej transakcji, z zastrzeżeniem § 11 i § 12.

§ 9

1. Członek Giełdy/Członek OTF, który był drugą stroną błędnej transakcji przekazuje Oświadczenie woli o wyrażeniu zgody na anulowanie błędnej transakcji lub o nie wyrażeniu takiej zgody:
 - a) telefonicznie na numer, który jest podany na Oświadczeniu woli z zastrzeżeniem ust. 2, lub
 - b) za pośrednictwem poczty elektronicznej, w formie wypełnionego formularza zgodnie ze wzorem stanowiącym Załącznik nr 3 do niniejszego dokumentu, na adres poczty elektronicznej DN@tge.pl, ze zgłoszonego do Giełdy adresu poczty elektronicznej maklera wypełniającego oświadczenie, z zastrzeżeniem ust. 3.
2. W przypadku przekazania Oświadczenia woli telefonicznie, należy dodatkowo do końca dnia, przesłać Oświadczenie woli na adres poczty elektronicznej DN@tge.pl, ze zgłoszonego do Giełdy adresu poczty elektronicznej maklera wypełniającego oświadczenie, zgodnie ze wzorem stanowiącym Załącznik nr 3 do niniejszego dokumentu.
3. Oświadczenie, o którym mowa w ust. 1 należy złożyć w terminie 15 minut od momentu przekazania przez Giełdę informacji o złożeniu Wniosku. W szczególnie uzasadnionych wypadkach Zarząd lub upoważniony przez Zarząd pracownik Giełdy może wydłużyć ten termin.
4. Odmowa wyrażenia zgody na anulowanie transakcji wymaga uzasadnienia.

§ 10

W przypadku wystąpienia problemów technicznych upoważniony przez Zarząd pracownik Giełdy może wyrazić zgodę na przekazanie dokumentów, o których mowa w § 4 ust. 2 i 4 oraz § 9 ust. 1, za pośrednictwem poczty elektronicznej innej niż maklera wypełniającego, pod warunkiem, że adres ten został zgłoszony do Giełdy zgodnie z „Wnioskiem o dopuszczenie na Rynku Towarów Giełdowych/Zorganizowanej Platformie Obrotu Towarowej Giełdy Energii S.A.” dostępnym na stronie internetowej Giełdy.

§ 11

Z zastrzeżeniem § 12, w przypadku braku przekazania Oświadczenia woli przez Członka Giełdy/ Członka OTF, który był drugą stroną błędnej transakcji w terminie określonym w § 9 ust. 3, Zarząd lub upoważniony przez Zarząd pracownik Giełdy podejmuje decyzję o odmowie wyrażenia zgody na anulowanie transakcji.

§ 12

W przypadku, gdy błąd w zleceniu Członka Giełdy/ Członka OTF jest oczywisty, anulowanie transakcji może zostać dokonane bez zgody drugiej strony tej transakcji. Szczegółowe kryteria oceny zostały określone w pkt III niniejszego dokumentu.

§ 13

Zarząd lub upoważniony przez Zarząd pracownik Giełdy może odmówić wyrażenia zgody na anulowanie transakcji pomimo wyrażenia zgody na anulowanie przez drugą stronę tej transakcji.

§ 14

1. Zarząd lub upoważniony przez Zarząd pracownik Giełdy podejmuje decyzję o anulowaniu transakcji lub o odmowie wyrażenia zgody na anulowanie transakcji niezwłocznie po otrzymaniu danych niezbędnych do podjęcia decyzji, jednak nie później niż do czasu przekazania transakcji przez Giełdę do rozliczenia.
2. Decyzja, o której mowa w ust. 1 jest niezwłocznie przekazywana przez upoważnionego przez Zarząd pracownika Giełdy stronom tej transakcji telefonicznie.

III. Szczegółowe kryteria oceny sytuacji, w których błąd zlecenia Członka Giełdy/ Członka OTF uważa się za oczywisty.

§ 15

Zarząd lub upoważniony przez Zarząd pracownik Giełdy podejmując decyzję o anulowaniu transakcji błędnej ocenia, czy błąd w zleceniu Członka Giełdy/ Członka OTF, w wyniku

którego doszło do zawarcia błędnej transakcji, uważa się za oczywisty. Podstawą tej oceny są dane zawarte we Wniosku o anulowanie błędnej transakcji złożonym przez Członka Giełdy/ Członka OTF.

§ 16

1. Błąd w zleceniu Członka Giełdy/Członka OTF uznaje się za oczywisty w przypadku, gdy kurs błędnej transakcji zawartej na podstawie błędnego zlecenia znajduje się poza przedziałem wyznaczonym w następujący sposób:
 - a) dolną granicę przedziału określa cena odniesienia dla instrumentu, na którym została zawarta błędna transakcja pomnożona przez:
 - 0,5 dla instrumentów godzinowych RDN oraz RDBg,
 - 0,8 dla rynku RTPE, RTPG, RTPM, RPM oraz instrumentów blokowych RDN i RDNg.
 - b) górną granicę przedziału określa cena odniesienia dla instrumentu, na którym została zawarta błędna transakcja pomnożona przez:
 - 2 dla instrumentów godzinowych RDN oraz RDBg,
 - 1,2 dla rynku RTPE, RTPG, RTPM, RPM oraz instrumentów blokowych RDN i RDNg.
2. Ceną odniesienia dla instrumentu, na którym została zawarta błędna transakcja jest:
 - ostatni kurs jednolity – dla instrumentów godzinowych RDN oraz instrumentów RPM,
 - kurs ostatniej transakcji – dla instrumentów blokowych RDN, RDNg, oraz RDBg.
 - ostatni kurs rozliczeniowy – dla instrumentów RTPE, RTPG, RTPM.
3. W przypadku braku określenia ceny odniesienia, błąd w zleceniu nie może zostać uznany za oczywisty.

IV. Postanowienia końcowe

§ 17

Transakcję anulowaną uważa się za niezawartą. Zlecenia, które były podstawą anulowanej transakcji, stają się nieważne.

§ 18

Niezrealizowane części zleceń, na podstawie których zawarte zostały anulowane transakcje, nie tracą ważności z chwilą anulowania transakcji.

§ 19

Zarząd lub upoważniony przez Zarząd pracownik Giełdy może zawiesić obrót na instrumencie, na którym została zawarta błędna transakcja.

§ 20

W przypadku, gdy zgodnie z Regulaminem nie jest dopuszczalne anulowanie transakcji błędnej, ze względu na przekroczenie terminu na złożenie Wniosku, a błąd w transakcji zawartej na podstawie błędnego zlecenia spełnia kryteria błędu oczywistego określone w § 16, kurs zawartej transakcji błędnej nie będzie uwzględniony przy obliczeniu dziennego kursu rozliczeniowego.

Załącznik nr 1

Dane kontaktowe:

dn@tge.pl – adres email do złożenia wniosku

+48 22 341 99 60 - numer kontaktowy

WNIOSEK O ANULOWANIE BŁĘDNEJ TRANSAKCJI

(Czytelnie wypełnić)

Na złożenie wniosku jest **15 min.** od zawarcia transakcji, która ma zostać anulowana.

Formularz należy wysłać z adresu email maklera wypełniającego wniosek.

NAZWA CZŁONKA GIEŁDY/ CZŁONKA OTF		
IMIĘ I NAZWISKO MAKLERA SKŁADAJĄCEGO WNIOSEK		
BŁĘDNE ZLECENIE/ZLECENIA Numer identyfikacyjny błędneho zlecenia/ numery identyfikacyjne błędnych zleceń, na podstawie którego (-ych) zawarto transakcje (Order Id)

Członek GIEŁDY / Członek OTF wnioskuje o anulowanie następujących transakcji, które zostały zawarte na podstawie w/w błędnego zlecenia:

<p>BŁĘDNA TRANSAKCJA/TRANSAKCJE</p> <p>Numer identyfikacyjny /numery identyfikacyjne transakcji do anulowania</p> <p>(Trade Id)</p>

Złożenie wniosku podlega opłacie zgodnie z Regulaminem obrotu Rynku Towarów Giełdowych/Zorganizowanej Platformy Obrotu Towarowej Giełdy Energii S.A., która nie podlega zwrotowi.

Załącznik nr 2

Dane kontaktowe:

dn@tge.pl – adres email do złożenia wniosku

+48 22 341 99 60 - numer kontaktowy

WNIOSEK O WYCOFANIE WNIOSKU O ANULOWANIE BŁĘDNEJ TRANSAKCJI

(Czytelnie wypełnić)

Formularz należy wysłać z adresu email maklera wypełniającego wniosek.

NAZWA CZŁONKA GIEŁDY/ CZŁONKA OTF		
IMIĘ I NAZWISKO MAKLERA SKŁADAJĄCEGO WNIOSEK		
BŁĘDNE ZLECENIE/ZLECENIA Numer błędnego zlecenia/ numery błędnych zleceń, na podstawie którego (-ych) zawarto transakcje (Order Id)

Załącznik nr 3**Dane kontaktowe:**dn@tge.pl – adres email do złożenia wniosku

+48 22 341 99 60 - numer kontaktowy

OŚWIADCZENIE WOLI CZŁONKA GIEŁDY/ CZŁONKA OTF, BĘDĄCEGO DRUGĄ STRONĄ TRANSAKCJI

(Czytelnie wypełnić)

Formularz należy wysłać z adresu email maklera wypełniającego wniosek.

NAZWA CZŁONKA GIEŁDY/ CZŁONKA OTF		
IMIĘ I NAZWISKO MAKLERA SKŁADAJĄCEGO OŚWIADCZENIE WOLI		
BŁĘDNA TRANSAKCJA/TRANSAKCJE Numer identyfikacyjny / numery identyfikacyjne transakcji do anulowania (Trade ID)

Członek Giełdy/ Członek OTF **wyraża zgodę** na anulowanie w/w transakcji.*

Członek Giełdy/ Członek OTF **nie wyraża zgody** na anulowanie w/w transakcji. *

Uzasadnienie Członka Giełdy/ Członka OTF w przypadku nie wyrażenia zgody na anulowanie transakcji :

.....

.....

.....

.....

.....

.....

*zaznaczyć krzyżykiem wybrana decyzję