

Szanowni Państwo,

na podstawie Rozdziału 5 ust. 4 Szczegółowych zasad nadzoru Rynku Towarów Giełdowych Towarowej Giełdy Energii S.A., niniejszym przekazuję Państwu Raport kwartalny z działalności Biura Nadzoru Rynku Towarowej Giełdy Energii S.A. za okres od 1 lipca do 30 września 2014 r.

Celem upubliczniania na stronie internetowej Towarowej Giełdy Energii S.A. (dalej „Giełda”) raportów z działalności Biura Nadzoru Rynku (dalej „BNR”) jest zapoznanie Państwa z działaniami podejmowanymi przez Giełdę w zakresie sprawowanego nadzoru. Działania te mają służyć zwiększeniu bezpieczeństwa obrotu giełdowego, w szczególności poprzez przeciwdziałanie możliwej manipulacji na rynku oraz nadzorowi nad przestrzeganiem regulacji Giełdy przez jej Członków.

BNR prowadziło poniższe działania dla wypełnienia nałożonych zadań nadzorczych:

Czynności wyjaśniające.

BNR zidentyfikowało lub otrzymało informacje od jednostek organizacyjnych Giełdy o przypadkach podejrzenia naruszenia przepisów obowiązujących na Rynku Towarów Giełdowych.

Naruszenia dotyczyły:

- a) nie przekazania informacji o zmianach dotyczących Jednostek grafikowych udostępnionych lub Kodu ZUP udostępnionego;
- b) nie przekazania informacji o odwołaniu upoważnienia dla maklera reprezentującego Członka Giełdy w transakcjach giełdowych;
- c) błędnego określenia parametrów zlecenia dotyczących ceny i wolumenu, typu zlecenia;
- d) nieuprawnionego przekazania dostępu do systemów informatycznych Giełdy.

BNR podjęło postępowania wyjaśniające z poszczególnymi Członkami Giełdy dotyczące w/w zdarzeń.

Odnośnie naruszeń wskazanych w pkt. a) i b), należy stwierdzić, że zgodnie z § 21 ust. 1 Regulaminu obrotu Rynku Towarów Giełdowych Towarowej Giełdy Energii S.A. (dalej „Regulamin”), Członek Giełdy zobowiązany jest niezwłocznie informować Giełdę o wszelkich zmianach danych zawartych we wniosku o dopuszczenie do działania na giełdzie, w tym w szczególności danych służących zgłaszaniu transakcji do fizycznej realizacji oraz danych dotyczących maklera reprezentującego Członka Giełdy w transakcjach giełdowych.

Przekazanie do odpowiedniego Operatora Systemu Przesyłowego zgłoszenia zawierającego nieaktualne dane dotyczące któregośkolwiek z uczestników rynku giełdowego, skutkuje odrzuceniem takiego zgłoszenia Giełdy, a tym samym brakiem możliwości zgłoszenia do fizycznej realizacji transakcji zawartych odpowiednio na rynkach giełdowych energii elektrycznej lub gazu.

Odnośnie naruszenia wskazanego w pkt. c), zgodnie z § 39 ust. 1 Regulaminu, Członek Giełdy jest zobowiązany do stosowania środków organizacyjnych i technicznych służących kontroli wielkości i poprawności zleceń składanych na giełdzie. Mogą one polegać np. na wprowadzeniu limitu ceny i wolumenu dla danej grupy instrumentów w aplikacjach maklerskich. Składanie błędnych zleceń może prowadzić do zawarcia niekorzystnych dla danego podmiotu transakcji, których anulowanie może nastąpić w określonych przypadkach i wymaga poniesienia stosownej opłaty.

Odnośnie naruszenia wskazanego w pkt. d), osoba otrzymująca dostęp do systemu produkcyjnego giełdowych systemów informatycznych Giełdy, zobowiązuje się nie umożliwiać dostępu do tego systemu osobom nieuprawnionym. Przekazanie dostępu może skutkować naruszeniem porządku giełdowego. Dostęp do systemów informatycznych Giełdy na wniosek BNR został zablokowany do czasu wyjaśnienia zdarzenia.

Zestawienie wykonanych zadań nadzorczych i naruszeń:

Kontrole planowe	1
Kontrole doraźne	1
Przekazanie raportów dotyczących przeciwdziałaniu manipulacji do Komisji Nadzoru Finansowego	13
Przekazanie raportów dotyczących przeciwdziałaniu manipulacji do Urzędu Regulacji Energetyki	2
Błąd / podejrzenie błędu maklera przy składaniu zleceń, zamiana danych ceny i wolumenu	3
Błąd maklera przy składaniu zlecenia, wprowadzono błędny rodzaj zlecenia kupno/sprzedaż	1
Nie poinformowanie Giełdy o odwołaniu maklera do reprezentacji Członka Giełdy	2
Brak informacji o zmianach dotyczących jednostki graficznej udostępnionej lub kodu ZUP udostępnionego	2
Podejrzenie nieuprawnionego przekazania dostępu do systemów informatycznych Giełdy	1

Czynności edukacyjne.

Mając na celu zwiększenie wiedzy i świadomości uczestników rynku giełdowego w zakresie bezpieczeństwa obrotu, pracownik BNR prowadził szkolenia dla maklerów reprezentujących Członków Giełdy przed dopuszczeniem ich do działania na giełdzie, w ramach szkoleń organizowanych przez Giełdę.

Piotr Krawczak
Dyrektor
Biuro Nadzoru Rynku