

XBID – Zasady Notowań

Urszula Skrzypkowska
Biuro Operacji Giełdowych
Warszawa, 16.09.2019



Agenda

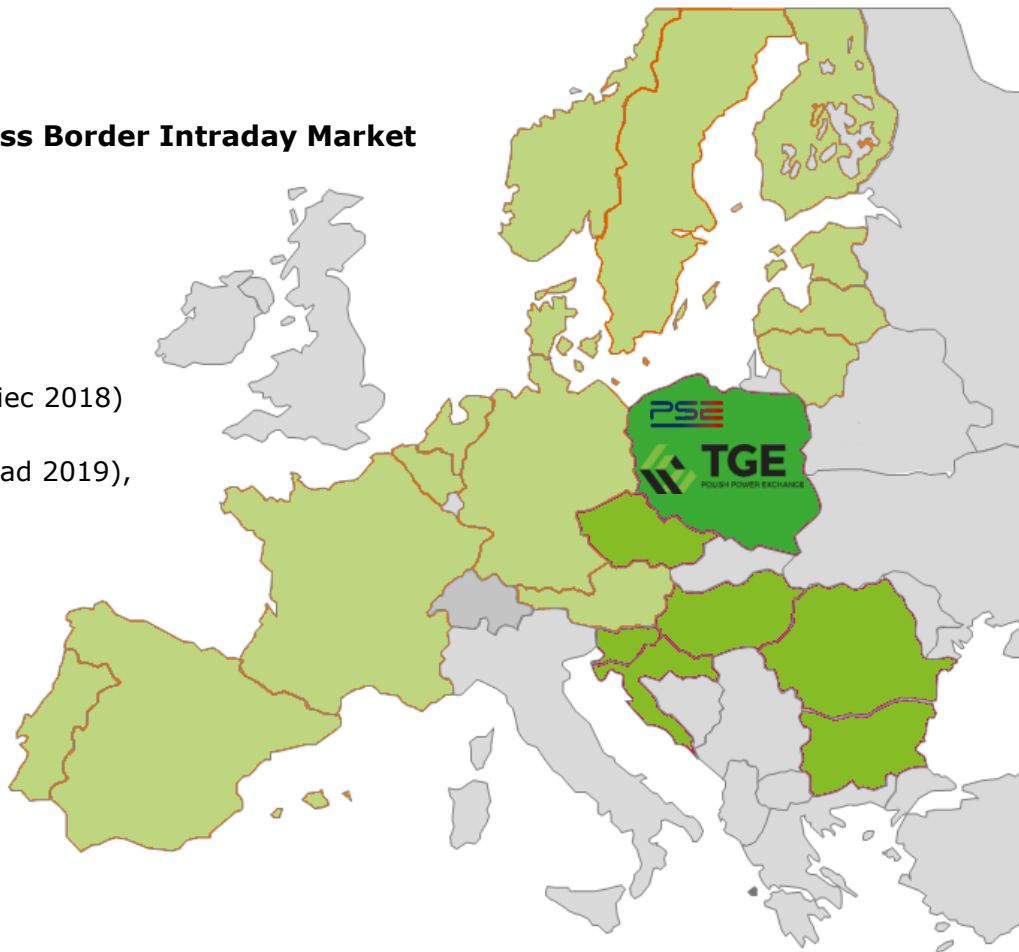
SIDC a XBID...	3
Mechanizm działania XBID – M7	4
Instrumenty	5
Instrumenty w M7 i XCLR	6-7
Instrumenty zdefiniowane przez użytkownika	8
Harmonogram notowań	9
Fazy notowań	10
Halt/Trading	11
Zlecenia	12
Zlecenia – parametry	13
Zlecenia – prewalidacja, anulowanie transakcji	14
Zlecenia – parametryzacja ograniczeń	15-16
Zdolności przesyłowe w systemie M7	17-18
Historia zleceń i transakcji	19
Pobieranie raportów z WebGUI	20

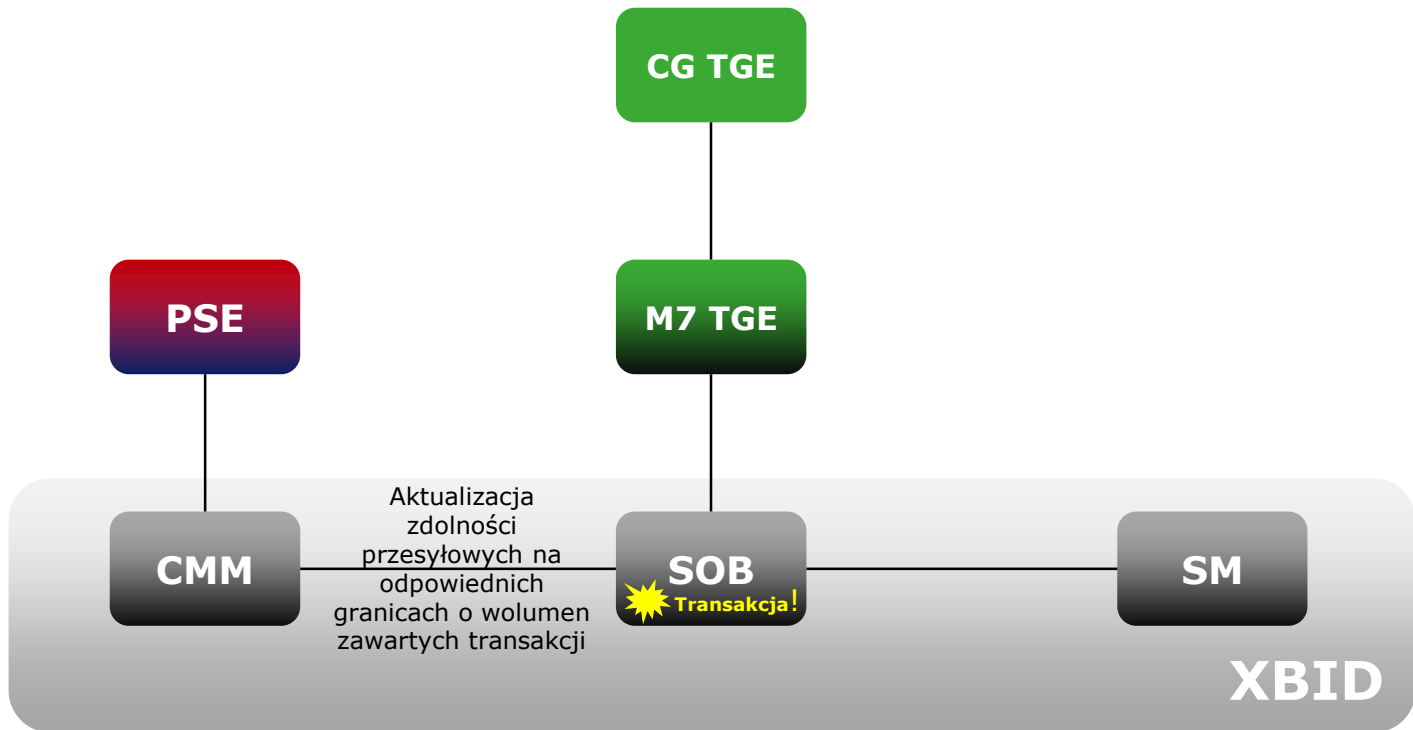


Single Intraday Coupling = Cross Border Intraday Market

 kraje 1st wave (go-live: czerwiec 2018)

 kraje 2nd wave (go-live: listopad 2019),
w tym Polska





- ◆ Przedmiot obrotu → energia elektryczna
- ◆ Instrumenty godzinowe
- ◆ Kod w systemie notującym → **(T)GG-(T/TT)GG_XB**
 - ✓ GG oznacza godzinę rozpoczęcia lub zakończenia okresu dostawy (zaczynając od północy oznaczonej jako „00” a kończąc na godzinie 23 oznaczonej jako „23”)
 - ✓ Brak „T” lub „TT” oznacza godziny dnia bieżącego n
 - ✓ „T” oznacza godziny dnia następnego n+1
 - ✓ „TT” oznacza godziny dnia n+2
- ◆ Kod w systemie rozliczeniowym → **IDM_DD-MM-RR_HGG**
- ◆ Termin wykonania → jedna godzina doby określona kodem instrumentu
- ◆ Nominał → 1 instrument = 1 MWh energii elektrycznej (z dokładnością do 0,1MWh)
 - ✓ Wolumen pojedynczego zlecenia musi zawierać się w przedziale od 0,1 do 999 MWh
- ◆ Kurs → EUR/MWh (z dokładnością do 0,01 EUR)
 - ✓ Zakres dopuszczalnych cen dla pojedynczego zlecenia = < -9 999 €/MWh; 9 999 €/MWh>

M7	XCLR	
01-02_XB	IDM_16-09-2019_H02	dzień bieżący
02-03_XB	IDM_16-09-2019_H03	
...	...	
22-23_XB	IDM_16-09-2019_H23	
23-T00_XB	IDM_16-09-2019_H24	dzień następny
T00-T01_XB	IDM_17-09-2019_H01	
T01-T02_XB	IDM_17-09-2019_H02	
...	...	
T21-T22_XB	IDM_17-09-2019_H22	dzień następny
T22-T23_XB	IDM_17-09-2019_H23	
T23-TT00_XB	IDM_17-09-2019_H24	

Market Overview (Predefined products)

Search Ⓢ + -

▶ ☒ XBID_Hour_Power

R	+	Area	Ctrct
✕		PSE	07-08_XB
✕		PSE	08-09_XB
✕		PSE	09-10_XB

Market Overview (Predefined products)

Search Ⓢ + -

▶ ☒ XBID_Hour_Power

R	+	Area	Ctrct
✕	+	PSE	T00-T01_XB
✕	+	PSE	T01-T02_XB
✕	+	PSE	T02-T03_XB

Start trading	End trading	Market	Instrument definition	Instrument series	Lot size	Start delivery	End delivery
2019-09-02 14:00:00	2019-09-02 22:59:59	RDB	IDM	IDM_03-09-19_H01	1,0	2019-09-03 00:00:00	2019-09-03 00:59:59
2019-09-02 14:00:00	2019-09-02 23:59:59	RDB	IDM	IDM_03-09-19_H02	1,0	2019-09-03 01:00:00	2019-09-03 01:59:59
2019-09-02 14:00:00	2019-09-03 00:59:59	RDB	IDM	IDM_03-09-19_H03	1,0	2019-09-03 02:00:00	2019-09-03 02:59:59

Instrumenty zdefiniowane przez użytkownika

- ◆ Instrumenty blokowe zdefiniowane są na podstawie instrumentów godzinowych
- ◆ Okres dostawy instrumentu blokowego definiowany jest przez użytkownika
 - ✓ wskazanie godziny rozpoczęcia dostawy bloku
 - ✓ wskazanie godziny zakończenia dostawy bloku
- ◆ Okres dostawy instrumentu blokowego musi być zdefiniowany jako ciąg przynajmniej 2 następujących po sobie godzin (uwaga: w momencie składania na rynek zlecenia blokowego poszczególne kontrakty godzinowe definiujące ten blok muszą być w fazie notowań)

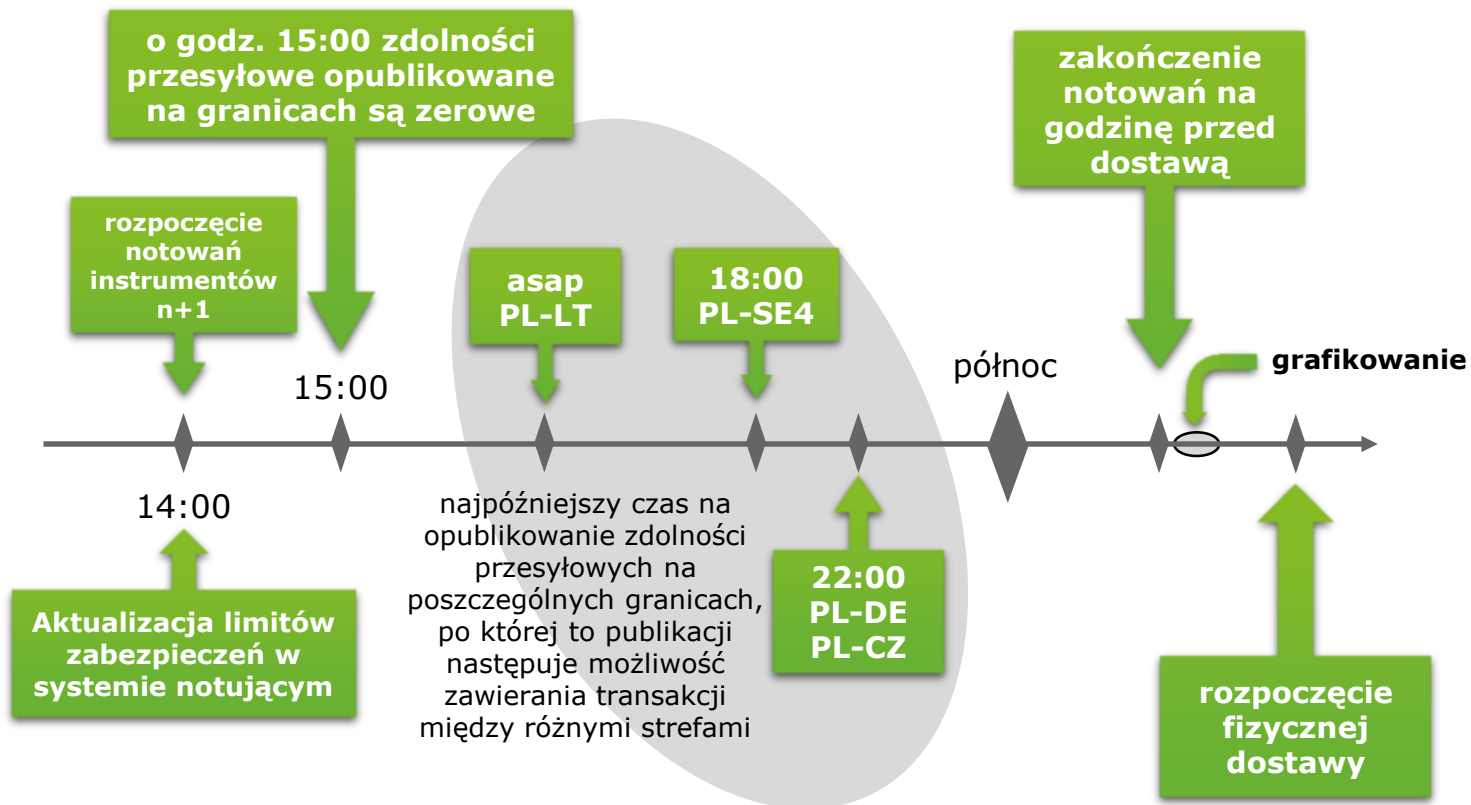
Area	Ctrct
 PSE	15-20_XB

Front Contract	Rear Contract
15-16_XB	19-20_XB

- ◆ instrumenty generowane są w systemie notującym dopiero w momencie złożenia danego zlecenia przez użytkownika na rynek

Area	Ctrct	Cur	Phas	State
 PSE	15-20_XB	EUR	CLSD	ACTI
 PSE	16-21_XB	EUR	CONT	ACTI
 PSE	20-T06_XB	EUR	CONT	ACTI

Harmonogram notowań



Fazy notowań:

- ♦ CLSD → brak notowań, brak możliwości składania zleceń
- ♦ CONT → faza notowań ciągłych, możliwość składania zleceń

Nietypowe zdarzenia:

- ♦ „Service set to Halt”
- ♦ „Service set to Trading”
- ♦ „DA set to Halt”
- ♦ „DA set to Trading”

Ctrct	▲	Cur	Phas	State
13-14_XB		EUR	CLSD	ACTI
14-15_XB		EUR	CLSD	ACTI
15-16_XB		EUR	CONT	ACTI
16-17_XB		EUR	CONT	ACTI

Service set to Halt

- ♦ zmiana stanu instrumentów:
 - ✓ Active → Halt
- ♦ brak możliwości zawierania transakcji
- ♦ brak możliwości składania zleceń i operacji na zleceniach
- ♦ dotychczasowe zlecenia rynkowe zostają deaktywowane przez system

DA set to Halt

- ♦ zmiana stanu instrumentów:
 - ✓ Active → Halt
- ♦ brak możliwości zawierania transakcji
- ♦ brak możliwości składania zleceń i operacji na zleceniach
- ♦ możliwość usuwania zleceń
- ♦ dotychczasowe zlecenia rynkowe zostają deaktywowane przez system

Service set to Trading

- ♦ zmiana stanu instrumentów
 - ✓ Halt → stan wynikający z harmonogramu notowań
- ♦ możliwość zawierania transakcji
- ♦ możliwość składania zleceń i operacji na zleceniach
- ♦ możliwość aktywacji deaktywowanych zleceń

DA set to Trading

- ♦ zmiana stanu instrumentów
 - ✓ Halt → stan wynikający z harmonogramu notowań
- ♦ możliwość zawierania transakcji jeśli równocześnie „Service status = Trading”
- ♦ możliwość składania zleceń i operacji na zleceniach
- ♦ możliwość aktywacji deaktywowanych zleceń

Typy zleceń

REG

zlecenie regularne

ICB

zlecenie typu Iceberg

Warunki realizacji

NON

brak warunku realizacji

IOC

zlecenie natychmiastowe
realizowane w całości,
częściowo lub wcale
(niezrealizowana część
zlecenia zostaje anulowana)

FOK

zlecenie natychmiastowe
realizowane w całości lub
wcale

Termin realizacji

GFS

zlecenie ważne do końca
notowań kontraktu

GTD

zlecenie ważne do czasu
zdefiniowanego przez
wprowadzającego zlecenie

Zlecenia - parametry

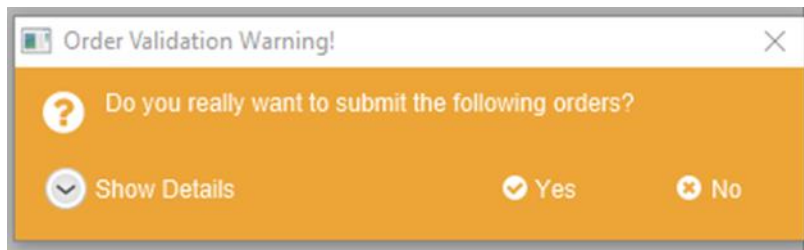
Side Buy Sell	Contract Contract	Quantity Qty	Price Price	Type REG	Val.Restr. GFS	Date & Time Validity Date	Area PSE	
Text Text		Recv BG Recv BG		Acct P	O/C O	Balancing Group	Exe.Restr. NON	State ACTI

Side Buy Sell	Contract 07-08_XB 08-09_XB 09-10_XB 10-11_XB	State ACTI ACTI HIBE	Type REG REG ICB	Peak Peak	Delta Delta
Exe.Restr. NON NON IOC FOK	Quantity 20.0	Price (EUR) Price	Val.Restr. GTD GFS GTD	Balancing Group TEST2-TA	Date & Time 20:55 12.09.2019 20:50 12.09.2019 20:45 12.09.2019 20:40 12.09.2019
Text Text					

- ◆ Prewalidacja zleceń kupna
 - ✓ w przypadku przekroczenia dopuszczalnego limitu zabezpieczeń **WSZYSTKIE!** zlecenia Członka Giełdy zostają automatycznie zahibernowane przez system → system wyświetli komunikat
- ◆ **BRAK możliwości anulowania transakcji!!!**

Jak zatem ustrzec się przed złożeniem błędnego zlecenia na rynek, które może stać się podstawą do zawarcia transakcji?

System M7 umożliwia użytkownikowi zdefiniowanie parametrów zlecenia, których naruszenie spowoduje wyświetlenie komunikatu ostrzegającego przed złożeniem takiego zlecenia na rynek.



Zlecenia – parametryzacja ograniczeń

Settings

General Trading Preferences Order Validations Order Preferences Sound Export M7

Exch	Product	Side	LwrPrc	UpprPrc	Qty	CshVal
	XBID_Hour_Power	Both	10.00	200.00	400.0	50000
	XBID_Hour_Power	Buy		200.00	500.0	
	XBID_Hour_Power	Sell	-20.00			
	XBID_Hour_Power	Sell			450.0	

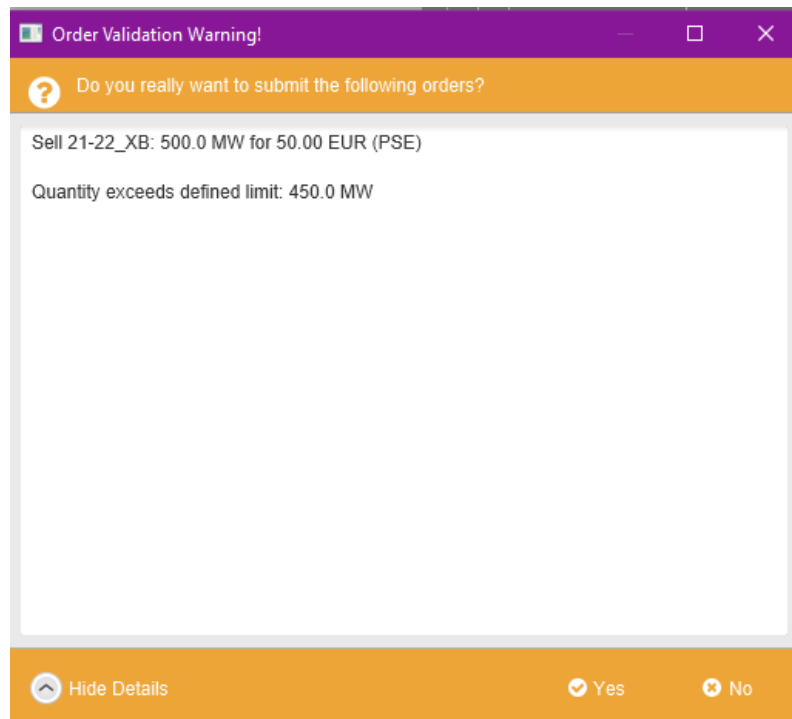
Product: XBID_Hour_Power Side: BOTH Lower Price: Lower Price Upper Price: Upper Price Quantity: Quantity Cash Value: Cash Value

Add Modify Remove

Reset to default Apply Ok Cancel

Ostrzeżenie!

- ◆ Czy na pewno chcesz wprowadzić to zlecenie?
- ◆ Rozwiń szczegóły i sprawdź raz jeszcze parametry swojego zlecenia!
- ◆ Sprawdź który z określonych przez Ciebie warunków ostrzegawczych naruszyłeś!
- ◆ Odrzuć zlecenie, jeśli rzeczywiście się pomyliłeś lub... złóż повторно zweryfikowane przez Ciebie zlecenie na rynek



- ◆ Zdolności przesyłowe wyświetlane w podziale na poszczególne okresy dostawy
 - ◆ Obszary opisane kodami EIC
 - ◆ Każda zmiana wartości zdolności przesyłowych dokonana przez OSP powoduje aktualizację podglądu
 - ◆ Każda zmiana wartości zdolności przesyłowych wynikająca z zawarcia transakcji powoduje aktualizację podglądu
 - ◆ Podgląd zdolności przesyłowych z obszaru „DA1” do obszaru „DA2” wskazuje wartości zdolności przesyłowych na wszystkich możliwych ścieżkach przesyłu pomiędzy tymi obszarami
-
- | | | | |
|------------|------------------------|------------|------------------------|
| ◆ PL → DE | PSE → 10YDE-VE-----2 | ◆ DE → PL | 10YDE-VE-----2 → PSE |
| ◆ PL → CZ | PSE → 10YCZ-CEPS-----N | ◆ CZ → PL | 10YCZ-CEPS-----N → PSE |
| ◆ PL → LT | PSE → 10YLT-1001A0008Q | ◆ LT → PL | 10YLT-1001A0008Q → PSE |
| ◆ PL → SE4 | PSE → 10Y1001A1001A47J | ◆ SE4 → PL | 10Y1001A1001A47J → PSE |

Capacity display (Hub To Hub)

Dlvry Prd ▲	PSE→10YDE-VE-----2	10YDE-VE-----2→PSE
15-16	→ 0.000	→ 0.000
16-17	→ 0.000	→ 0.000
17-18	→ 0.000	→ 0.000
18-19	→ 0.000	→ 0.000

Capacity display (Hub To Hub)

Dlvry Prd ▲	PSE→10YDE-VE-----2	10YDE-VE-----2→PSE
T00-01	↘ 2611.600	→ 1489.400
T01-02	↗ 2635.100	→ 1546.000
T02-03	↗ 2385.900	→ 1638.000
T03-04	↗ 2432.300	→ 1497.300

- ◆ użytkownik „User Role – Reporting”
- ◆ możliwość pobierania „raportów” poprzez M7 WebGUI
 - ✓ format XML
 - ✓ subskrypcja wybranych typów raportów, a następnie możliwość pobierania ich codziennie
 - ✓ generowany 1 raport dla każdego zasubskrybowanego typu raportu
 - ✓ raporty generowane dobowo
- ◆ Typy raportów
 - ✓ TC540 Daily Order Maintenance
 - ◆ operacje na zleceniach
 - ✓ TC810 Daily Trade Confirmation
 - ◆ Informacje o transakcjach

Pobieranie raportów z WebGUI

Subscribe Reports

ID	Freq	Name	Subscribe
TC540	D	Daily Order Maintenance Report	☒
TC810	D	Daily Trade Confirmation Report	☒
TC820	D	Open Otc Maintenance Report	☐

Save subscriptions

Download Reports

ID	Size	Date	Filename
TC540	1 KB	07.09.2019	plpx_TC540_20190906_TEST2_M7USR011.xml.zip
TC540	428 bytes	08.09.2019	plpx_TC540_20190907_TEST2_M7USR011.xml.zip
TC540	1 KB	09.09.2019	plpx_TC540_20190908_TEST2_M7USR011.xml.zip
TC540	428 bytes	10.09.2019	plpx_TC540_20190909_TEST2_M7USR011.xml.zip
TC540	427 bytes	11.09.2019	plpx_TC540_20190910_TEST2_M7USR011.xml.zip
TC540	1 KB	12.09.2019	plpx_TC540_20190911_TEST2_M7USR011.xml.zip
TC810	1 KB	07.09.2019	plpx_TC810_20190906_TEST2_M7USR011.xml.zip
TC810	428 bytes	08.09.2019	plpx_TC810_20190907_TEST2_M7USR011.xml.zip
TC810	428 bytes	09.09.2019	plpx_TC810_20190908_TEST2_M7USR011.xml.zip
TC810	427 bytes	10.09.2019	plpx_TC810_20190909_TEST2_M7USR011.xml.zip

Dziękuję za uwagę!

Urszula Skrzypkowska
Biuro Operacji Giełdowych
Warszawa, 16.09.2019

