Instrucțiunea 6

privind elementele Structura Zilnca a Contului si

rapoartele furnizate de BRM catre MC

Valabila de la data de ... 03.2025

# Structura Zilnica a Contului

1. **Soldul contului** = Totalul Garanțiilor constituite de catre MC
   * Garantiile sunt ***constituite*** *de catre MC* (Ex: SGB sau numerar prin ordin de plata) sau ***trase*** *de catre BRM* din Contul de Disponibil prin Direct Debit
   * Soldul Contului este valoare pozitiva (minim 0)
   * **Soldul contului evidentiaza analitic fondurile banesti in numerar**
2. **Limita de Risc** = Totalul Marjelor necesare a fi constituite de catre MC
   * Totalul marjelor: Marja Inițială cumulată + Marja de Variație cumulată + Marja de Livrare Fizica cumulată
   * Marja Inițială cumulată poate avea valoare negativă (-) sau 0
   * Marja de Variație cumulată poate avea valoare negativă (-) sau 0 sau pozitivă (+); *în cazul în care exista Marje de Variație pe Contract pozitive acestea vor*

*fi ajustate la maxim nivel de compensare conform Regulamentului, în vederea calculării Marjei de Variație cumulate.*

* + Marja de Livrare Fizică cumulată poate avea valoare negativă (-) sau 0

1. **Apelul în Marjă** = situația de necesar de Garanții suplimentare, respectiv **(i)+(ii) < 0.**

*Valoarea Apelului în Marjă este (i)+(ii).*

1. **Limita de tranzacționare** = situația de excedent de Garanții, respectiv **(i)+(ii) > 0**.

*Valoarea limitei de tranzacționare este de (i) + (ii)*

1. **Disponibilul numerar** = fondurile din Soldul Contului depuse în numerar și neblocate în Garanții pentru Marje. *Există doar în cazul în care (1) +(2) >0.*
   * Disponibilul in numerar este o parte din Soldul Contului cu o valoare cuprinsa in 0 si maximum valoarea Soldului Contului
   * Disponibilul in numerar reprezinta suma ce poate fi retrasa efectiv de catre un MC in acord cu *Instructiunea privind Stabilirea Programul Zilnic* si cu respectarea

*Instructiunii privind Determinarea Valorilor Marjei de Livrare Fizica*

* + Disponibilul in numerar reprezinta o suma de bani la dispozitia MC nefiind afectata de Pozitiile deschise sau ordinele din Piata
  + Disponibilul in numerar se evidentiaza in situatiile zilnice remise MC
  + Disponbilul in numerar poate fi solicitat oricand de catre MC, dar eliberararea catre sistemul bancar *(plata acestuia)* se face doar cu conditia mentinerii

incadrarii in Limita de Risc la finalul Zilei

# Rapoarte furnizate de BRM in calitate de Contraparte catre MC

**Lista rapoarte:**

* 1. **Raport de tranzactionare**
* Cuprinde lista de Tranzactii executate in cadrul Zilei curente din cadrul Pietei din Romania si a celor furnizate de BETP catre BRM pentru Piata din Bulgaria
  1. **Situatia zilnica a Contului**

**Este disponibil de la data deschiderii de Pozitii pe un Contract si pana la finalul Perioadei de Livrare.**

**Evidentiaza Marjele retinute la finalul Zilei pe ordinele in executie valabile cel putin si pentru sedinta urmatoare de tranzactionare**

**Cuprinde situatia sintetica a Contului privind Garantiile, Marjele si Limita de Tranzactionare/Apelul in Marja**

**Evidentiaza depunerile/retragerile de numerar si alte garantii**

* + 1. **Raport pentru Contractele aflate inainte de perioada de Livrare**

***.A.* privind Pozitiile si Marja Initiala pe Contract**

* Cuprinde Pozitiile brute si nete pe fiecare Contract in parte
* Cuprinde valorile Marjei Initiale per Pozitie neta /Contract
* Cuprinde totalul Marjelor initiale: Marja Initiala cumulata

**B privind marcarea la Piata si Marja de Variatie**

* Cuprinde calculatiile din marcarea la Piata pe fiecare Tranzactie in parte *(marcare pe baza bruta)* prin compararea pretului Tranzactiei cu Pretul Zilnic de Decontare
* Cuprinde Pretul Zilnic de Decontare
* Cuprinde calculatia privind Marja de Variatie/Contract inclusiv evidentierea Marjei de Variatie pozitiva pe Contract ce nu se incadreaza pentru compensare
* Cuprinde calculatia privind totalul Marjelor de Variatie, respectiv Marja de Variatie Cumulata pe Cont
  + 1. **Raport privind Contractele aflate in Perioada de Livrare:**

***Este disponibil de la data intrarii in Perioada de Livrare a unui Contract pana la finalizarea Perioadei de Livrare a acestuia.***

* + - 1. ***Raport privind situatia garantiilor retinute si eliberate***

− ***cuprinde marjele retinute pentru Perioda de Livrare***

− ***cuprinde calculatii privind eliberarea garantiilor in Perioada de Livrare***

* + - 1. **Raport privind platile si incasarile aferente livrarii ale unui MC conform Tranzactiilor**
         * Evidentiaza situatia platilor datorate zilnic pentru Activul Suport *operate cu o Zi inainte pentru fiecare zi a Perioadei de Livrare*
         * Evidentiaza situatia incasarilor zilnice pentru *fiecare zi a Perioadei de Livrare, la finalul respectivei Zile*
         * Prezinta un sumar al platilor si incasarilor contabilizate pana la Ziua in curs si a livrarilor si platilor ramase de executat din Perioada de Livrare
         * Prezinta o calculatie zilnica neta *(netting financiar)* pentru compensarile de fluxuri de sume *(in cazul Pozitiilor de sens opus intrate in Perioada de Livrare)* aferente fiecarei zile de livrare prin raportarea la Tranzactii si preturile din Tranzactiile aferente.

***Nota:***

**Rapoartele tehnice detaliate sunt furnizate in cadrul unei interfete IT dedicate MC si prin email.**