

A) PARAMETRY PRO OBCHODOVÁNÍ

I. OBCHODNÍ SKUPINY

Typ kontraktu	Obchodní skupina
Hodinový	G
Denní - nejbližší den (Base Load / Peak Load)	F
Denní (Base Load / Peak Load)	E
Měsíční (Base Load / Peak Load)	A
Kvartální (Base Load / Peak Load)	B
Roční (Base Load / Peak Load)	C

II. KROK KOTACE

Cena v EUR	Krok kotace
< 200,-	0,01 EUR
200 – 1.000,-	0,10 EUR
≥1.000	1,00 EUR

III. POVOLENÉ ODCHYLKY (denní změna)

Typ kontraktu	AUKCE	KONTINUÁL	Čekací doby
Hodinový	neomezeně	-----	-----
Denní (Base Load / Peak Load)	15%	50% + 20% + 20%	5 + 5 min
Měsíční (Base Load / Peak Load)	10%	20% + 5% + 5%	15 + 30 min
Kvartální (Base Load / Peak Load)	7%	15% + 5% + 5%	15 + 30 min
Roční (Base Load / Peak Load)	5%	10% + 5% + 5%	15 + 30 min

IV. VELIKOST KONTRAKTU

Typ kontraktu	Velikost kontraktu
Hodinový	1 MW
Denní (Base Load / Peak Load)	1 MW
Měsíční (Base Load / Peak Load)	1 MW
Kvartální (Base Load / Peak Load)	1 MW
Roční (Base Load / Peak Load)	1 MW

V. MAXIMÁLNÍ VELIKOST OBJEDNÁVKY

Typ kontraktu	Velikost objednávky
Hour	neomezeně
Day (Base Load / Peak Load)	50 MW
Měsíční (Base Load / Peak Load)	25 MW
Kvartální (Base Load / Peak Load)	25 MW
Roční (Base Load / Peak Load)	15 MW

VI. ČINNOST TVŮRCE TRHU (MARKET MAKING)

Parametr	Povinnost
Minimální počet MW pro kotaci	měsíční kontrakty - 10 MW čtvrtletní kontrakty - 5 MW roční kontrakty - 5 MW
Minimální časová lhůta pro kotování	90% doby obchodování (+ 60min polední přestávka)

Typ způsobu kotování	Povinnost kotace
Generální tvůrce trhu	2 nejbližší měsíční, 2 nejbližší čtvrtletní , nejbližší roční Base Load i Peak Load
Tvůrce trhu	nejbližší měsíční, nejbližší čtvrtletní , nejbližší roční pouze Base Load
Specialista	konkrétní kontrakty zvolené specialistou

B) PARAMETRY PRO RISK MANAGEMENT

Vzorce pro výpočet maržového požadavku, kontrolního a sankčního limitu a spot limitu jsou uvedeny v Pravidlech zúčtování obchodů uzavřených na Energetické burze Praha.

I. MARŽOVÉ PARAMETRY PRO FUTURES A SPOT PRODUKTY

Maržové parametry pro futures EUR / MWh				
Místo registrace	CZ (ČEPS)		SK (SEPS), HU (MAVIR)	
Futures	Base	Peak	Base	Peak
Roční	2,7	3,5	2,9	3,7
Čtvrtletní	2,9	3,7	3,1	3,9
Měsíční	4,5	7,5	4,8	8,5
Delivery konstanta MWh				
Místo registrace	CZ (ČEPS)		SK (SEPS), HU (MAVIR)	
Futures	Base	Peak	Base	Peak
Měsíční M+0 s fyz. dodávkou	144	48	144	48
Měsíční M+0 finanční vyp.	72	24	-	-
Delivery koeficient				
Místo registrace	CZ (ČEPS)		SK (SEPS), HU (MAVIR)	
Futures	Base	Peak	Base	Peak
Měsíční M+0	2,2	2	2,2	2
Maržové parametry pro spot produkty EUR / MWh				
Místo registrace	CZ (ČEPS)		HU (MAVIR)	
Spot produkty	Nákup	Prodej	Nákup	Prodej
Hodinové kontrakty	-	-	20	30
Denní kontrakty (base, peak)	20	30	20	30
Koeficient OTC ceny				
Místo registrace	CZ (ČEPS)		SK (SEPS), HU (MAVIR)	
Futures	Base	Peak	Base	Peak
Roční, čtvrtletní a měsíční	0,7	0,7	0,7	0,7

II. VÝŠE MINIMÁLNÍHO MARŽOVÉHO VKLADU PRO ÚČASTNÍKY OBCHODOVÁNÍ

Minimální výše maržového vkladu EUR	
tvůrce trhu	550 000
účastník obchodování	230 000

III. VÝŠE KONTROLNÍHO A SANKČNÍHO LIMITU

Koeficienty L1 a L2	
L1 - kontrolní limit	0,6
L2 - sankční limit	0,8