

Instrucțiunea 6  
**privind elementele Structura Zilnica a Contului**  
**si**  
**rapoartele furnizate de BRM catre MC**

**1. Structura Zilnica a Contului**

- i. **Soldul contului** = Totalul Garanțiilor constituite de catre MC
- Garanțiile 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**
- ii. **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
- iii. **Apelul în Marjă** = situația de necesar de Garanții suplimentare, respectiv **(i)+(ii) < 0**.  
*Valoarea Apelului în Marjă este (i)+(ii).*
- iv. **Limita de tranzacționare** = situația de excedent de Garanții, respectiv **(i)+(ii) > 0**.  
*Valoarea limitei de tranzacționare este de (i) + (ii)*
- v. **Disponibilul numerar** = fondurile din Soldul Contului depuse în numerar și neblockate 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
- Disponibilul in numerar poate fi solicitat oricand de catre MC, dar eliberarea catre sistemul bancar (*plata acestuia*) se face doar cu conditia mentinerii incadrarii in Limita de Risc la finalul Zilei

vi. **Tarifele.**

Tarifele sunt doar calculate la nivelul Contului. Nu se iau in calcul la stabilirea nivelului de Garantii, a Limitei de Tranzactionare sau a Apelului in Marja

## **2. Rapoarte furnizate de BRM catre MC**

### **Lista rapoarte:**

#### **2.1 Raport de tranzactionare**

- Cuprinde lista de Tranzactii executate in cadrul Zilei curente

#### **2.2 Raport privind ordinele**

- Cuprinde lista de ordine introduse in Piata in cadrul Zilei curente
- Evidentiaza ordinele de tranzactionare de durata cu valabilitate si pentru Ziua urmatoare

#### **2.3 Situatia zilnica a Contului**

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

**Evidentiaza ordinele de durata la finalul Zilei si marjele initiale retinute**

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

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

##### **2.3.1 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

## **2.3.2 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.*

### **2.3.2.1 Raport privind situatia garantiilor retinute si eliberate**

- *cuprinde marjele retinute pentru Perioda de Livrare*
- *cuprinde calculatii privind eliberarea garantiilor in Perioada de Livrare*

### **2.3.2.2 Raport privind platile si incasarile aferente livrarii pentru un 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 de sistemul IT al BRM!**