

part of eex group

› getbaltic

Papildomų prekybos limitų suteikimo biržos dalyviams taisyklės

2020 m. kovo 17 d.
Vilnius

PATVIRTINTA
UAB GET Baltic generalinio direktoriaus
2019-04-03 įsakymu Nr. 6/2019

REDAKCIJA
UAB GET Baltic generalinio direktoriaus
2020-03-17 įsakymu Nr. 10/2020

Turinys

1.	Bendrosios nuostatos	3
2.	Prekybos limito suteikimo principai	3
3.	Kredito reitingo nustatymas	4
4.	Prekybos limito nustatymas	5
5.	Prekybos limito galiojimas, sumažinimas, stabdymas ir atšaukimas	5

Papildomų prekybos limitų suteikimo biržos dalyviams taisyklės

Redakcija taikoma nuo: 2020 m. kovo 17 d.

1. Bendrosios nuostatos

1.1. UAB GET Baltic (toliau – Bendrovė) papildomų prekybos limitų suteikimo biržos dalyviams taisyklės (toliau – Taisyklės) nustato papildomų prekybos limitų (toliau – Prekybos limitas) suteikimo biržos dalyviams (toliau – Dalyvis) tvarką bei Dalyvių kredito rizikos ir kitų svarbių aplinkybių vertinimo principus suteikiant Prekybos limitą, pagal UAB GET Baltic prekybos gamtinių dujų biržoje reglamentą (toliau – Prekybos gamtinių dujų biržoje reglamentas).

1.2. Taisyklių tikslas – nustatyti tvarką ir reikalavimus, kuriais vadovaujantis įvertinus atskirų Dalyvių kredito rizikos kiekybinius (finansiniai santykiniai rodikliai) ir kokybinius (ekonominės veiklos sąlygos) veiksnius nustatomas Dalyvio kredito reitingas (toliau – Kredito reitingas), Bendrovės rekomenduojamas suteikti Prekybos limitas, suteikto Prekybos limito galiojimas, sumažinimas, stabdymas ir atšaukimas.

1.3. Bendrovėje Prekybos limitai Dalyviams yra suteikiami vadovaujantis kredito rizikos vertinimo modeliu, taip pat kitomis Apraše nurodytomis aplinkybėmis.

1.4. Taisyklėmis vadovaujasi Dalyviai, kurie siekia pasinaudoti Prekybos gamtinių dujų biržoje reglamente numatyta galimybe gauti Prekybos limitą, Bendrovės Valdyba ir Bendrovės darbuotojai, kurių darbo funkcijos susijusios su Dalyvių kredito rizikos vertinimu ir Prekybos limitų suteikimu.

1.5. Taisyklėse numatyti Prekybos limitų suteikimo principai taikomi suteikiant Prekybos limitus nuo 2018 m. birželio 28 d.

1.6. Taisyklės skelbiamos viešai Bendrovės internetinėje svetainėje adresu www.getbaltic.com.

2. Prekybos limito suteikimo principai

2.1. Dalyvis siekdamas pasinaudoti Prekybos gamtinių dujų biržoje reglamente numatyta galimybe gauti Prekybos limitą, kuris yra suteikiamas Bendrovės Valdybos sprendimu, privalo raštu kreiptis į Bendrovę su prašymu suteikti Prekybos limitą nurodant prašomo Prekybos limito sumą ir pridėdant paskutinių 2 (dviejų) ataskaitinių metų finansinių ataskaitų rinkinį (finansinės būklės ataskaitą ir pelno (nuostolio) ataskaitą) bei metinį pranešimą (neprivaloma)).

2.2. Bendrovė, gavusi Dalyvio prašymą, įvertindama Dalyvio kiekybinius (finansinių ataskaitų) ir kokybinius (kreditų biuro ir (arba) kitus viešai prieinamus) duomenis atlieka Dalyvio kredito rizikos vertinimą ir nustato Dalyvio Kredito reitingą.

2.3. Jeigu Bendrovė, įvertinusi Dalyvio pateiktą informaciją nustato, kad Dalyvio Kredito reitingas yra nepakankamas Prekybos limito suteikimui, Bendrovė, per 10 darbo dienų nuo Dalyvio prašymo pateikimo dienos, informuoja Dalyvį apie tokius kredito rizikos vertinimo rezultatus.

2.4. Dalyvis gavęs Taisyklių 2.3. punkte nurodytą Bendrovės atsakymą, gali raštu kreiptis į Bendrovę prašydamas suteikti Prekybos limitą įvertinus susijusios įmonės, kuri tiesioginiai, ar netiesiogiai turi lemiamą įtaką ir (arba) balsų daugumą Dalyvio visuotiniame akcininkų susirinkime (toliau – Susijusi įmonė), Kredito reitingą.

2.5. Atsižvelgiant į Dalyviui nustatytą Kredito reitingą, Dalyvio prašymą, prašomo suteikti Prekybos limito ir dalyvio nuosavo kapitalo santykį ir Bendrovės Valdybos patvirtintą maksimalų leistiną Prekybos limito dydį vienam Dalyviui priskirtą konkrečiam Kredito reitingui, Bendrovė nustato rekomenduojamą suteikti Prekybos limitą. Rekomenduojamas suteikti Prekybos limitas yra nustatomas remiantis Taisyklių 4 skyriuje nurodyta tvarka.

2.6. Bendrovė įvertinusi kredito rizikos vertinimo rezultatus ir nustatytą rekomenduojamą suteikti

Prekybos limitą, kreipiasi į Bendrovės Valdybą dėl Prekybos limito suteikimo.

2.7. Dalyviai apie Bendrovės Valdybos priimtą teigiamą ir (arba) neigiamą sprendimą dėl Prekybos limito suteikimo yra informuojami raštu, per 2 (dvi) darbo dienas nuo Bendrovės Valdybos sprendimo priėmimo dienos.

2.8. Jeigu Bendrovės Valdyba priima teigiamą sprendimą suteikti Prekybos limitą Dalyviui, vadovaujantis Susijusios įmonės Kredito reitingu, Dalyvis siekdamas pasinaudoti suteiktu Prekybos limitu privalo Bendrovei pateikti Susijusios įmonės garantinį raštą, kuriuo garantuojamas Dalyvio finansinių įsipareigojimų įvykdymas.

2.9. Bendrovė turi teisę atsisakyti suteikti Prekybos limitą dėl šių priežasčių:

2.9.1. Dalyviui, kuris kreipėsi į Bendrovę dėl Prekybos limito suteikimo yra pradėta bankroto, restruktūrizavimo, atskyrimo ar likvidavimo procedūra;

2.9.2. Dalyvio nuosavas kapitalas yra mažesnis kaip $\frac{1}{2}$ įstatinio kapitalo;

2.9.3. Dalyvis nepateikia informacijos ir/ar dokumentų reikalingų jo kredito rizikos vertinimui arba paaiškėja, jog Dalyvio pateikta informacija yra klaidinga;

2.9.4. Dalyvis nevykdo arba vėluoja vykdyti savo įsipareigojimus sumokėti už Bendrovės suteiktas paslaugas;

2.9.5. Paaiškėja kitos aplinkybės (pablogėjusi finansinė padėtis, nemokumo kitiems tiekėjams požymiai, kitos finansinė riziką sąlygojančios aplinkybės), leidžiančios pagrįstai manyti, kad Dalyvis gali nevykdyti savo įsipareigojimų;

2.9.6. Bendrovės nuosavo kapitalo ir Dalyviams suteiktų Prekybos limitų sumos santykis viršija Bendrovės valdybos patvirtintą maksimalų leistiną santykinį dydį.

2.10. Bendrovė, atsižvelgdama į kitas reikšmingas aplinkybes, nenurodytas šiame Apraše, turi teisę kreiptis į Bendrovės Valdybą su pasiūlymu suteikti Prekybos limitą Dalyviui, neatsižvelgiant į kredito rizikos vertinimo rezultatus.

2.11. Bendrovės Valdyba įvertinusi Bendrovės pateiktą informaciją, priima galutinį sprendimą dėl konkretaus Prekybos limito Dalyviui suteikimo.

3. Kredito reitingo nustatymas

3.1. Dalyviui atlikus kredito rizikos vertinimą yra nustatomas vienas iš 4 (keturių) Kredito reitingų: A, B, C arba D, kur Kredito reitingas A reiškia, kad dalyvio kredito rizika yra maža, Dalyvio gebėjimas vykdyti savo įsipareigojimus nekelia abejonių. Kredito reitingas D reiškia, kad Dalyvio kredito rizika ir tikimybė, kad Dalyvis nevykdys savo įsipareigojimų yra didelė, todėl Prekybos limitas yra rekomenduojama nesuteikti.

3.2. Jeigu Dalyviui Prekybos limitas yra suteikiamas įvertinus Susijusios įmonės kredito riziką, nepriklausomai nuo Susijusiai įmonei nustatyto Kredito reitingo, tokio Dalyvio Prekybos limitas negali būti didesnis kaip C Kredito reitingui nustatytais kriterijais apskaičiuotas maksimalus leistinas Prekybos limitas.

3.3. Dalyvio Kredito reitingas yra nustatomas įvertinus šiuos kredito rizikai įtaką turinčius veiksnius:

3.3.1. Kokybinius (ekonominės veiklos sąlygos) – atliekamas subjektyvus ekspertinis vertinimas, kurio metu analizuojama bendra informacija apie įmonę, jos akcininkus, užimamą rinkos dalį, įvertinama vieša neigiama informacija, įsipareigojimų vykdymas kitiems tiekėjams bei finansinių ataskaitų patikimumas. Kokybinis vertinimas sudaro 50 proc. Kredito reitingo balų

3.3.2. Kiekybinius (finansiniai santykiniai rodikliai) – atliekamas objektyvus ekspertinis vertinimas, kurio metu yra analizuojami mokumo ir pelningumo rodikliai bei pagal Altman Z modelį yra nustatoma prognozuojama Dalyvio bankroto tikimybė per ateinančius dvejus metus. Kiekybinis vertinimas sudaro 50 proc. Kredito reitingo balų

4. Prekybos limito nustatymas

4.1. Bendrovė nustačiusi Dalyvio Kredito reitingą, vadovaudamasi Dalyvio prašymu ir Bendrovės Valdybos patvirtintu maksimalaus leistino prekybos limito vienam Dalyviui dydžiu, nustato rekomenduojamą suteikti Prekybos limitą.

4.2. Rekomenduojamo suteikti Prekybos limito suma Dalyviui yra nustatoma atsižvelgiant į šiuos kriterijus:

4.2.1. Dalyviui nustatytą Kredito reitingą;

4.2.2. Dalyvio prašyme nurodytą Prekybos limitą sumą;

4.2.3. Dydį, kuris yra apskaičiuojamas įvertinus Bendrovės Valdybos patvirtintą maksimalų prekybos limitą ir Dalyvio nuosavo kapitalo santykį;

4.2.4. Bendrovės Valdybos patvirtintą maksimalų leistiną Prekybos limitą dydį vienam Dalyviui priskirtą konkrečiam Kredito reitingui.

4.2.5. Lietuvos Respublikos ir Europos Sąjungos valstybių ekonominę būseną, kitus tuo laikotarpiu rinkai svarbius veiksnius.

4.3. Rekomenduojamo suteikti Prekybos limitą suma yra lygi mažiausiam iš 4.2.2. – 4.2.4. papunkčiuose nurodytam dydžiui.

4.4. Bendrovės Valdyba įvertinusi Dalyvio Kredito reitingą ir Bendrovės siūlomą rekomenduojamą Prekybos limitą, priima galutinį sprendimą dėl konkretaus Prekybos limitą Dalyviui suteikimo.

4.5. Bendrovės Valdyba, įvertinusi kitas reikšmingas aplinkybes, nenurodytas šiame Apraše, turi teisę suteikti Prekybos limitą Dalyviui, kuriam buvo nustatytas D Kredito reitingas

5. Prekybos limitą galiojimas, sumažinimas, stabdymas ir atšaukimas

5.1. Bendrovės Valdybai priėmus sprendimą Dalyviui suteikti Prekybos limitą jis yra suteikiamas iki birželio 30 d. imtinai, bet ne ilgesniam kaip 12 mėnesių laikotarpiui.

5.2. Bendrovė vertindama Dalyvio įsipareigojimų laikymąsi Bendrovei ir (ar) kitas finansinę riziką sąlygojančias aplinkybes gali priimti sprendimą sumažinti, stabdyti arba atšaukti Dalyviui suteiktą Prekybos limitą.

5.3. Bendrovė priima sprendimą sumažinti Bendrovės Valdybos suteiktą Prekybos limitą Dalyviui esant šioms aplinkybėms:

5.3.1. Pasikeičia Dalyvio Kredito reitingas arba sumažėja Kredito reitingo balų skaičius, nors Kredito reitingas nepasikeičia;

5.3.2. Pasikeičia ekonominės aplinkybės, kurios gali sąlygoti didesnes nemokumo ar vėlavimo atsiskaityti rizikas, ar Bendrovė identifikuoja kitas rizikas dėl pasikeitusios finansinės, ekonominės ir (ar) teisinės situacijos (aplinkos).

5.4. Bendrovė priima sprendimą stabdyti suteikto Prekybos limitą galiojimą esant šioms aplinkybėms:

5.4.1. Dalyvis bent 1 dieną vėluoja atsiskaityti už gamtinių dujų biržoje įsigytas dujas ir (arba) už biržos paslaugas;

5.4.2. Bendrovė sužino aplinkybes, galinčias turėti reikšmingos neigiamos įtakos Dalyvio mokumui.

5.4.3. Pasikeičia ekonominės aplinkybės, kurios gali sąlygoti didesnes nemokumo ar vėlavimo atsiskaityti rizikas, ar Bendrovė identifikuoja kitas rizikas dėl pasikeitusios finansinės, ekonominės ir (ar) teisinės situacijos (aplinkos).

5.5. Bendrovė priėmusi sprendimą sumažinti Dalyviui suteiktą Prekybos limitą, Dalyvį apie priimtą sprendimą informuoja nedelsiant ir iki kitos, einančios po sprendimo priėmimo dienos, prekybos sesijos pradžios sumažina Prekybos limitą. Bendrovės sumažintas Prekybos limitas gali būti padidintas iki Valdybos sprendimu nustatyto dydžio Prekybos limitą, kai išnyksta aplinkybės dėl kurių jis buvo sumažintas.

5.6. Bendrovė priėmusi sprendimą stabdyti Dalyviui suteiktą Prekybos limitą galiojimą Dalyvį apie

priimtą sprendimą informuoja nedelsiant ir iki kitos, einančios po sprendimo priėmimo dienos, prekybos sesijos pradžios sustabdo Prekybos limitą galiojimą.

5.7. Dalyviui, kuriam Bendrovės sprendimu Prekybos limitas buvo sustabdytas dėl neįvykdytų įsipareigojimų, įvykdžius įsipareigojimus, t.y. atsiskaičius už gamtinių dujų biržoje įsigytas dujas ir (arba) už biržos paslaugas, ne vėliau kaip per 6 (šešias) dienas nuo pradelsimo pradžios, Bendrovė iki kitos, einančios po įsipareigojimų įvykdymo dienos, prekybos sesijos pradžios, ir nesant kitų aplinkybių, gali priimti sprendimą atstatyti Dalyviui suteikto Prekybos limito galiojimą.

5.8. Dalyviui, kuriam Bendrovės sprendimu Prekybos limitas buvo sustabdytas dėl aplinkybių, galinčių turėti neigiamos įtakos Dalyvio mokumui, per 6 (šešias) dienas nuo sprendimo stabdyti Prekybos limitą priėmimo dienos pagrįstai paneigus aplinkybes dėl kurių Bendrovė priėmė sprendimą stabdyti Prekybos limitą galiojimą, Bendrovė iki kitos, einančios po pagrįsto aplinkybių paneigimo dienos, prekybos sesijos pradžios, ir nesant kitų aplinkybių, gali priimti sprendimą atstatyti Dalyviui suteikto Prekybos limito galiojimą.

5.9. Bendrovė priima sprendimą atšaukti suteiktą Prekybos limitą esant šioms aplinkybėms:

5.9.1. Dalyviui, kuriam Bendrovės sprendimu Prekybos limitas buvo sustabdytas dėl neįvykdytų įsipareigojimų, t.y. Dalyviui neatsiskaičius už gamtinių dujų biržoje įsigytas dujas ir (arba) už biržos paslaugas, neįvykdžius įsipareigojimų per 6 (šešias) dienas nuo pradelsimo pradžios, Bendrovė atšaukia Bendrovės Valdybos sprendimu suteiktą Prekybos limitą ir apie tai raštu per 1 (vieną) darbo dieną informuoja Dalyvį.

5.9.2. Dalyviui, kuriam Bendrovės sprendimu Prekybos limitas buvo sustabdytas dėl aplinkybių, galinčių turėti neigiamos įtakos Dalyvio mokumui, per 6 (šešias) dienas nuo sprendimo stabdyti Prekybos limitą priėmimo dienos pagrįstai nepaneigus aplinkybių dėl kurių Bendrovė priėmė sprendimą stabdyti Prekybos limitą galiojimą, Bendrovė atšaukia Bendrovės Valdybos sprendimu suteiktą Prekybos limitą ir apie tai raštu per 1 d. d. informuoja Dalyvį.

5.9.3. Vienašališku Bendrovės sprendimu iš esmės pasikeitus ekonominei, finansinei ir (ar) teisei situacijai, Bendrovei identifikavus naujas rizikas ir (ar) atsiradus aplinkybėms, kurios savo esme atitinka force majeure aplinkybes, kaip jos apibrėžtos Lietuvos Respublikos civiliniame kodekse, iki kol jos išnyks ir (ar) išnyks jomis sukeltos ekonominės pasekmės ir (ar) rizikos laipsnis bus priimtinas Bendrovei

5.10. Dalyvis turi teisę pakartotinai kreiptis į Bendrovę dėl Prekybos limito suteikimo, iš esmės pasikeitus aplinkybėms dėl kurių Prekybos limitas buvo atšauktas, arba dėl kurių Dalyvis gavo neigiamą atsakymą dėl Prekybos limito suteikimo, tačiau ne anksčiau kaip po 30 kalendorinių dienų nuo dalyvio informavimo apie Prekybos limito atšaukimą arba informavimo apie priimtą neigiamą sprendimą dėl Prekybos limito suteikimo dienos. Nurodytos aplinkybės turėtų būti išdėstytos Dalyvio prašyme suteikti Prekybos limitą.