

**Національна комісія, ЩО ЗДІЙСНЮЄ**

**ДЕРЖАВНЕ РЕГУЛЮВАННЯ У сФЕРАХ ЕНЕРГЕТИКИ**

**ТА КОМУНАЛЬНИХ ПОСЛУГ**

**(НКРЕКП)**

**ПОСТАНОВА**

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ Київ № \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

**Про затвердження** **Змін до Вимог щодо забезпечення доброчесності та прозорості на оптовому енергетичному ринку**

Відповідно до законів України «Про Національну комісію, що здійснює державне регулювання у сферах енергетики та комунальних послуг», «Про ринок електричної енергії» та «Про ринок природного газу» Національна комісія, що здійснює державне регулювання у сферах енергетики та комунальних послуг,

**ПОСТАНОВЛЯЄ:**

1. Затвердити Зміни до Вимог щодо забезпечення доброчесності та прозорості на оптовому енергетичному ринку, затверджених постановою Національної комісії, що здійснює державне регулювання у сферах енергетики та комунальних послуг, від 27 березня 2024 року № 614, що додаються.

2. Ця постанова набирає чинності з дня, наступного за днем її оприлюднення на офіційному вебсайті Національної комісії, що здійснює державне регулювання у сферах енергетики та комунальних послуг.

Голова НКРЕКП Юрій ВЛАСЕНКО

ЗАТВЕРДЖЕНО

Постанова Національної комісії, що здійснює державне регулювання у сферах енергетики та комунальних послуг

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ № \_\_\_\_\_\_\_\_

**ЗМІНИ**

**до Вимог щодо забезпечення доброчесності та прозорості на оптовому енергетичному ринку**

1. Пункт 2.5 глави 2 доповнити новим підпунктом такого змісту:

«21) торгівля повітрям – подання заявок (пропозицій) на продаж або укладання угод з продажу відповідно до оптового енергетичного продукту на відповідний розрахунковий період, обсяг якого не був забезпечений наявними потужностями власного виробництва/видобутку/зберігання, та/або обсягами купівлі електричної енергії/природного газу на оптовому енергетичному ринку, у тому числі імпортованими.».

2. У главі 5:

1) пункт 5.2 викласти в такій редакції:

«5.2. Система спостереження повинна базуватись на затвердженій стратегії спостереження, розробленої ОПООП з урахуванням оцінки ризиків. Така стратегія спостереження має охоплювати, зокрема:

правила розроблення та оновлення сповіщень, а також засоби виявлення підозрілої поведінки;

порогові значення сповіщень, що визначають критерії підозрілої поведінки;

процес ідентифікації різних типів зловживань на оптовому енергетичному ринку;

критерії та порядок, що визначають необхідність закриття або проведення додаткового аналізу отриманих сповіщень;

дії, які зобов’язані вживати ОПООП для подальшої оцінки аномальних подій або потенційної підозрілої поведінки;

процес прийняття рішень ОПООП щодо подання НКРЕКП повідомлення (заяви) про можливе зловживання на оптовому енергетичному ринку.

Оцінка ризиків, зокрема, повинна включати ідентифікацію різних типів зловживань, у тому числі практик маніпулювання ринком, визначених главою 2 цих Вимог, на основі очікуваного ризику виникнення на організованих сегментах ринку, аукціонах, організованих торговельних майданчиках, товарних біржах, електронних торговельних майданчиках, торгових платформах тощо ОПООП, а також критерії щодо періодичності та методології перегляду процедур сповіщення та пов’язаних параметрів.

ОПООП зобов’язана здійснювати регулярний перегляд стратегії спостереження та оцінки ризиків, зокрема у разі виявлення недоліків чинної стратегії, наявності обґрунтованих підстав вважати, що чинна стратегія не забезпечує належного охоплення ризиків або не дозволяє виявити окремі потенційні маніпулювання або спроби маніпулювання, а також у разі суттєвих змін у нормативно-правовій базі функціонування оптового енергетичного ринку або ринкових умов, або поведінки учасників оптового енергетичного ринку.

Система спостереження ОПООП враховує положення пункту 6.1 глави 6 цих Вимог та повинна мати можливість, зокрема:

аналізувати дії учасників оптового енергетичного ринку в розрізі кожної виконаної/невиконаної операції та розміщених, змінених, скасованих або відхилених заявок (пропозицій) на відповідному оптовому енергетичному ринку з метою виявлення підозрілої поведінки в розрізі типів зловживань;

підтримувати механізми побудови історичних ланцюгів подій у розрізі кожного учасника оптового енергетичного ринку та торгової сесії з метою виявлення нетипових торгових стратегій (відхилень від звичайної історичної поведінки) та потенційно підозрілої поведінки;

створювати сповіщення (набір індикаторів), що визначає та повідомляє про підозрілу поведінку учасників оптового енергетичного ринку та вказує на дії, які вимагають подальшого аналізу. Сповіщення (індикатори) мають оновлюватися та коригуватися з урахуванням нових практик маніпулювання та спроб маніпулювання;

передбачати журнал подій для відстеження всіх спрацювань системи сповіщень та результатів обробки кожного такого сповіщення;

забезпечувати графічний аналіз дій учасників оптового енергетичного ринку в розрізі торгової сесії;

підтримувати гнучке налаштування порогових значень і сценаріїв спрацювання сповіщень для різних категорій учасників оптового енергетичного ринку;

формувати дані для розрахунку впливу підозрілої поведінки на оптовий енергетичний ринок або його сегменти шляхом моделювання;

забезпечити доступ НКРЕКП до системи спостереження та можливість експорту даних для подальшої обробки з метою проведення дослідження ринкової поведінки учасників оптового енергетичного ринку.»;

2) пункт 5.4 доповнити трьома новими абзацами такого змісту:

«ОПООП зобов’язані подавати НКРЕКП:

Звіт про результати спостереження згідно з формою, що є додатком 5 до цих Вимог. Такий звіт подається щокварталу до 05 числа місяця, наступного за звітним періодом;

Стратегію спостереження протягом 10 робочих днів з дня її затвердження або внесення змін до неї.»;

3) пункт 5.6 доповнити новим абзацом такого змісту:

«У разі виявлення підозрілої поведінки на оптовому енергетичному ринку з метою об'єктивного аналізу ситуації ОПООП має право звертатись до учасника(ів) оптового енергетичного ринку щодо надання пояснень причин такої поведінки, а також підтвердження ресурсного забезпечення для здійснення операцій з оптовими енергетичними продуктами.»;

4) у пункті 5.7:

абзац другий після слова «учасника» доповнити словами «оптового енергетичного»;

після абзацу другого доповнити новим абзацом третім такого змісту:

«ОПООП не повинна повідомляти учасника оптового енергетичного ринку щодо повідомлення НКРЕКП про підозрілу поведінку на оптовому енергетичному ринку.».

У зв’язку з цим абзаци третій та четвертий вважати відповідно абзацами четвертим та п’ятим.

3. Пункт 6.3 глави 6 доповнити новим підпунктом такого змісту:

«10) подані заявки (пропозиції) на продаж або виконані операції створюють або мають намір створити неправдивий чи оманливий сигнал для пропозиції чи ціни для оптового енергетичного продукту в межах конкретної торгової сесії шляхом введення заявок, які не мають ресурсного забезпечення.».

4. Доповнити новим додатком, що додається.

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Додаток 5

до Вимог щодо забезпечення доброчесності та прозорості   
на оптовому енергетичному ринку

**ЗВІТ   
про результати спостереження**

за \_\_\_\_\_\_квартал\_\_\_\_\_\_\_ року

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

(найменування ОПООП)

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
|  | Показник | Кількість |
| 1 | Загальна кількість спрацьованих сигналів протягом звітного кварталу, |  |
| 1.1 | *з них непідтверджених (хибних) сигналів* |  |
| 2 | Кількість поданих повідомлень про підозрілу поведінку на оптовому енергетичному ринку протягом звітного кварталу, |  |
| 2.1 | *з них щодо спроби маніпулювання* |  |
| 2.2 | *з них щодо маніпулювання, у тому числі:* |  |
| 2.2.1 | *укладання фіктивних угод (wash trades)* |  |
| 2.2.2 | *узгоджена торгівля (pre-arranged trading)* |  |
| 2.2.3 | *лейринг (layering)* |  |
| 2.2.4 | *спуфінг (spoofing)* |  |
| 2.2.5 | *помилкові заявки (erroneous orders)* |  |
| 2.2.6 | *розміщення заявок без наміру їх виконання (placing orders with no intention of executing them)* |  |
| 2.2.7 | *накопичення пропускної спроможності/розподілу потужності (transmission capacity hoarding)* |  |
| 2.2.8 | *утримання потужності (capacity withholding)* |  |
| 2.2.9 | *торгівля повітрям* |  |
| 2.2.10 | *інші практики* |  |
| 2.3 | *з них порушення встановлених заборон щодо використання інсайдерської інформації* |  |
| 3 | Середня тривалість аналізу сповіщень від моменту спрацювання до подання повідомлення про підозрілу поведінку на оптовому енергетичному ринку (днів) |  |
| 4 | Кількість сигналів, які перебувають на розгляді на кінець звітного періоду |  |

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_