

Postup pre nahlasovanie transakcií podľa REMIT cez RRM OKTE

Martin Sliva

Jesenná konferencia SPX 2015
Podbanské, 10.-11. december 2015

Obsah



- ❑ **Druhá fáza reportingu podľa REMIT**
- ❑ **Reportovanie kontraktov v rámci druhej fázy**
- ❑ **Služba sprostredkovania RRM OKTE**
- ❑ **Podmienky reportingu prostredníctvom OKTE**

Druhá fáza reportingu podľa REMIT

Čoho sa týka druhá fáza reportingu? Čím sa líši od prvej fázy?



Účastníci trhu majú povinnosť poskytovať agentúre ACER **záznamy o transakciách** na veľkoobchodných trhoch s energiou

1. Fáza - reportovanie od 7. 10. 2015

- Reportujú sa výhradne transakcie uskutočnené **cez organizované obchodné miesta**
 - Štandardné kontrakty vrátane pokynov na obchodovanie
- Transakcie musia byť reportované ACER nasledujúci pracovný deň (*business day*) po zadaní pokynu na obchodovanie alebo uzatvorenie transakcie
- Na Slovensku platforma ISOT prevádzkovaná OKTE, a.s. a obchodná platforma SPX

2. Fáza - reportovanie od 7. 4. 2016

- Transakcie uskutočnené **mimo organizované obchodné miesta** (bilaterálne kontrakty („OTC“) medzi účastníkmi veľkoobchodného trhu)
- Základné údaje o prevádzke sústav

Koho sa týka druhá fáza reportingu?



- **Povinne: Účastníci veľkoobchodného trhu s energiou**
 - Obchodníci s elektrinou a zemným plynom obchodujúci v EÚ
 - Výrobcovia elektriny > 10 MW a plynu > 20 MW výkonu (aj sumárne)
 - Systémoví operátori: SEPS, eustream, Nafta a Pozagas
 - Veľkí odberatelia s technickou schopnosťou spotreby > 600 GWh / rok
- **Na vyžiadanie ACER / národného regulátora:**

Sú účastníci povinní interne evidovať

 - Vnútroskupinové zmluvy
 - Transakcie výrobcov < 10 MWe, resp. 20 MW
 - Zmluvy na vyvažovacie služby pre elektrinu a zemný plyn

Čo sa reportuje?



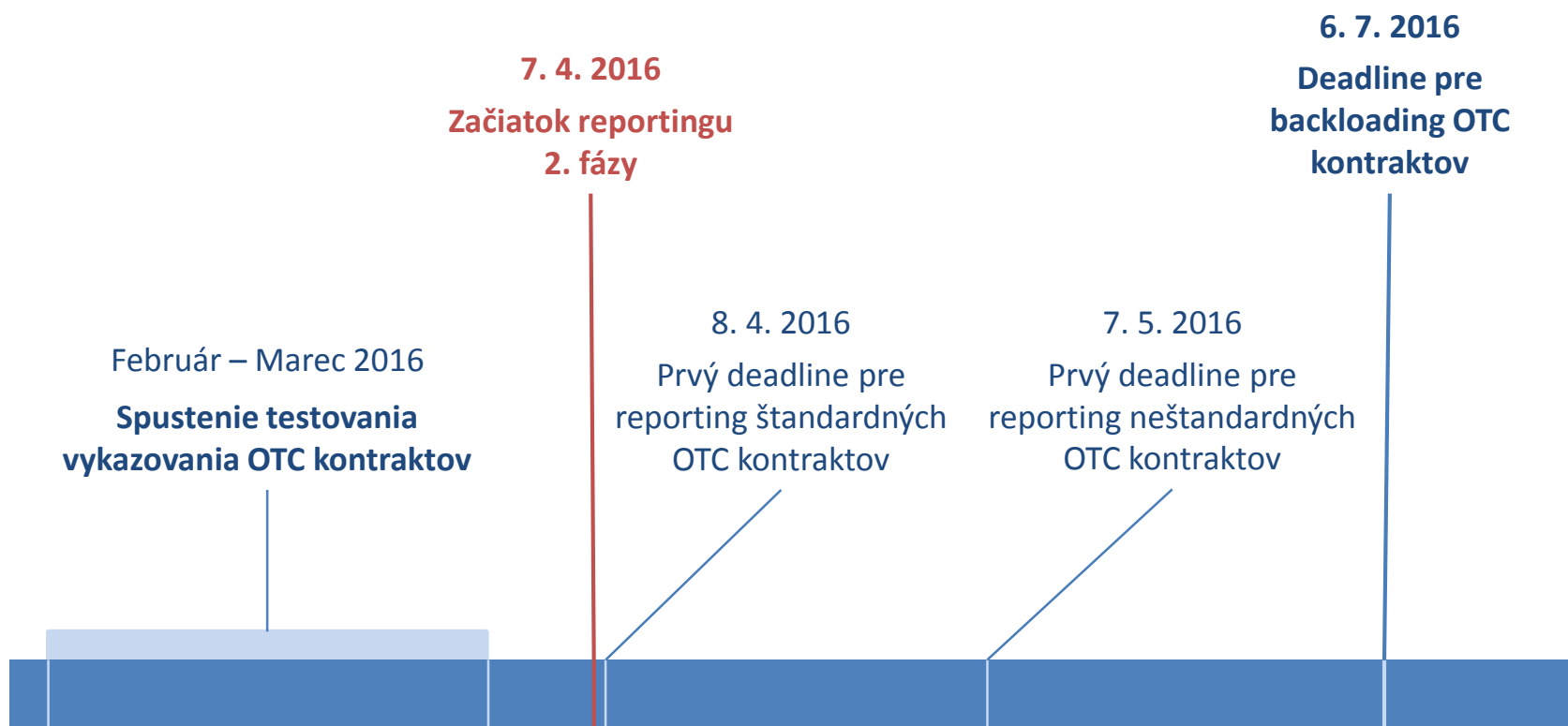
- Štandardné kontrakty uzavreté bilaterálne (OTC)
 - Kontrakty na dodávku elektriny alebo zemného plynu typovo založené na štandardných burzových produktoch
 - Reportovanie nasledujúci pracovný deň
- Neštandardné kontrakty uzavreté bilaterálne (OTC)
 - Najmä rámcové kontrakty, vrátane následných konkrétnych plnení z tejto zmluvy (tzv. exekúcií)
 - Reportovanie do 1 mesiaca po uzatvorení, zmene alebo zrušení transakcie
- Kontrakty na prenos elektriny alebo prepravu zemného plynu
- Opcie, futures, swapy a iné derivátové kontrakty týkajúce sa vyššie uvedených kontraktov

Čo sa reportuje? (2)



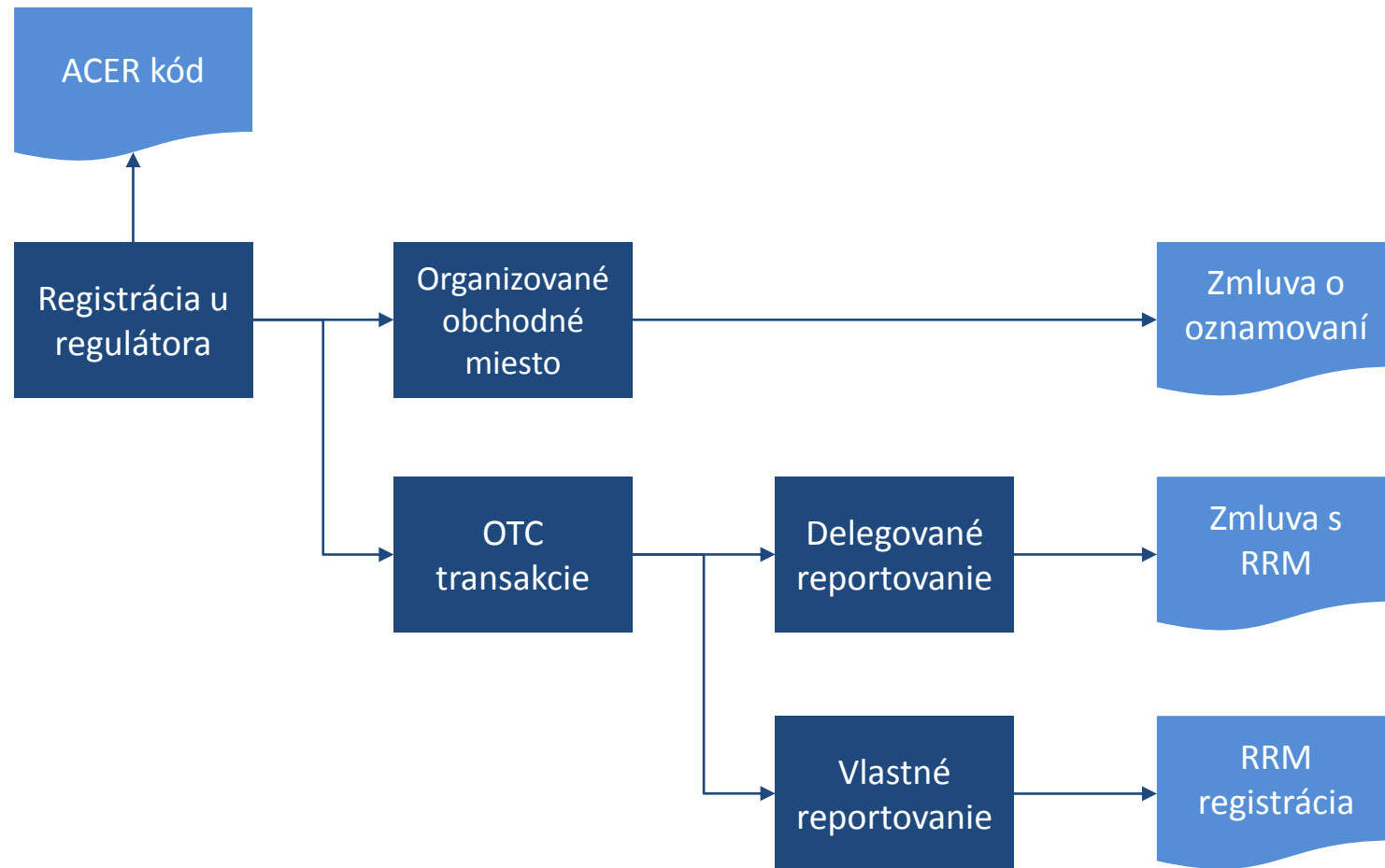
- Základná dáta
 - TSO (elektrina) - záverečné cezhraničné nominácie
 - TSO (plyn) - nominácie deň vopred, záverečné renominácie a pridelené množstvá
 - SSO (plyn) – prevádzkové a obchodné dáta
 - ÚT - objem plynu, ktorý má ÚT na konci plynárenského dňa uskladnený v zásobníku (môže reportovať SSO)

Harmonogram druhej fázy



Reportovanie kontraktov v rámci druhej fázy

Postup pre splnenie povinnosti transakčného reportingu



Špecifiká reportovania bilaterálnych kontraktov



Pokiaľ strany uzavrujú OTC kontrakt, pri jeho uzatváraní je potrebné odsúhlasiť si hodnoty parametrov, ktoré budú strany reportovať agentúre ACER. Ide predovšetkým o:

- Detaily kontraktu
 - UTI (Unique Transaction Identifier)
 - Strana zodpovedná za generovanie UTI alebo použitie všeobecnej univerzálnej definovanej metodológie (od ACER)
- Detaily prípadného cenového indexu alebo vzorca
- Detaily prípadnej opcie a jej možností
- Diagram dodávky

Life cycle events:

Informácie o životnom cykle kontraktu



Informácia o životnom cykle rozlišujú **stav reportovanej transakcie** (novo reportovaná, zmena už odreportovanej, reportovanie zrušenia kontraktu)

- kontrakt alebo pokyn na obchodovanie, ktoré sa oznamujú prvýkrát, vyznačí sa transakcia v poli životného cyklu ako „nová“,
- zmenu údajov predtým oznámeného kontraktu sa označí ako „zmena“,
- zrušenie nesprávne predloženého reportu sa označí ako „chyba“,
- ukončenie existujúcej zmluvy sa označí ako „zrušenie“.

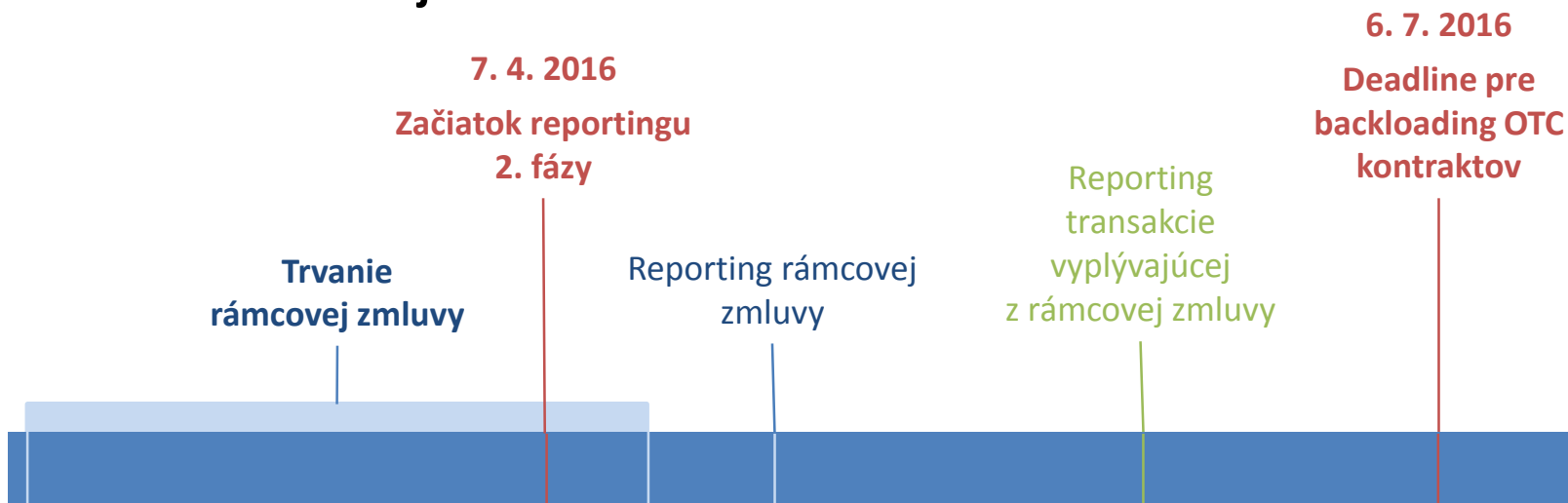
Backloading aktívnych kontraktov



Technické riešenie:

- Účastník trhu pripraví dáta v schéme definovanej ACER
- Súčinnosť OKTE pri príprave dát
- Jednorazové zaslanie cez RRM OKTE do systému ACER
- Najprv vykázanie rámcovej zmluvy, následne vykázanie jej exekúcií

Vizualizácia časovej súslednosti:



Služba sprostredkovania RRM OKTE

Plánovane spôsoby reportingu

- **Manuálne zadanie údajov prostredníctvom on-line formulára**
 - Nízke počiatkové náklady
 - Ideálne pre malý počet reportovaných transakcií
- **Manuálne nahratie XML súboru vo formáte definovanom ACER**
 - Efektívne riešenie pre klientov schopných poskytnúť dáta vo formáte špecifikovanom ACER
- **Automatický prenos XML súborov vo formáte definovanom ACER prostredníctvom webových služieb**
 - Automatizované riešenie pre klientov s veľkým množstvom reportovaných transakcií schopných poskytnúť dáta vo formáte špecifikovanom ACER

Podmienky reportingu prostredníctvom OKTE

Cenová ponuka reportingu



- Reporting má charakter trhovej, neregulovanej služby
- **Do 30 reportovaných transakcií/mesiac**
 - Fixný mesačný poplatok 30 EUR/mesiac plus 2,90 EUR/transakcia
- **31-500 reportovaných transakcií/mesiac**
 - Fixný mesačný poplatok 80 EUR/mesiac plus 0,50 EUR/transakcia
- **Viac ako 500 reportovaných transakcií/mesiac**
 - Pre subjekty reportujúce mesačne viac ako 500 transakcií je možná dohoda na individuálnej sadzbe

Pre účely fakturácie sa považuje za transakciu každá reportovaná zmena životného cyklu kontraktu (nový kontrakt, chyba v kontrakte, zmena kontraktu, zrušenie kontraktu)

Zmluva o poskytovaní údajov pre výkon oznamovania údajov podľa REMIT



- Zmluva pre účastníkov mimo organizovaný krátkodobý trh
- Predmet:
 - Služba sprostredkovania vykazovania transakcií
 - Pre plnenie si povinnosti voči ACER v zmysle REMIT
 - RRM OKTE ako tretia strana mimo kontraktu
- Zmluva a cenník sú zverejnené na webovej stránke OKTE
 - Platnosť dátumom podpisu, účinnosť 7. apríla 2016
 - Potrebné podpísať najneskôr 29. februára 2016

Čo môže účastník trhu s elektrinou a plynom urobiť ďalej



- Audit reportovateľných kontraktov
 - v obchodnom systéme podľa ACER manuálu – TRUM verzia 2
- Podpísať s OKTE Zmluvu REMIT
 - možné podpísať k 30.1.2016 pre prístup do testovacieho rozhrania
 - označiť OKTE ako svoje RRM v CEREMP ÚRSO
- Analýza schém ACER
 - vo vlastnom IT, resp. do formulára OKTE

Pre kontrakty mimo ISOT (najmä bilaterálne - OTC transakcie) bude pripravená testovacia fáza vo februári a marci 2016

Ďakujem za pozornosť

<https://www.okte.sk/sk/remit/faq>

Mgr. Martin Sliva, PMP
Projektový koordinátor

e-mail:
[**remit@okte.sk**](mailto:remit@okte.sk)