

Skúsenosti s reportovaním 1. a 2. etapy REMIT

Ján Kaiser
Operátor trhu

Obsah



- ❑ **REMIT v OKTE**
- ❑ **REMIT a regulácia – aktuality**
- ❑ **Backloading transakcií**

Nariadenie REMIT



- REMIT (Regulation on Wholesale Energy Market Integrity and Transparency) je Nariadenie Európskeho Parlamentu a Rady (EÚ) č. 1227/2011 o **integrite a transparentnosti veľkoobchodného trhu s energiou** a vykonávací predpis Európskej komisie č. 1348/2014, ktoré ukladajú účastníkom veľkoobchodného trhu povinnosť **poskytovať** Agentúre pre spoluprácu energetických regulátorov (ACER) **informácie** o kontraktoch na veľkoobchodných trhoch s energiou vrátane pokynov na obchodovanie.

REMIT v OKTE

2. Etapa reportovania



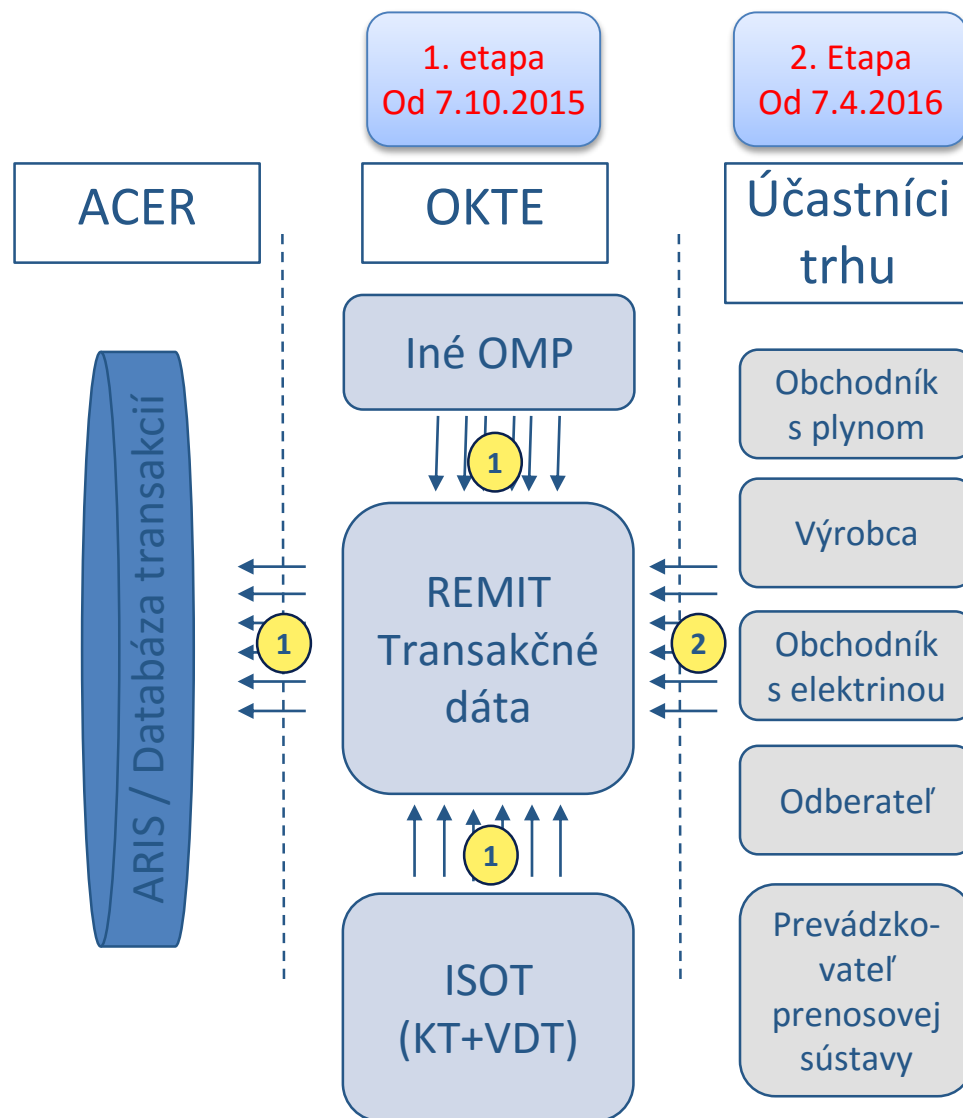
- Povinnosť reportovania transakcií uskutočnených mimo organizované obchodné miesta (bilaterálne „OTC“ kontrakty medzi účastníkmi veľkoobchodného trhu) a základných údajov o prevádzke sústav.
- Štandardné kontrakty na dodávku elektriny alebo zemného plynu typovo založené na štandardných burzových produktoch je povinné reportovať najneskôr **nasledujúci pracovný deň** po uzatvorení kontraktu.
- Neštandardné kontrakty – rámcové kontrakty, vrátane následných konkrétnych plnení (exekúcií) je povinné reportovať **do 1 mesiaca po uzatvorení, zmene alebo zrušení transakcie.**

→ Povinnosť reportovania od 7. 4. 2016

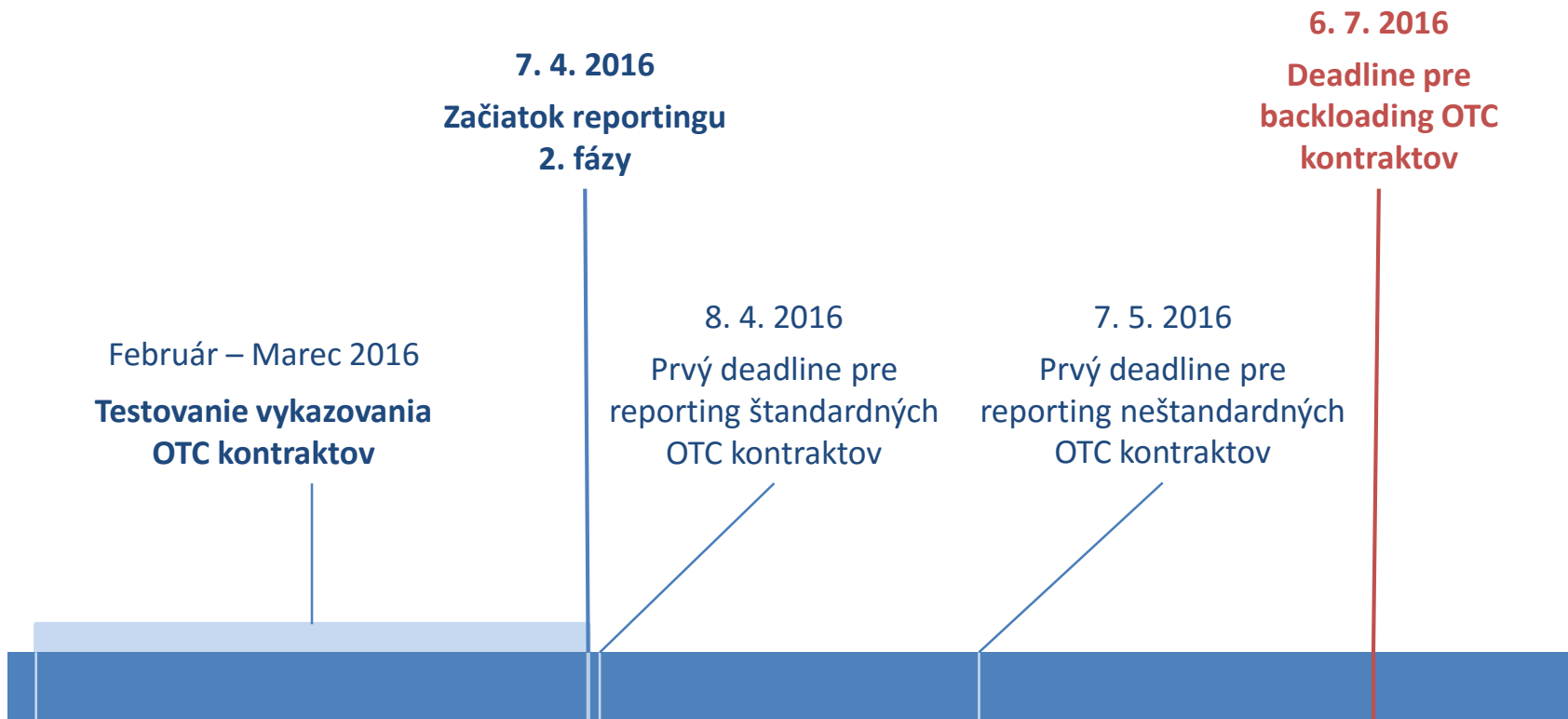
Technické riešenie



- 1 Automatizované reportovanie transakcií realizovaných prostredníctvom ISOT a iných OMP
- 2 Príjem reportov (najmä bilaterálnych OTC kontraktov) od účastníkov trhu a zasielanie na ACER.



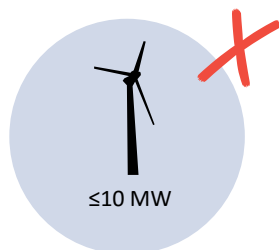
Časový harmonogram 2. etapy (2016)



Oznamovanie transakcií výrobcov elektriny

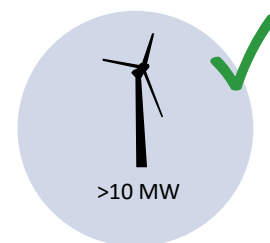


Bez registrácie
Bez priebežného oznamovania transakcií

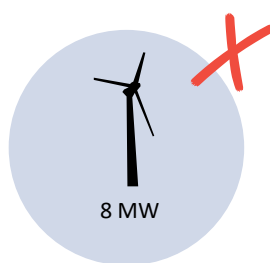
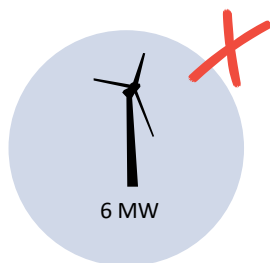


Výrobca 1

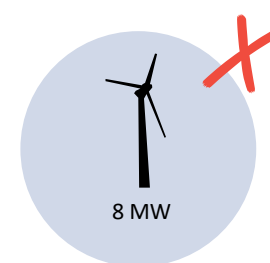
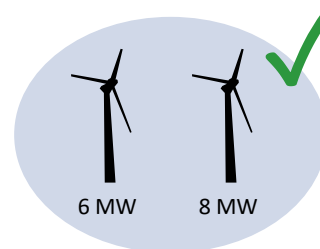
Povinnosť registrácie a
priebežného oznamovania transakcií



Výrobca 2



Výrobca 3



Výrobca 4



Jedna výrobná jednotka



Kontrakt na fyzickú dodávku elektriny

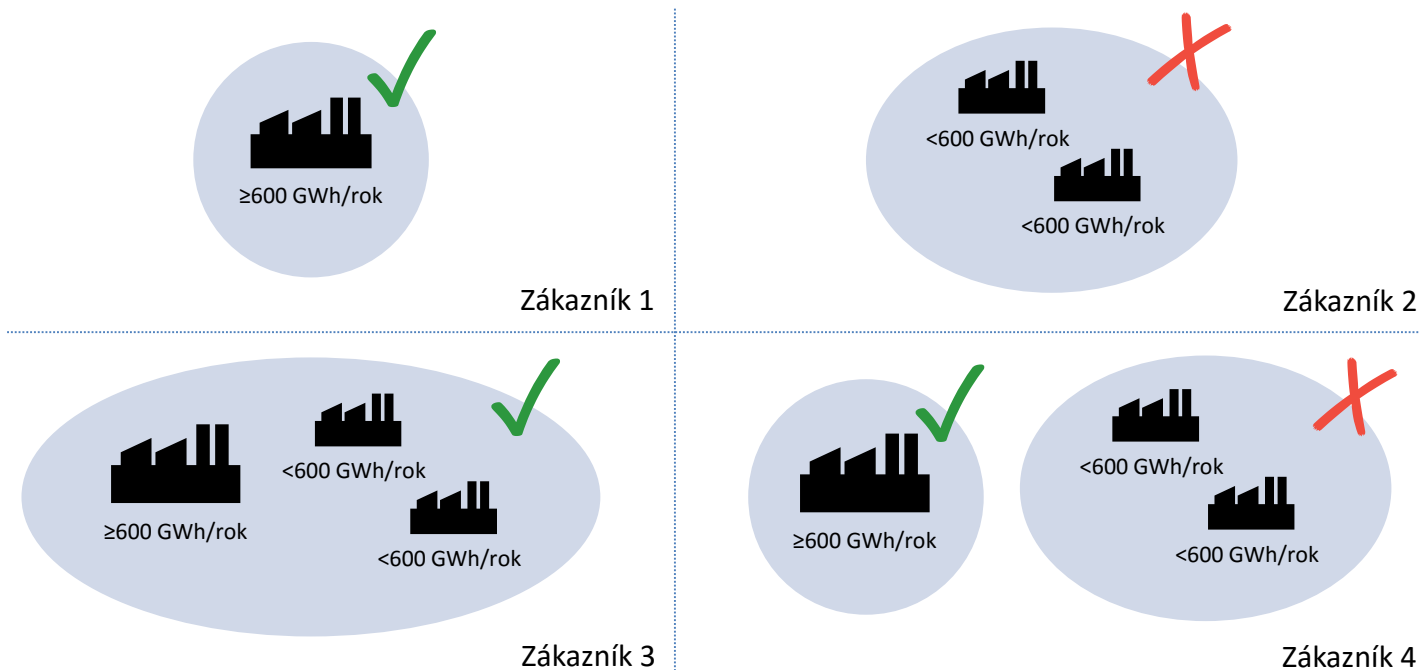


Transakcia musí byť oznámená



Transakcia nemá byť priebežne oznamovaná
Kontrakty uzatvorené na organizovaných obchodných miestach podliehajú povinnosti oznamovania

Oznamovanie transakcií konečných zákazníkov



Jedna spotrebná jednotka



Kontrakt na fyzickú dodávku elektriny



Transakcia musí byť oznámená



Transakcia nemá byť priebežne oznamovaná
Kontrakty uzatvorené na organizovaných obchodných
miestach podliehajú povinnosti oznamovania

Štatistika reportovania - OKTE



- Počet validovaných reportov od začiatku povinnosti reportovania (7.10.2015 – 20.6.2016): **16872**
- Počet validovaných *testovacích* reportov (7.10.2015 – 20.6.2016): **8562**
- Počet klientov RRM OKTE k 20.6.2016: **73**

Proces reportovania v systéme RRM OKTE



Brožúra pre reportovanie OTC transakcií



- Praktická brožúra pre reportovanie OTC transakcií je dostupná po prihlásení v testovacom aj prevádzkovom prostredí systému RRM OKTE.
- Brožúra obsahuje informácie o:
 1. Princípoch reportovania bilaterálnych transakcií (aké transakcie a kedy musia účastníci trhu reportovať)
 2. Postupe pri reportovaní bilaterálnych transakcií prostredníctvom XMtrade[®]/RRM (štandardné aj neštandardné kontrakty, rámcové kontrakty a ich plnenia, úpravy kontraktov, backloading)
 3. Príkladoch reportovania konkrétnych bilaterálnych transakcií

Dostupnosť brožúry v systéme RRM OKTE



Praktická brožúra pre reportovanie bilaterálnych transakcií a obchodov prostredníctvom RRM OKTE, a.s. je dostupná po kliknutí na vytvorenie konkrétneho typu kontraktu. ✕

XMtrade® / RRM Testovacie prostredie Kaiser Ján
Odhlásiť sa SK
EN

Navigácia ?

- Notifikácie
- Reporty
- Účastníci trhu
- Reklamácie
- Fakturačné podklady
- Faktúry
- ▼ Správa systému
 - Konfigurácia
 - Procesy
 - Používatelia
 - Externé rozhrania
 - Číselníky
 - Notifikácie
 - Šablóny notifikácií

RRM > Reporty

Operácie 25.6.2016 25.6.2016 Odosielateľ / účastník trhu Všetky typy Všetky stavy Zobraziť

- + Vytvoriť štandardný kontrakt
- + Vytvoriť štandardný kontrakt – pevná cena a množstvo
- + Vytvoriť štandardný kontrakt - diagram
- + Vytvoriť neštandardný kontrakt

Odosielateľ	Odosielateľ (ID)	Odosielateľ (Typ ID)	Účastník trhu
Neboli nájdené žiadne záznamy			

Zobrazíť

Strana 0 z 0 Auto Označené: 0 Uložiť nastavenia tabuľky Žiadne dáta

Dostupnosť brožúry v systéme RRM OKTE



Praktická brožúra pre reportovanie bilaterálnych transakcií a obchodov prostredníctvom RRM OKTE, a.s. je dostupná po kliknutí na vytvorenie konkrétneho typu kontraktu. ✕

Mtrade® / RRMKaiser Ján
Odhlásiť sa SK
EN

Testovacie prostredie

Navigácia ?

RRM > Reporty

← + Vytvoriť kontrakt + Vytvoriť objednávku + Vytvoriť obchod Uložiť ? Brožúra pre OTC transakcie

Standardný kontrakt - Všeobecný

Účastník trhu je povinný vyplniť okrem povinných údajov aj tie, ktoré má k dispozícii na základe uzatvoreného kontraktu.

Kontrakty

	Operácie	ID kontraktu ↑	Názov kontraktu	Typ kontraktu	Komodita
--	----------	----------------	-----------------	---------------	----------

Objednávky

	Operácie	Poradové číslo	Účastník trhu (ID)	Nákup / Predaj	Typ objednávky	Podmienka zobchodovania	Stav objednávky
--	----------	----------------	--------------------	----------------	----------------	-------------------------	-----------------

Obchody

	Operácie	Poradové číslo	Účastník trhu (ID)	Nákup / Predaj	Čas transakcie
--	----------	----------------	--------------------	----------------	----------------

Uložiť Zrušiť

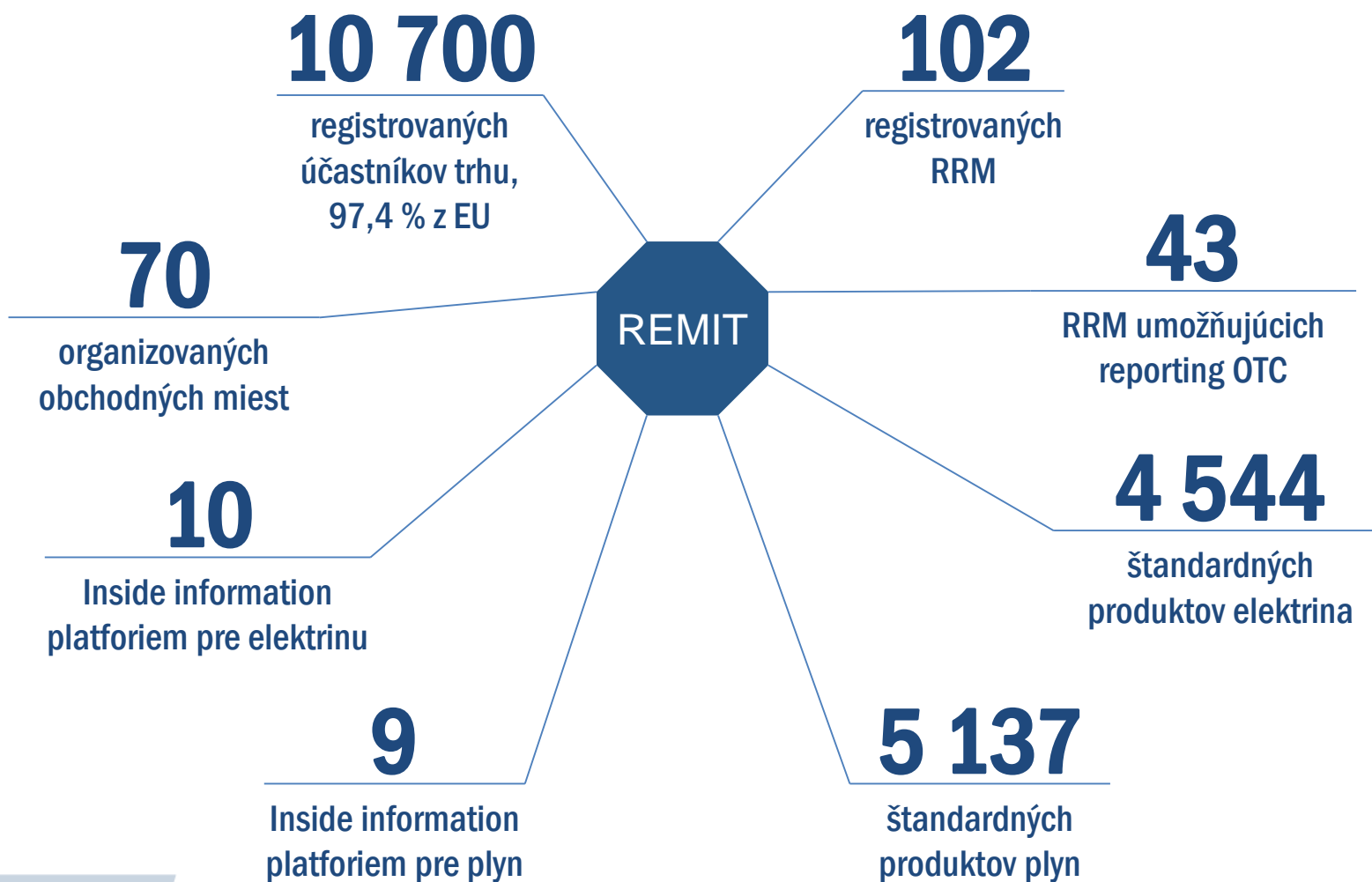
REMIT a regulácia – aktuálny

Novinky z ACER

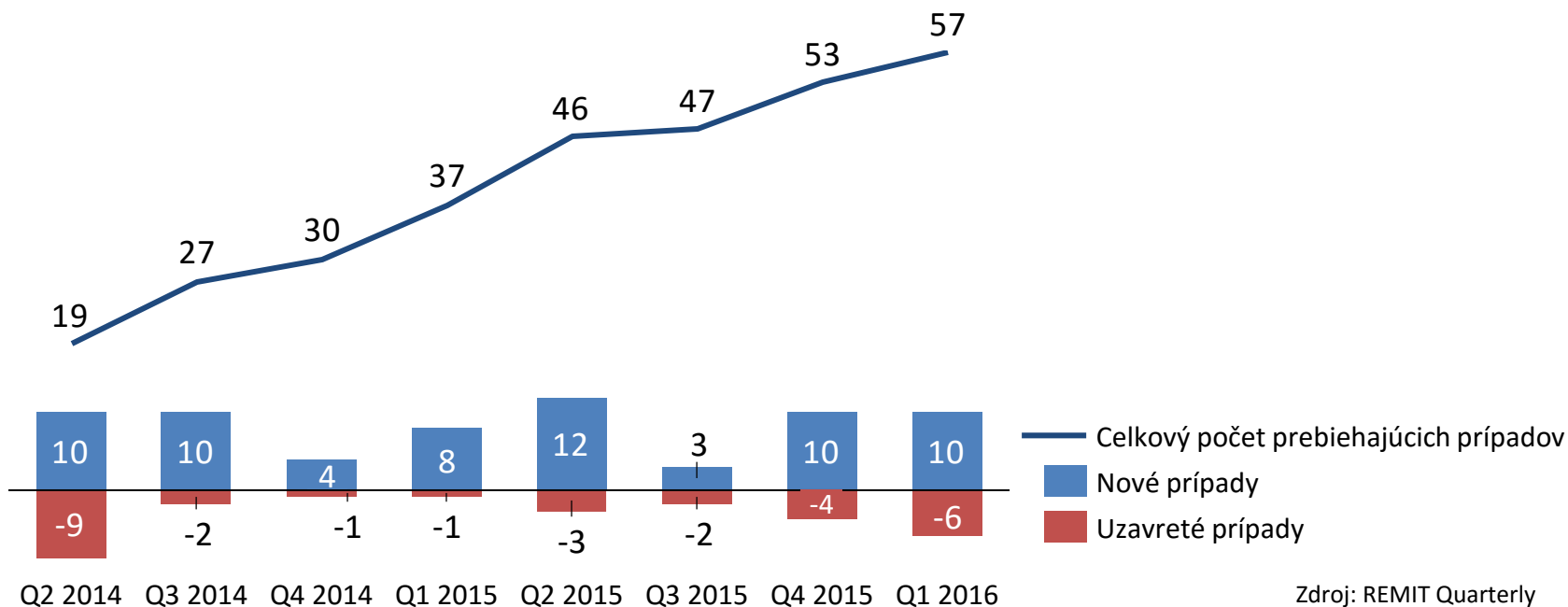


- Neaktívne prihlášky RRM (> 3 mesiace) budú zrušené, **odporúča sa využiť služby existujúcich RRM.**
- ACER sa teraz koncentruje na kontrolu kvality reportovaných dát. Po stabilizácii reportingu bude spolu s regulátormi analyzovať zneužívanie trhu.
- Dotazy k reportovaniu bude ACER zodpovedať iba v prípade, ak sa k podobným témam doteraz verejne nevyjadril. V polovici marca ACER evidoval cez 500 nevyriešených dotazov.
- Problémy s reportovaním sa ACER snaží riešiť priamo, pokiaľ nie je nutný zásah národných regulátorov.
- V roku 2017 sa predpokladá **preskúmanie** oznamovacieho balíčku REMIT.

Štatistika REMIT - ACER



Prípady porušenia nariadenia REMIT



Zdroj: REMIT Quarterly

- Španielsko: pokuta 25 mil. EUR za manipuláciu s trhom
- Estónsko: pokuta 10 tis. EUR za porušenie povinnosti transparentnosti
- V prípade dopadu zakázaného jednanja na trh v inej krajine môže byť páchatel' postihovaný podľa práva platného v postihnutej krajine.

Skúsenosti s reportovaním v 2. etape



Pri ukladaní reportov prostredníctvom manuálneho zadávania sa môžu vyskytnúť chyby po obsahovej stránke. Tieto reporty sú po validácii na strane ACER zamietnuté.

Najčastejšie dôvody zamietnutia pri reportovaní OTC kontraktov:

- Nedefinované množstvo a/alebo cena vo formulári (štandardný kontrakt)
- Nesprávne prepojenie obchodu na kontrakt (ID kontraktu)
- Nesprávne uvedený „Názov kontraktu“ (BILCONTRACT/BACKLOADING)
- Chyba z dôvodu duplicity kontraktov zaslaných s rovnakým ID kontraktov

Príklad zamietnutia reportu z dôvodu duplicity



Praktická brožúra pre reportovanie bilaterálnych transakcií a obchodov prostredníctvom RRM OKTE, a.s. je dostupná po kliknutí na vytvorenie konkrétneho typu kontraktu. ✕

Mtrade / RRM Testovacie prostredie Kaiser Ján
Odhlásiť sa SK
EN OKTE

RRM > Reporty

Operácie 7.6.2016 20.6.2016 Odosielať / účastník trhu Všetky typy Všetky stavy Zobraziť

Operácie	Číslo	Stav spracovania	Odosielať	Odosielať (ID)	Odosielať (Typ ID)	Účastník trhu
1	460414951	Zamietnutý	OKTE, a.s.	B0000138K.SK	ACE	

Potvrdenie

	Identifikátor	Typ	Stav	Opis chyby	Detail chyby	Číslo chyby
1	200215677	CONTRACT	Akceptované			
2	1	TRADE	Zamietnuté - obsah	Received a duplicate Trade Report in Submission	Trade: uGkfm18P2gcOGPznoZ...	R1LIATTRNEW

Stiahnuť vo formáte XML Zrušiť

Strana 1 z 1 Označené: 0 Uložiť nastavenia tabuľky Zobrazujem 1 - 1 z 1

Súvisiaca európska legislatíva: Market Abuse Regulation



- Platnosť od 3. 7. 2016
- Deriváty, emisné povolenky, inštrumenty s vplyvom na cenu derivátov vrátane spotových komoditných obchodov obchodovaných na OMP, MTF, OTF (OTF až po implementácii MiFID II 3. 1. 2018)
- Rozsah povinného zverejňovania a monitorovania presahuje rámec REMIT
- Vzťahuje sa nielen na veľkoobchodné energetické produkty
- MAR je nadradené nariadeniu REMIT vo vzťahu k insider dealing a k manipulácii s trhom

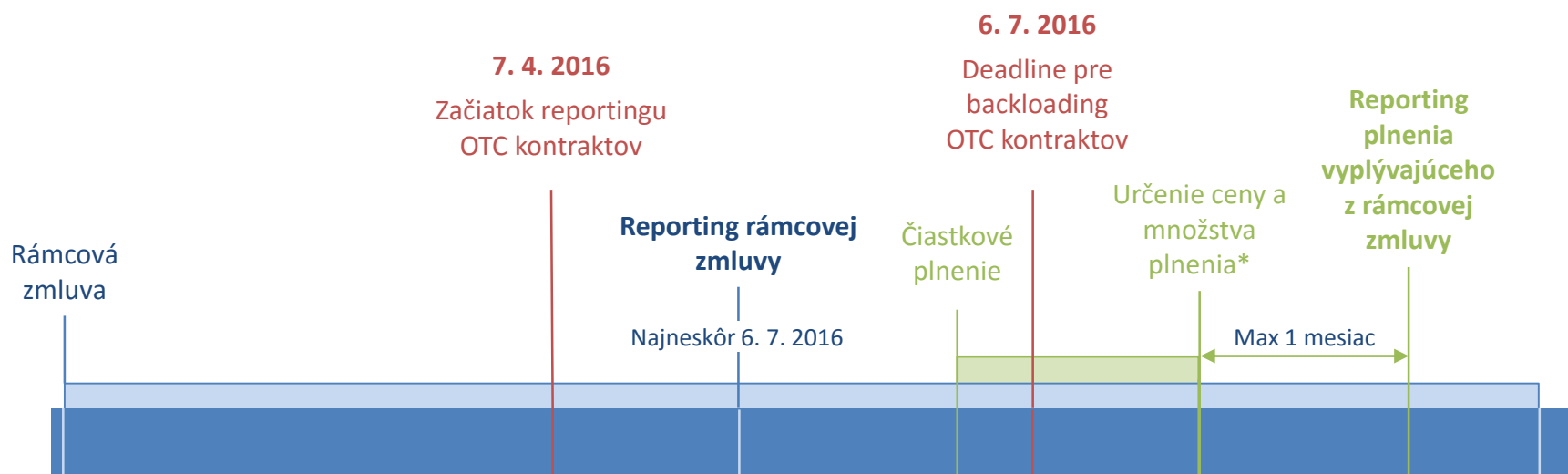
Backloading transakcií

Povinnosť backloadingu



- Bilaterálne kontrakty, resp. kontrakty uzatvorené mimo organizované trhy, ktoré boli uzatvorené pred začiatkom povinnosti oznamovania (7. 4. 2016) a ktorých **obdobie dodania** (fyzické alebo finančné) **je 7. 4. 2016** alebo neskôr.
- Rámcové zmluvy uzatvorené pred začiatkom povinnosti oznamovania, ktoré sú **v platnosti k 7. 4. 2016**.
- **Plnenia vychádzajúce z backloadovanej rámcovej zmluvy**, ktoré sú vykonávané po nahlásení backloadovanej rámcovej zmluvy.
- Vždy musí byť najskôr reportovaná rámcová zmluva a až potom plnenie vyplývajúce z rámcovej zmluvy.

Backloading: reporting plnení



* Jednoznačné určenie ceny a množstva v prípade plnení rámcovej zmluvy môže nastať najneskôr v čase fakturácie. Lehota jedného mesiaca pre nahlásenie plnenia začína plynúť práve od času jednoznačného určenia ceny a množstva.

Do kedy je možno realizovať backloading u OKTE?



- Deadline pre backloading je **6. 7. 2016**
- Najneskôr 5. 7. 2016 musí byť odoslaný backloadovaný report prostredníctvom RRM OKTE
- Za predpokladu už realizovanej registrácie u regulátora je teda nutné registrovať sa u RRM OKTE najneskôr **1. 7. 2016**

→ Registrácia u OKTE do 1. 7. 2016

Kontakty



- Prípadné otázky prosím zasielajte na adresu remit@okte.sk
- Link na portál: <https://rrm.okte.sk/portal/>
- Link na testovací portál: <https://test-rrm.okte.sk>
- FAQ: <https://www.okte.sk/sk/remit/faq>

Ďakujem za pozornosť

Ján Kaiser
Operátor trhu
e-mail: jan.kaiser@okte.sk