

Novinky v transakčnom reportingu REMIT

Jesenná konferencia SPX
Podbanské

Obsah

- ❑ **Legislatíva REMIT**
- ❑ **Proces registrovania ÚT a nahlasovania údajov**
- ❑ **Sekundárne trhy**
- ❑ **Štatistiky**
- ❑ **REMIT a kontrola – aktuality**

Prečo REMIT a OKTE

Prečo REMIT a OKTE



- REMIT ukladá účastníkom veľkoobchodného trhu povinnosť **poskytovať** Agentúre pre spoluprácu energetických regulátorov (ACER) **informácie o kontraktoch na veľkoobchodných trhoch** s energiou vrátane pokynov na obchodovanie.
- **Povinnosť nahlasovania sa týka všetkých subjektov obchodujúcich na ISOT-e (Denný a Vnútrodenný trh)**
 - Po vybudovaní RRM schopnosť poskytovať aj službu sprostredkovania reportingu OTC
 - Akceptácia návrhu implementácie zo strany ÚRSO 12.2.2015

Legislatíva REMIT



sa vzťahuje na **obchodovanie s veľkoobchodnými energetickými produktmi a ich reportovanie s cieľom „odhaliť a odradiť manipuláciu trhu“**.

Obsahuje:

1. Nariadenie EÚ č. 1227/2011 o integrite a transparentnosti veľkoobchodného trhu s energiou
2. Vykonávacie nariadenie Európskej komisie č. 1348/2014
3. Požiadavky a manuály Agentúry pre spoluprácu energetických regulátorov (ACER)

Rieši:

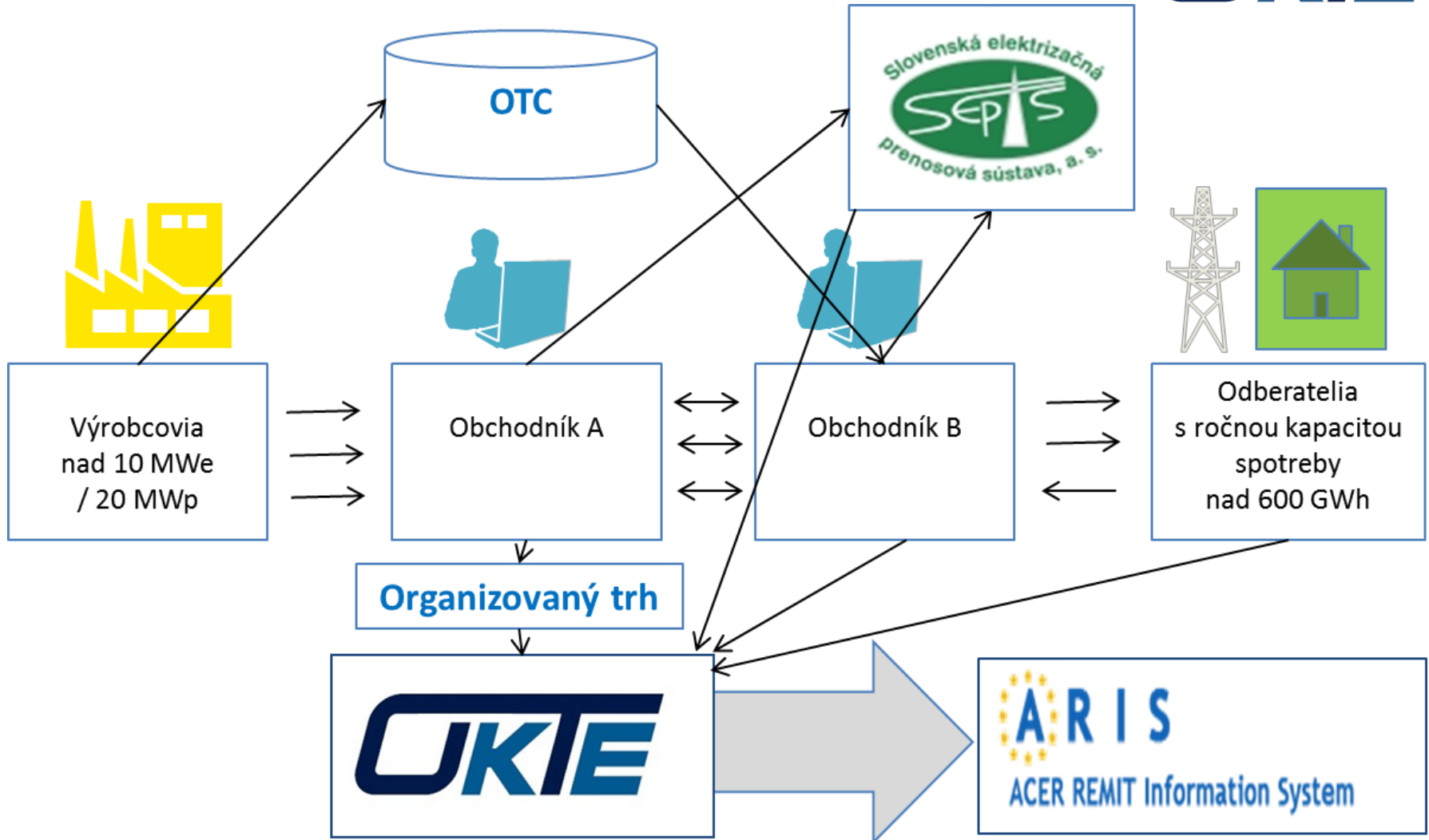
1. Zákaz zneužívania a manipulácie veľkoobchodného trhu	2. Zverejňovanie fundamentálnych veľkoobchodných informácií	3. Nový rámec reportingu transakčných dát veľkoobchodného trhu
<ul style="list-style-type: none">▶ Zákaz 'insider tradingu'▶ Zákaz manipulácie s trhom (transakcie udávajúce nesprávne alebo zavádzajúce signály)▶ Povinnosť oznámiť podozrenie na porušenie nariadenia	<ul style="list-style-type: none">▶ Zverejňovanie neverejných materiálnych informácií▶ Zákaz používania neverejných materiálnych informácií (inside information)	<ul style="list-style-type: none">▶ Registrácia účastníkov trhu u národných regulátorov - spustené od 17. marca 2015▶ Reportovanie transakcií do centrálnej databázy ACERu - od 7. októbra 2015 (OKTE a SPX)

Rola RRM OKTE



- ACER žiada, aby sa všetky transakcie reportovali cez Registrované reportovacie mechanizmy (RRM)
 - OKTE ako organizátor krátkodobého cezhraničného trhu s elektrinou bolo povinné vytvoriť a prevádzkovať reportingový systém RRM
 - OKTE **pokrýva aj reporting v oblasti plynárenstva**
 - Na Slovensku nie je organizovaný trh s plynom
- OKTE poskytuje služby RRM aj ostatným účastníkom trhu s elektrinou
 - **Organizované miesta obchodovania**
 - **Prevádzkovateľ prenosovej sústavy**
 - **Obchodníci s elektrinou a zemným plynom** obchodujúci v EÚ
 - **Výrobcovia elektriny > 10 MW a plynu > 20 MW výkonu** - aj sumárne
 - Vnútrokupinové zmluvy a **podporné služby na požiadanie ACER** / národného regulátora
 - **Veľkí odberatelia** s technickou schopnosťou spotreby > 600 GWh/rok

Schéma RRM OKTE v rámci REMIT



Proces registrovania ÚT a nahlasovania údajov

Proces registrovania ÚT



Podmienkou registrovania účastníka trhu v RRM OKTE je zaslanie:

- vyplnenej *Zmluvy o vykazovaní transakcií uskutočnených na organizovanom cezhraničnom trhu s elektrinou* (transakcie ISOT) a/alebo *Zmluvy o poskytovaní údajov pre výkon oznamovania údajov podľa nariadenia Európskeho parlamentu a Rady (EÚ) č. 1227/2011* (OTC-Over The Counter transakcie),
- vyplnenej *Žiadosti o založenie/zmenu užívateľského účtu do systému RRM* spolu s platným certifikátom používateľa.

Nahlasovanie údajov do ACER



- Nahlasovanie transakcií na ACER uskutočnených iba na ISOT-e (Day-Ahead) prebieha automaticky každý deň o 14:30 hod.
- Pre nahlásenie OTC transakcií je potrebný vstup od používateľa (ÚT) manuálnym zadaním, importom .xml súboru alebo cez automatizované rozhranie.
- Nahlasované reporty a potvrdenia týchto reportov zo strany ACER-u sú archivované po dobu 5 rokov.

Zodpovednosti OKTE a ÚT



- OKTE, a.s. je zodpovedné za:
 - sprostredkovanie nahlasovania dát na ACER (ARIS),
 - formálnu kontrolu reportovaných dát na základe formátových požiadaviek ACER,
 - sprístupnenie potvrdení zo strany ACER.

- Účastník trhu je zodpovedný za:
 - správny formát nahlasovaných alebo prenášaných údajov,
 - úplnosť,
 - presnosť,
 - včasné predloženie.

Sekundárne trhy

Povinnosť reportovania



- Subjekty obchodujúce na sekundárnom trhu s kapacitou majú povinnosť reportovať uskutočnené obchody
- Nakoľko sa z pohľadu ACER-u jedná o neštandardný kontrakt (schému), časový rámec je **T+1** mesiac
- Jedným z dôvodov tejto povinnosti je aj informácia o cene, ktorú majú iba účastníci
- RRM majú povinnosť požiadať ACER o možnosť reportovania tejto schémy a splniť testovacie kritéria, tak ako je to aj pri ostatných schémach

Question 4.2.5

Price in the secondary Market:

Regarding TRUM v. 2.0 field 35 - Data Field - Price, it is foreseen to include the price concluded in transactions on the secondary market.

TSOs do not have this kind of information as the price is determined in agreements that take place strictly between shippers.

It is important for the TSOs to inform ACER also about these kind of transactions directly to ARIS and not only via booking platforms because these kind of transactions entail changes in contracts which need to be updated?

Answer

The field 35 is mandatory for secondary market allocations. The reporting obligation for secondary market lies with the market participants. Therefore there should be no problem for the TSOs in case they lack the specific information on the price. In case the TSO acts as the third-party RRM it is the responsibility of the market participant(s) to provide the necessary information to the TSO as the RRM for complete and successful data reporting.

Zdroj: ACER FAQs on REMIT transaction reporting

Question 3.5.2

What does the status "Cancel" (Lifecycle information) mean exactly for a contract? The contract has been cancelled or the energy delivery is completed?

Moreover if a supplier went bankrupt (for example) before the delivery starts, how can we report this? A new report with "Cancel" or only in "EXECUTION" (contract name) reporting in the case of a non-standard contract?

Answer

The status "cancel" in "Action Type" data field No. 45 of Table 2 indicates the termination of an existing contract. "Cancel" should be used to indicate that the market participant or the execution venue has removed the order transaction from trading or, when a contract is terminated before the original end date.

If a supplier went bankrupt either before the delivery starts or after delivery has begun and an early termination of the contract takes place, then a "Cancel" report for the non-standard contract already reported with Table 2 has to be reported to the Agency indicating the date of cancellation. (Please see example 4.53 of cancellation of a standard contract in Annex II to the TRUM.

Zdroj: ACER FAQs on REMIT transaction reporting

Štatistiky

Štatistika reportovania - OKTE



- Počet validovaných reportov od začiatku povinnosti reportovania (7.10.2015 – 30.11.2016): **43 283**
- Počet validovaných *testovacích* reportov (7.10.2015 – 30.11.2016): **20 031**
- Počet klientov RRM OKTE k 30.11.2016: **77**

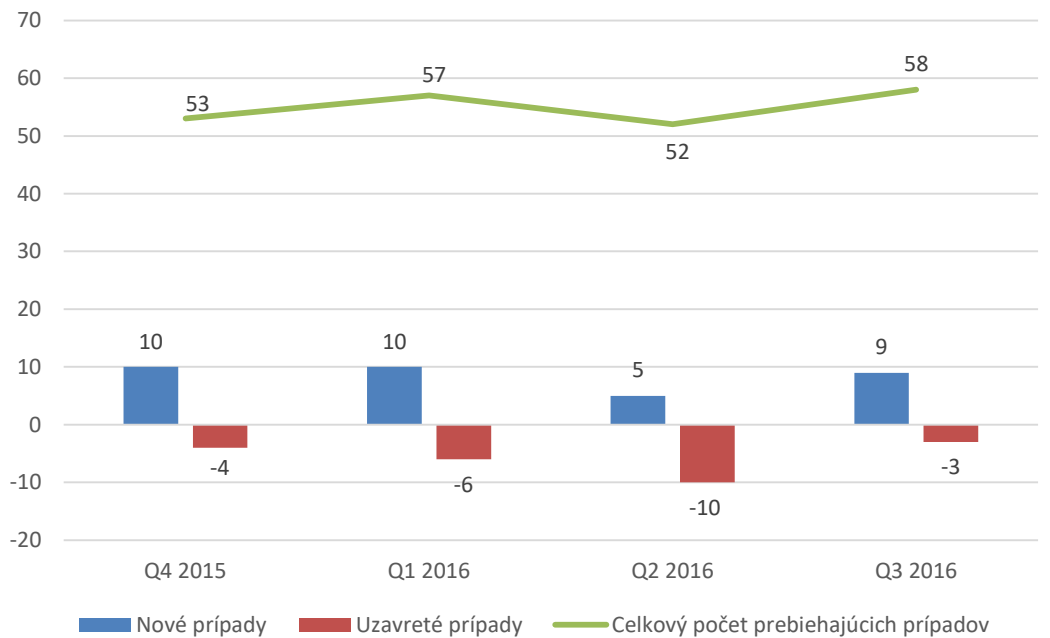
REMIT a kontrola – aktuality

Novinky z ACER



- Na ACER bolo nahlásených vyše **300 miliónov reportov** od začiatku povinnosti reportovania 7.10.2015.
- V európskom registri účastníkov trhu (CEREMP) bolo k 6.10.2016 registrovaných **11 545** účastníkov.
- ACER plánuje **zaviesť novú funkcionality**, tzv. **DART** (Data Accuracy Reporting Tool)
 - riešenie nezrovnalostí ohľadne reportovania priamo s RRM.
- Problémy s reportovaním sa ACER snaží riešiť priamo, pokiaľ nie je nutný zásah národných regulátorov.

Prípady porušenia nariadenia REMIT



Zdroj: REMIT Quarterly Q2-Q3 2016

- ACER momentálne preveruje 58 prípadov možného porušenia nariadenia REMIT
- Podozrenia na porušenie môžu byť ACER-u nahlásené tretími stranami alebo sú zistené monitorovacími aktivitami zo strany ACER-u.

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 RRM OKTE: <https://www.okte.sk/sk/remit/faq>
- Web ACER-u: <https://www.acer-remit.eu/portal/home>
- FAQ ACER REMIT: <https://www.acer-remit.eu/portal/document-download?documentId=x085dc117zj>

Ďakujem za pozornosť

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