

# **Postup pre nahlasovanie transakcií podľa REMIT cez RRM OKTE, a.s.**

**Martin Sliva**

Pracovný seminár k Vnútrodnému trhu a službám RRM v 2. etape REMIT

Bratislava, 1. marec 2016

# Obsah



- ❑ Skúsenosti OKTE s prevádzkou RRM
- ❑ Druhá fáza reportingu podľa REMIT
- ❑ Reportovanie kontraktov v rámci druhej fázy
- ❑ Služba sprostredkovania nahlasovania cez RRM OKTE

# Skúsenosti OKTE s prevádzkou RRM

# Oznamovanie kontraktov z organizovaných trhov (od 7.10.2015)



- Frontloading za platformu SPX 5.10., z cezhraničného trhu ISOT 6.10.

XMtrade® / RRM

Ján Kaiser, Bc.  
Odhlasíť sa



SK  
EN



Reporty												
7.10.2015 7.10.2015 Odosielať / účastník trhu Všetky typy Všetky stavy Zobraziť												
	Operácie	Číslo	Stav spracovania	Odosielať	Odosielať (ID)	Odosielať	Účastník trhu (ID)	Účastník	Začiatok obdobia	Koniec obdobia	Typ	Názov
<input type="checkbox"/>	1	39019	Potvrdený	OKTE, a.s.	B0000138K.SK	ACE		ACE	8. 10. 2015	8. 10. 2015	Štandardný kontrakt	20151007_REMITTable1_V2_B0000138K.SK_46.xml.asc.pgp
<input type="checkbox"/>	2	39018	Potvrdený	OKTE, a.s.	B0000138K.SK	ACE		ACE	8. 10. 2015	8. 10. 2015	Štandardný kontrakt	20151007_REMITTable1_V2_B0000138K.SK_45.xml.asc.pgp
<input type="checkbox"/>	3	39017	Potvrdený	OKTE, a.s.	B0000138K.SK	ACE		ACE	8. 10. 2015	8. 10. 2015	Štandardný kontrakt	20151007_REMITTable1_V2_B0000138K.SK_44.xml.asc.pgp
<input type="checkbox"/>	4	39016	Potvrdený	OKTE, a.s.	B0000138K.SK	ACE		ACE	8. 10. 2015	8. 10. 2015	Štandardný kontrakt	20151007_REMITTable1_V2_B0000138K.SK_43.xml.asc.pgp
<input type="checkbox"/>	5	39015	Potvrdený	OKTE, a.s.	B0000138K.SK	ACE		ACE	8. 10. 2015	8. 10. 2015	Štandardný kontrakt	20151007_REMITTable1_V2_B0000138K.SK_42.xml.asc.pgp
<input type="checkbox"/>	6	39014	Potvrdený	OKTE, a.s.	B0000138K.SK	ACE		ACE	8. 10. 2015	8. 10. 2015	Štandardný kontrakt	20151007_REMITTable1_V2_B0000138K.SK_41.xml.asc.pgp
<input type="checkbox"/>	7	39013	Potvrdený	OKTE, a.s.	B0000138K.SK	ACE		ACE	8. 10. 2015	8. 10. 2015	Štandardný kontrakt	20151007_REMITTable1_V2_B0000138K.SK_40.xml.asc.pgp
<input type="checkbox"/>	8	39012	Potvrdený	OKTE, a.s.	B0000138K.SK	ACE		ACE	8. 10. 2015	8. 10. 2015	Štandardný kontrakt	20151007_REMITTable1_V2_B0000138K.SK_39.xml.asc.pgp
<input type="checkbox"/>	9	39011	Potvrdený	OKTE, a.s.	B0000138K.SK	ACE		ACE	8. 10. 2015	8. 10. 2015	Štandardný kontrakt	20151007_REMITTable1_V2_B0000138K.SK_38.xml.asc.pgp
<input type="checkbox"/>	10	39010	Potvrdený	OKTE, a.s.	B0000138K.SK	ACE		ACE	8. 10. 2015	8. 10. 2015	Štandardný kontrakt	20151007_REMITTable1_V2_B0000138K.SK_37.xml.asc.pgp
<input type="checkbox"/>	11	39009	Potvrdený	OKTE, a.s.	B0000138K.SK	ACE		ACE	8. 10. 2015	8. 10. 2015	Štandardný kontrakt	20151007_REMITTable1_V2_B0000138K.SK_36.xml.asc.pgp
<input type="checkbox"/>	12	38814	Potvrdený	OKTE, a.s.	B0000138K.SK	ACE		ACE	8. 10. 2015	8. 10. 2015	Štandardný kontrakt	20151007_REMITTable1_V2_B0000138K.SK_34.xml.asc.pgp
<input type="checkbox"/>	13	38796	Potvrdený	OKTE, a.s.	B0000138K.SK	ACE		ACE	8. 10. 2015	8. 10. 2015	Štandardný kontrakt	20151007_REMITTable1_V2_B0000138K.SK_21.xml.asc.pgp
<input type="checkbox"/>	14	38795	Potvrdený	OKTE, a.s.	B0000138K.SK	ACE		ACE	8. 10. 2015	8. 10. 2015	Štandardný kontrakt	20151007_REMITTable1_V2_B0000138K.SK_20.xml.asc.pgp
<input type="checkbox"/>	15	38794	Potvrdený	OKTE, a.s.	B0000138K.SK	ACE		ACE	8. 10. 2015	8. 10. 2015	Štandardný kontrakt	20151007_REMITTable1_V2_B0000138K.SK_19.xml.asc.pgp
<input type="checkbox"/>	16	38793	Potvrdený	OKTE, a.s.	B0000138K.SK	ACE		ACE	8. 10. 2015	8. 10. 2015	Štandardný kontrakt	20151007_REMITTable1_V2_B0000138K.SK_18.xml.asc.pgp
<input type="checkbox"/>	17	38792	Potvrdený	OKTE, a.s.	B0000138K.SK	ACE		ACE	8. 10. 2015	8. 10. 2015	Štandardný kontrakt	20151007_REMITTable1_V2_B0000138K.SK_17.xml.asc.pgp
<input type="checkbox"/>	18		Neodosiela sa	OKTE, a.s.	B0000138K.SK	ACE		ACE	8. 10. 2015	8. 10. 2015	Štandardný kontrakt	
<input type="checkbox"/>	19	38791	Potvrdený	OKTE, a.s.	B0000138K.SK	ACE		ACE	8. 10. 2015	8. 10. 2015	Štandardný kontrakt	20151007_REMITTable1_V2_B0000138K.SK_16.xml.asc.pgp
<input type="checkbox"/>	20	38790	Potvrdený	OKTE, a.s.	B0000138K.SK	ACE		ACE	8. 10. 2015	8. 10. 2015	Štandardný kontrakt	20151007_REMITTable1_V2_B0000138K.SK_15.xml.asc.pgp
<input type="checkbox"/>	21	38789	Potvrdený	OKTE, a.s.	B0000138K.SK	ACE		ACE	8. 10. 2015	8. 10. 2015	Štandardný kontrakt	20151007_REMITTable1_V2_B0000138K.SK_14.xml.asc.pgp
<input type="checkbox"/>	22	38788	Potvrdený	OKTE, a.s.	B0000138K.SK	ACE		ACE	8. 10. 2015	8. 10. 2015	Štandardný kontrakt	20151007_REMITTable1_V2_B0000138K.SK_13.xml.asc.pgp
<input type="checkbox"/>	23	38787	Potvrdený	OKTE, a.s.	B0000138K.SK	ACE		ACE	8. 10. 2015	8. 10. 2015	Štandardný kontrakt	20151007_REMITTable1_V2_B0000138K.SK_12.xml.asc.pgp
<input type="checkbox"/>	24	38786	Potvrdený	OKTE, a.s.	B0000138K.SK	ACE		ACE	8. 10. 2015	8. 10. 2015	Štandardný kontrakt	20151007_REMITTable1_V2_B0000138K.SK_11.xml.asc.pgp
<input type="checkbox"/>	25	38785	Potvrdený	OKTE, a.s.	B0000138K.SK	ACE		ACE	8. 10. 2015	8. 10. 2015	Štandardný kontrakt	20151007_REMITTable1_V2_B0000138K.SK_10.xml.asc.pgp
<input type="checkbox"/>	26	38784	Potvrdený	OKTE, a.s.	B0000138K.SK	ACE		ACE	8. 10. 2015	8. 10. 2015	Štandardný kontrakt	20151007_REMITTable1_V2_B0000138K.SK_9.xml.asc.pgp
<input type="checkbox"/>	27	38783	Potvrdený	OKTE, a.s.	B0000138K.SK	ACE		ACE	8. 10. 2015	8. 10. 2015	Štandardný kontrakt	20151007_REMITTable1_V2_B0000138K.SK_8.xml.asc.pgp
<input type="checkbox"/>	28	38782	Potvrdený	SPX, s.r.o.	097900BFDY0000023584	LEI		ACE	8. 10. 2015	8. 10. 2015	Štandardný kontrakt	20151007_REMITTable1_V2_B0000138K.SK_7.xml.asc.pgp

Strana 1 z 1 100 Označené: 0 Uložiť nastavenia tabuľky

Zobrazujem 1 - 34 z 34

# Spôsob výmeny údajov RRM <-> ACER



- OKTE zaviedlo a používa systém manažérstva bezpečnosti informácií podľa normy ISO/IEC 27001:2013
- RRM OKTE komunikuje s Informačným systémom ARIS automatizovaným spôsobom - webové služby
- Špeciálny certifikát ACER, kryptovanie každej správy
- Počet reportov k 29.2.2016: **6 031**
- 4 operátori pre riešenie prevádzkových záležitostí
- RRM Administrátor pre konfiguráciu a eskaláciu požiadaviek

# Povinnosť OMP/RRM spolupracovať s ACER



ACER požiadala OKTE o zaslanie statusu účastníkov KT

Organised market place:	OKTE				
Date from:	07.10.2015				
Date to:	07.11.2015				
No.	Market participant name	Market participant code	Actively trading	Name of RRM	ID of RRM
1			YES	OKTE	B0000138K.SK
2			YES	OKTE	B0000138K.SK
3			YES	OKTE	B0000138K.SK
4			NO	OKTE	B0000138K.SK
5			YES	OKTE	B0000138K.SK
6			NO	OKTE	B0000138K.SK
7			YES	N/A	N/A
8			NO	N/A	N/A
9			YES	OKTE	B0000138K.SK
10			YES	OKTE	B0000138K.SK
11			YES	OKTE	B0000138K.SK
12			YES	OKTE	B0000138K.SK
13			YES	OKTE	B0000138K.SK
14			NO	OKTE	B0000138K.SK
15			YES	OKTE	B0000138K.SK
16			YES	OKTE	B0000138K.SK
17			YES	OKTE	B0000138K.SK
18			NO	OKTE	B0000138K.SK
19			YES	OKTE	B0000138K.SK
20			YES	OKTE	B0000138K.SK
21			NO	OKTE	B0000138K.SK
22			YES	OKTE	B0000138K.SK
23			YES	OKTE	B0000138K.SK
24			YES	OKTE	B0000138K.SK
25			NO	N/A	N/A
26			YES	OKTE	B0000138K.SK
27			YES	OKTE	B0000138K.SK
28			YES	OKTE	B0000138K.SK
29			YES	OKTE	B0000138K.SK
30			NO	OKTE	B0000138K.SK
31			YES	OKTE	B0000138K.SK
32			NO	OKTE	B0000138K.SK
33			YES	OKTE	B0000138K.SK
34			YES	OKTE	B0000138K.SK
35			YES	OKTE	B0000138K.SK
36			YES	OKTE	B0000138K.SK
37			YES	OKTE	B0000138K.SK
38			YES	OKTE	B0000138K.SK
39			YES	OKTE	B0000138K.SK

# **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

# Čo sa reportuje v 2. fáze?

## OTC, aukcie, deriváty



- 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 v 2. fáze?

## Fundamentálne dáta



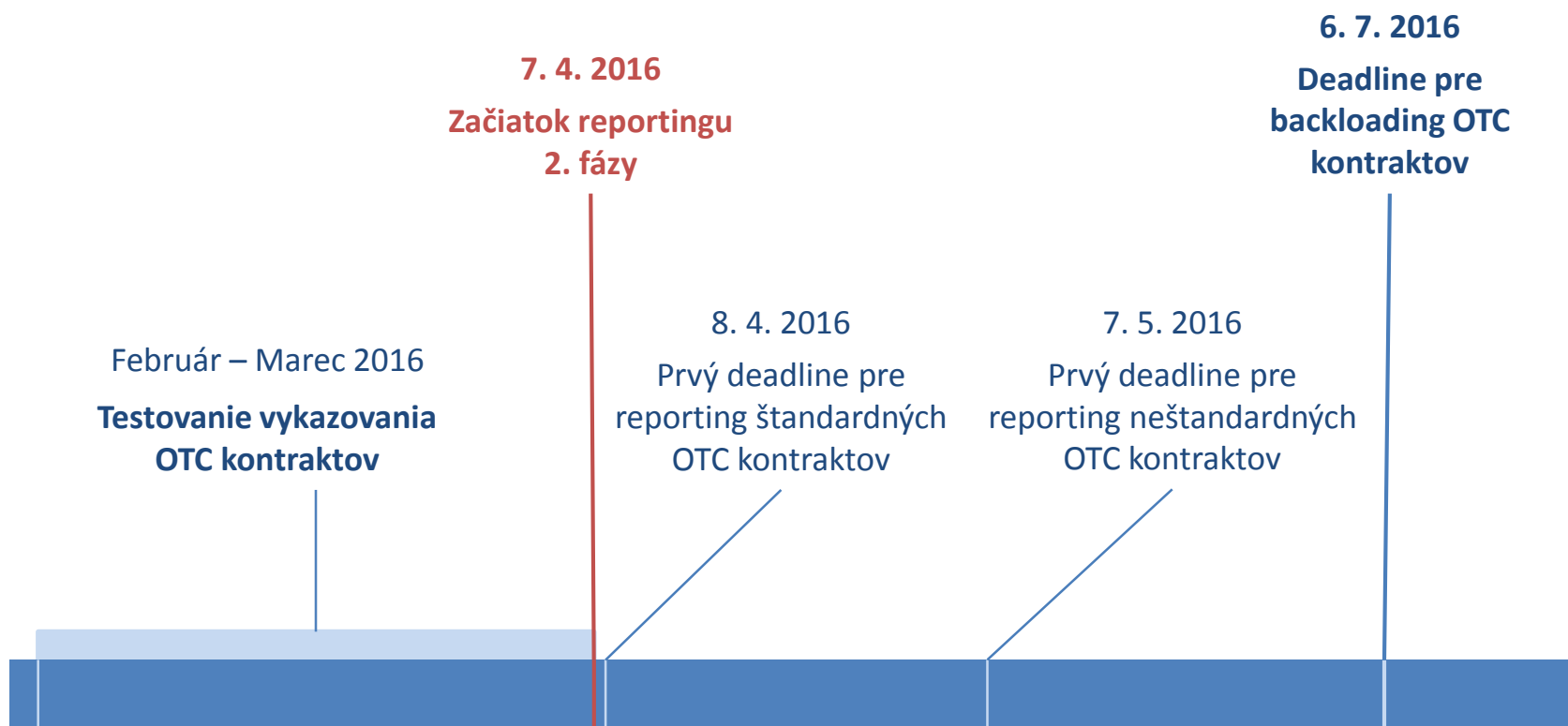
- Základné údaje o prevádzke
  - PPS (elektrina) - záverečné cezhraničné nominácie
  - PPS (plyn) - nominácie deň vopred, záverečné renominácie a pridelené množstvá
  - PZ (plyn) – prevádzkové a obchodné dáta
  - Účastník trhu - objem plynu, ktorý má na konci plynárenského dňa uskladnený v zásobníku (môže reportovať PZ)

# 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
  - Veľkí odberatelia s technickou schopnosťou spotreby > 600 GWh / rok
- Na vyžiadanie ACER / národného regulátora: Povinní interne evidovať
  - Vnútrokupinové zmluvy
  - Transakcie výrobcov < 10 MWe, resp. 20 MW (ani registrácia v CEREMP)
  - Zmluvy na vyvažovacie služby pre elektrinu a zemný plyn

# Harmonogram druhej fázy



# **Reportovanie kontraktov v rámci druhej fázy**

# Požiadavky ACER – RRM, MOP, TRUM



## Hierarchy of REMIT rules

1<sup>st</sup> level

REMIT

2<sup>nd</sup> level



REMIT Implementing Acts (IAs)  
on the basis of Article 8 of REMIT

3<sup>rd</sup> level



Requirements for the registration of RRM  
(Trade and Fundamental data)

Technical Specifications for RRM

Manual of Procedures on Transaction Data, Fundamental Data and Inside  
Information Reporting  
on the basis of Article 10(3) of the draft IAs

**Transaction Reporting User Manual (TRUM)**  
on the basis of Article 5(2) of the draft IAs

# Otvorené otázky na interpretáciu ACER

ACER spolupracuje s:

- Asociáciou účastníkov trhu (FAQ, Q&A)
  - Pri určení typu kontraktu (štandardný vs. neštandardný), z ktorého vyplynie termín zasielania nasledujúci pracovný deň alebo do 1 mesiaca
- ENTSO-E a ENTSO-G (manuál MOP)
  - Fundamentálne dáta a schémy pre PPS
- Používateľskou skupinou RRM (aktualizácia systému ARIS)
  - Validácia v rámci backloadingu (nasadenie v systéme ARIS k 7.4.2016)
  - Kvalita dát (duplicitné nahlasovanie, nesprávna interpretácia životného cyklu, identifikátory)

# Úlohy účastníkov trhu pred reportovaním bilaterálnych kontraktov



Pri uzatváraní OTC kontraktu:

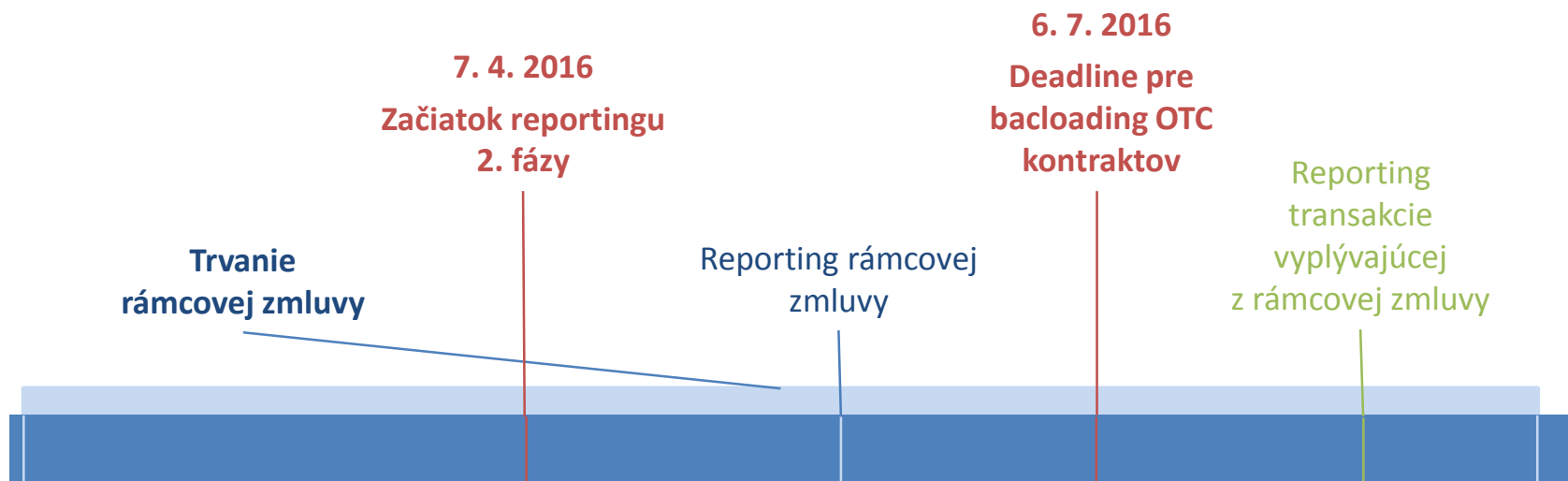
- Odsúhlasiť hodnoty parametrov
  - detaily kontraktu
    - UTI (Unique Transaction Identifier)
      - strana zodpovedná za generovanie UTI alebo použitie všeobecnej univerzálnej definovanej metodológie (od ACER)
    - detaily prípadného cenového indexu alebo vzorca
    - detaily prípadnej opcie a jej možností
    - diagram dodávky
- Dohodnúť sa na delegovanom reportovaní - 1 strana odosiela obidve časti kontraktu (predaj-nákup)

# Backloading aktívnych kontraktov



Postup účastníka trhu :

- Pripraví dáta v schéme definovanej ACER
- Vykáže rámcovú zmluvu, následne vykáže transakcie
- Jednorazovo zašle cez RRM OKTE do systému ARIS

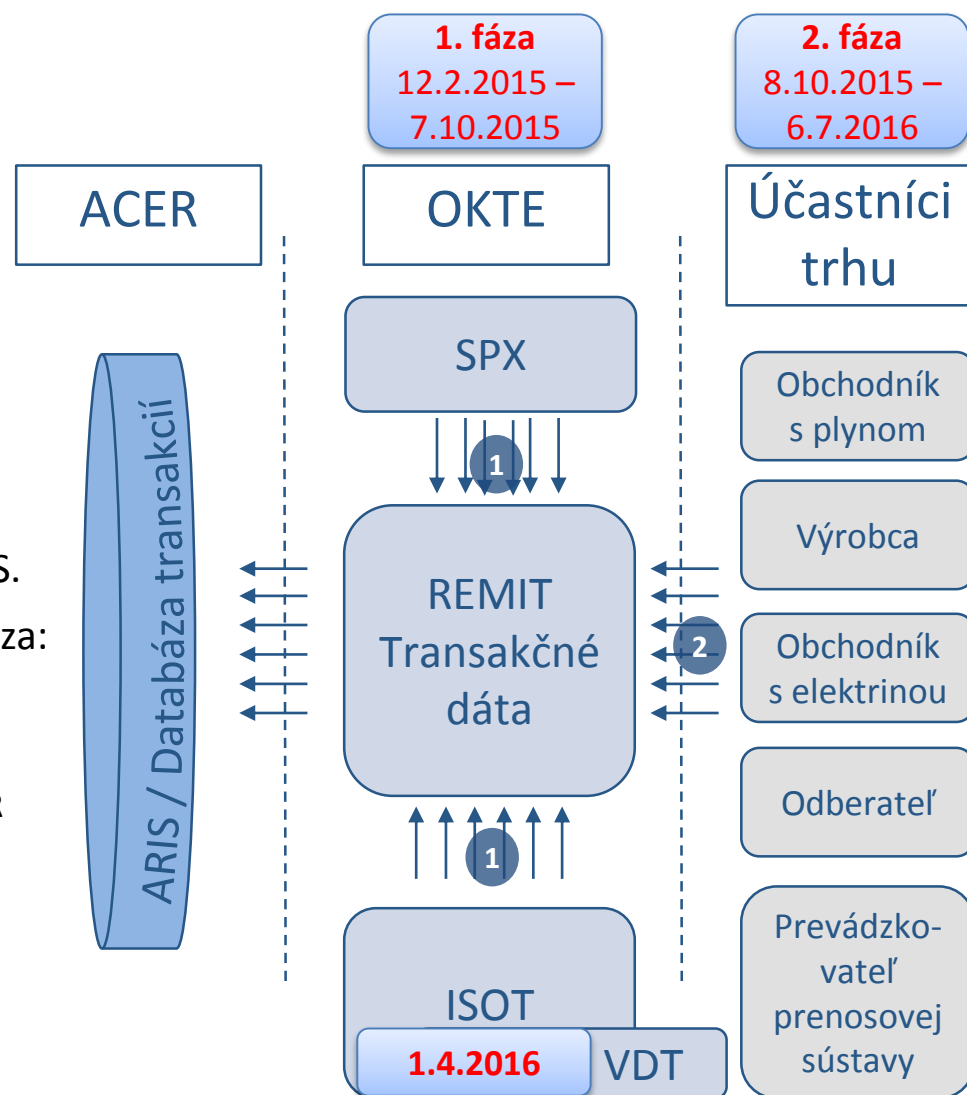


# **Služba sprostredkovania nahlasovania kontraktov cez RRM OKTE**

# Technické riešenie: 1. vs. 2. fáza



- 1 Údaje OMP o štandardných kontraktach sú získavané zo systémov ISOT a SPX.
  - OMP je zodpovedné za:
    - Funkčný a spoľahlivý systém
    - Prípravu transakčných dát, ich včasné a úplné odoslanie
    - Sprístupnenie potvrdenia ACER pre svojich účastníkov
- 2 Rozhranie na príjem štandardných a neštandardných OTC, nominácií a aukcií PPS.
  - Účastník trhu vrátane PPS je zodpovedný za:
    - Prípravu transakčných dát podľa reportovacej schémy ACER
    - Včasné a úplné reportovanie cez RRM na ACER
    - Prijímanie správ o potvrdení prijatia alebo zamietnutia správy
    - Po zamietnutí poskytnutie opravnej informácie k príslušnej transakcii



# Spôsoby reportingu



- **Manuálne zadanie údajov prostredníctvom on-line formulára**
  - Nízke počiatočné náklady
  - Ideálne pre malý počet reportovaných transakcií
- **Manuálne nahratie XML súboru vo formáte definovanom ACER**
  - Efektívne riešenie pre klientov schopných poskytovať 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 poskytovať dáta vo formáte špecifikovanom ACER

# Cenová ponuka reportingu



Nahlasovanie transakcií 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**
  - 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)

# Postup pri nahlasovaní údajov zo strany účastníka trhu



## 1. Audit vlastných reportovateľných kontraktov

- Aká povinnosť podľa Vykonávacieho nariadenia REMIT

## 2. Dohoda účastníkov trhu o parametroch OTC kontraktov

- Úprava v obchodnom systéme podľa ACER TRUM manuálu

## 3. Podpis s OKTE Zmluvu REMIT

- Čím skôr pre prístup do testovacieho rozhrania
- Povinnosť označiť RRM v CEREMP ÚRSO do 7.4.2016

## 4. Konverzia údajov do schém ACER

- Vo vlastnom IT, resp. do formulára OKTE

# Ďakujem za pozornosť

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

**Mgr. Martin Sliva, PMP**  
Projektový koordinátor

e-mail:  
**remit@okte.sk**