



TOWAROWA
GIEŁDA ENERGII S.A.

Grupa Kapitałowa GPW

TGE RRM – aktualny stan realizacji projektu

Jan Noworyta

Dyrektor Biura GPI/REMIT

Komitet Rynku Energii Elektrycznej

Warszawa, 16 marca 2015

ZALEŻNE OD REMIT

ZALEŻNE OD AKTÓW
WYKONAWCZYCH

REMIT – wejście w życie

- Zakaz manipulacji/usiłowania manipulacji i niezgodnego z prawem wykorzystania informacji wewnętrznej
- Obowiązek podania informacji wewnętrznej do publicznej wiadomości

6 miesięcy → **ACER** – publikacja decyzji w sprawie formatu rejestracji uczestników rynku

18 miesięcy → Implementacja uprawnień organów nadzoru do prawa krajowego

PRZYJĘCIE AKTÓW WYKONAWCZYCH PRZEZ KE

max. 3 miesiące → REJESTRACJA UCZESTNIKÓW RYNKU

9* miesięcy → RAPORTOWANIE KONTRAKTÓW
GIEŁDOWYCH

15* miesięcy → RAPORTOWANIE
KONTRAKTÓW OTC

GRU 2011

???

GRU 2014

* Od momentu wejścia w życie IA (20 dni od publikacji)





18 GRU 2014:

przyjęcie aktów implementujących przez KE

7 STY 2015:

Wejście w życie aktów implementujących i publikacja dokumentów ACER

STY 2015:

Rejestracja oraz testy RRM w ACER



7 PAŹ 2015:

raportowanie kontraktów giełdowych

7 STY 2016:

backloading kontraktów giełdowych



7 KWI 2016:

raportowanie kontraktów OTC

7 LIP 2016:

backloading kontraktów OTC

GRU 2014

STY 2015

MAR 2015

PAŹ 2015

...

STY 2016

KWI 2016

LIP 2016

MARZEC 2015:

rozpoczęcie rejestracji uczestników rynku polskiego przez URE



TOWAROWA
GIEŁDA ENERGII S.A.

Grupa Kapitałowa GPW

REMIT – AKTY IMPLEMENTUJĄCE

POZIOM I

REMIT

POZIOM II

REMIT – AKTY IMPLEMENTUJĄCE KE -
ROZPORZĄDZENIE 1348/2014

III POZIOM

ACER Trade Reporting
User Manual (TRUM)

ACER RRM
Requirements

ACER Manual of
Procedures

Format raportowania
zleceń

ACER – specyfikacja
techniczna RRM

MAPA REMIT



CEREMP
Centralised European Registry for Energy Market Participants

REJESTRACJA



OBRÓT



**TOWAROWA
GIEŁDA ENERGII S.A.**
Grupa Kapitałowa GPW

RAPORTOWANIE



**Urząd Regulacji
Energetyki**

BADANIE NARUSZEŃ



MONITORING
ACER
Agency for the Cooperation
of Energy Regulators



SANKCJE

EMIR/MiFID  **REMIT**



**TOWAROWA
GIEŁDA ENERGII S.A.**
Grupa Kapitałowa GPW

PRODUKTY ENERGETYCZNE SPRZEDAWANE W OBROTCIE HURTOWYM

- Kontrakty na dostawę energii elektrycznej i gazu w UE
- Kontrakty pochodne dotyczące energii elektrycznej i gazu wytwarzanych/sprzedawanych/dostarczanych w UE
- Kontrakty dotyczące przesyłu energii elektrycznej i gazu w UE
- Kontrakty pochodne dotyczące przesyłu energii elektrycznej i gazu w UE



TRANSAKCJE I ZLECENIA...

- REMIT nakłada obowiązek raportowania transakcji i zleceń
- Raport zlecenia należy przekazać nawet, jeżeli transakcja nie została zawarta
- Zlecenia na „*blind auction*” raportowane po zakończeniu aukcji
- Zlecenia głosowe raportowane na wniosek ACER



WYŁĄCZENIE KLIENTÓW KOŃCOWYCH

- Kontrakty na dostawę i dystrybucję energii elektrycznej i gazu na potrzeby klientów końcowych nie są produktami energetycznymi sprzedawanymi w obrocie hurtowym, o ile **zdolność konsumpcji tych klientów nie przekracza 600 GWh rocznie** (przy wykorzystaniu pełnej zdolności konsumpcyjnej)
- Wielkość ta liczona jest oddzielnie dla energii elektrycznej i gazu
- Duży odbiorca powinien przekazać kontrahentom informację na temat swoich zdolności konsumpcyjnych w odniesieniu do energii elektrycznej i gazu



WYŁĄCZNIE NA WNIOSEK ACER

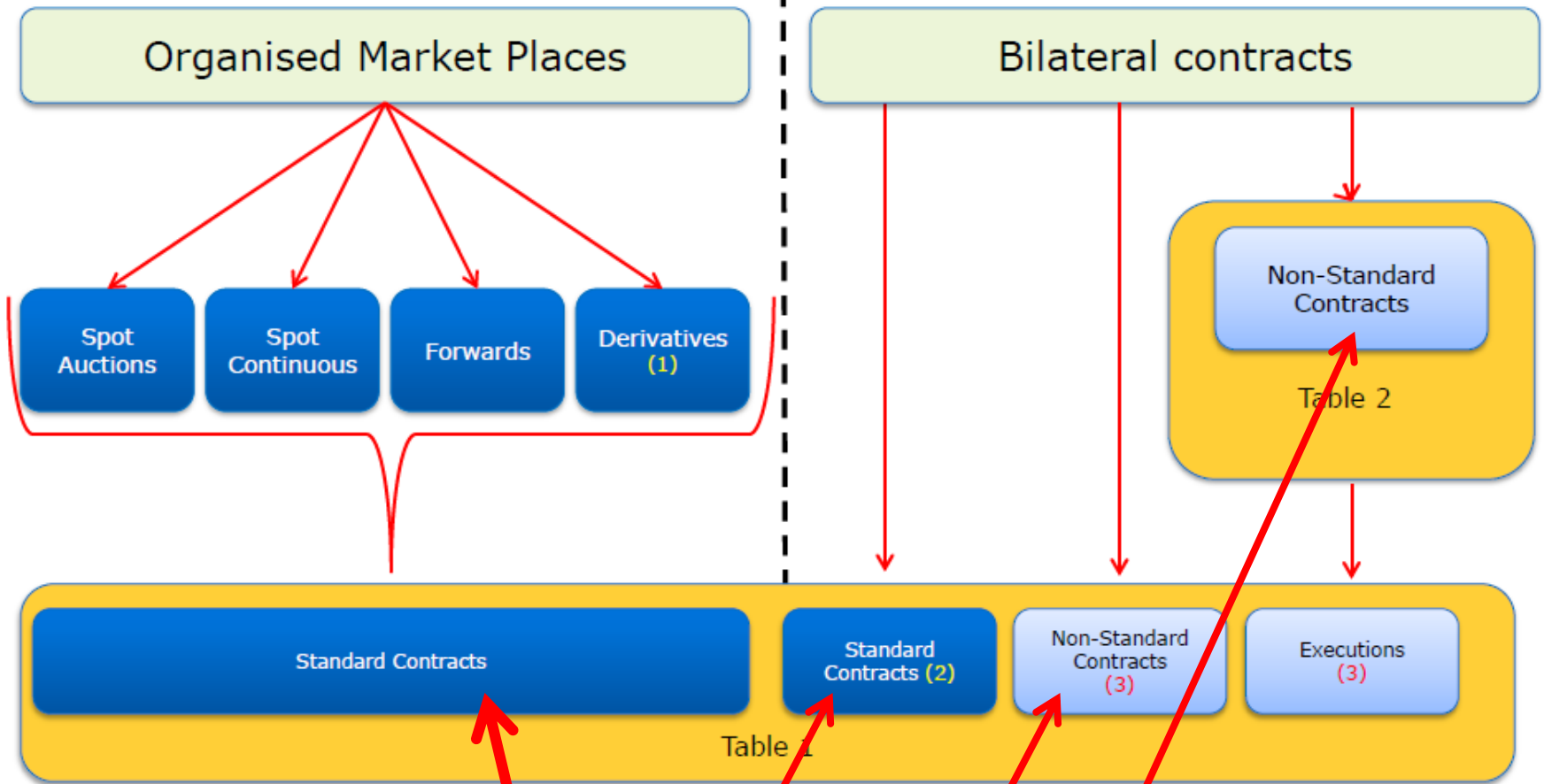
O ILE NIE SĄ ZAWIERANE POPRZEZ GIEŁDĘ

- Transakcje wewnątrz-grupowe
- Kontrakty na rynku bilansującym
- Kontrakty na dostawę energii elektrycznej wyprodukowanej w jednostce produkcyjnej o mocy mniejszej lub równej 10 MW lub przez jednostki produkcyjne o łącznej mocy produkcyjnej mniejszej lub równej 10 MW
- Kontrakty na dostawę gazu z pojedynczego złoża o zdolności produkcyjnej równej lub mniejszej niż 20 MW

**ACER MARKET MONITORING DEPARTMENT NON-ACTION LETTER
OBOWIĄZUJE DO KOŃCA ROKU 2016**



Standard vs non-standard contracts



- (1) Trades not reported under EU financial legislations
- (2) Contracts that are admitted to trade at Organised Market Places
- (3) Details of transactions executed within the framework of non-standard contracts specifying at least an outright volume and price shall be reported using Table 1 of the Annex to the IIS.

T + 1

T + 1M

LISTA KONTRAKTÓW STANDARDOWYCH

- Termin publikacji w Portalu REMIT – **17 marca 2015**
- ACER sporządzi listę na podstawie danych referencyjnych przekazanych przez platformy obrotu

Elementy charakterystyki kontraktów standardowych:

NAZWA KONTRAKTU	OBSZAR DOSTAWY	RODZAJ TOWARU	TYP KONTRAKTU	SPOSÓB DOSTAWY	MIEJSCE OBROTU
-----------------	----------------	---------------	---------------	----------------	----------------

BACKLOADING

Kontrakty zawarte przed wejściem w życie obowiązku raportowania, które pozostają w mocy w dniu wejścia w życie obowiązku powinny zostać zaraportowane do ACER **w ciągu 90 dni** od terminu wejścia w życie obowiązku raportowania dla tych kontraktów.



BACKLOADING – ZAKRES INFORMACJI

- Zakres informacji, które należy przekazać w ramach backloading'u został określony poprzez odesłania do **Dyrektyw 72/2009 i 73/2009**
- W ramach backloading'u raportowane są transakcje, a nie pozycje
- Raport powinien zawierać **co najmniej**:
 - ✓ Czas trwania kontraktu
 - ✓ Warunki dostawy i rozliczenia
 - ✓ Ilość towaru
 - ✓ Terminy wykonania
 - ✓ Cenę
 - ✓ Identyfikację kontrahentów



PODMIOTY RAPORTUJĄCE

Art. 8 (1) REMIT - Uczestnicy hurtowego rynku energii

Art. 8 (4) REMIT - w imieniu uczestników rynku:

- Osoby trzecie – kontrahenci
- Systemy zgłaszania transakcji
- Osoby zajmujące się zawodowo pośredniczeniem w zawieraniu transakcji – giełdy energii, platformy brokerskie
- Repozytoria Transakcji
- Właściwe organy - ESMA



PODMIOTY RAPORTUJĄCE

Art. 6 Rozporządzenia 1348/2014:

- Kontrakty zawierane na zorganizowanej platformie obrotu powinny być raportowane za pośrednictwem tej platformy lub profesjonalny system zgłaszania transakcji
- Na wniosek członka Giełda powinna zaoferować umowę raportowania danych transakcyjnych
- Uczestnicy rynku energii mogą samodzielnie raportować wyłącznie transakcje bilateralne



RRM – Registered Reporting Mechanism

- Kanałem raportowania do ACER jest RRM
- Status RRM może uzyskać każdy podmiot, który spełni wymagania techniczne i organizacyjne, które określi ACER - *RRM Requirements*
- Status RRM należy uzyskać przed zaraportowaniem pierwszej transakcji
- Okres rejestracji wg ACER jest przewidziany na około 3 miesiące
- TGE rozpoczęła proces rejestracji RRM w styczniu 2015
- Działalność RRM powinna być w każdym momencie zgodna z *ACER RRM Requirements*

ODPOWIEDZIALNOŚĆ

Art. 11 Rozporządzenia 1348/2014

- Uczestnik rynku nie jest odpowiedzialny za błędy w kompletności, adekwatności i terminowości przekazania danych transakcyjnych, w zakresie w którym można je przypisać podmiotowi raportującemu
- Uczestnik rynku jest obowiązany do regularnego weryfikowania kompletności, adekwatności i terminowości przekazywanych danych transakcyjnych – baza potwierdzeń ACER



RAPORTOWANIE DO ACER

- Nie wszystkie pola w Tabeli są wymagane – zwłaszcza w przypadku kontraktów zawieranych na Giełdzie
 - **Beneficiary identification**
- Niektóre pola w Tabeli mogą być wypełnione na kilka sposobów
 - **Counterparty ID**

ACER może zażądać od uczestników rynku oraz podmiotów raportujących dodatkowych informacji dotyczących przekazanych raportów.



UTI – UNIQUE TRADE IDENTIFIER

- Wymagany również przez akty wykonawcze REMIT
- Kod alfa-numeryczny umożliwiający parowanie raportów dotyczących tej samej transakcji
- Max. 52 znaki
- UTI powinien zostać wygenerowany i uzgodniony z drugą stroną transakcji
- ACER zaproponuje sposób generowania UTI



„Repozytoria transakcji odnajdują pary dla około 60 % raportów”

„Niektóre podmioty zaczęły raportować bez LEI i UTI, wypełniając pole innym elementem, co czyni odnalezienie pary dla takiego raportu praktycznie niemożliwym”



DTCC

TOWAROWA
GIEŁDA ENERGII S.A.

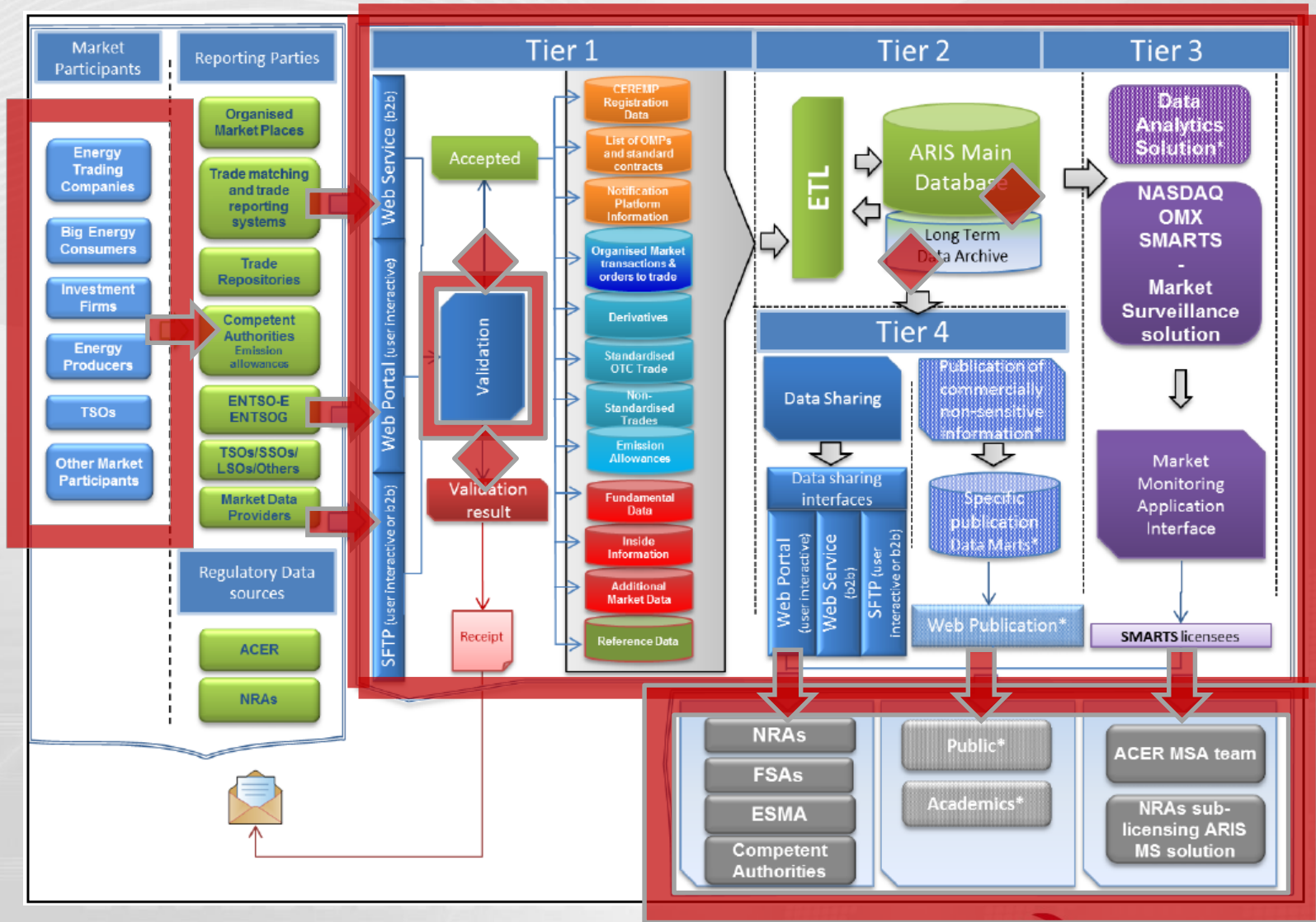
Grupa Kapitałowa GPW

SANKCJE ADMINISTRACYJNE

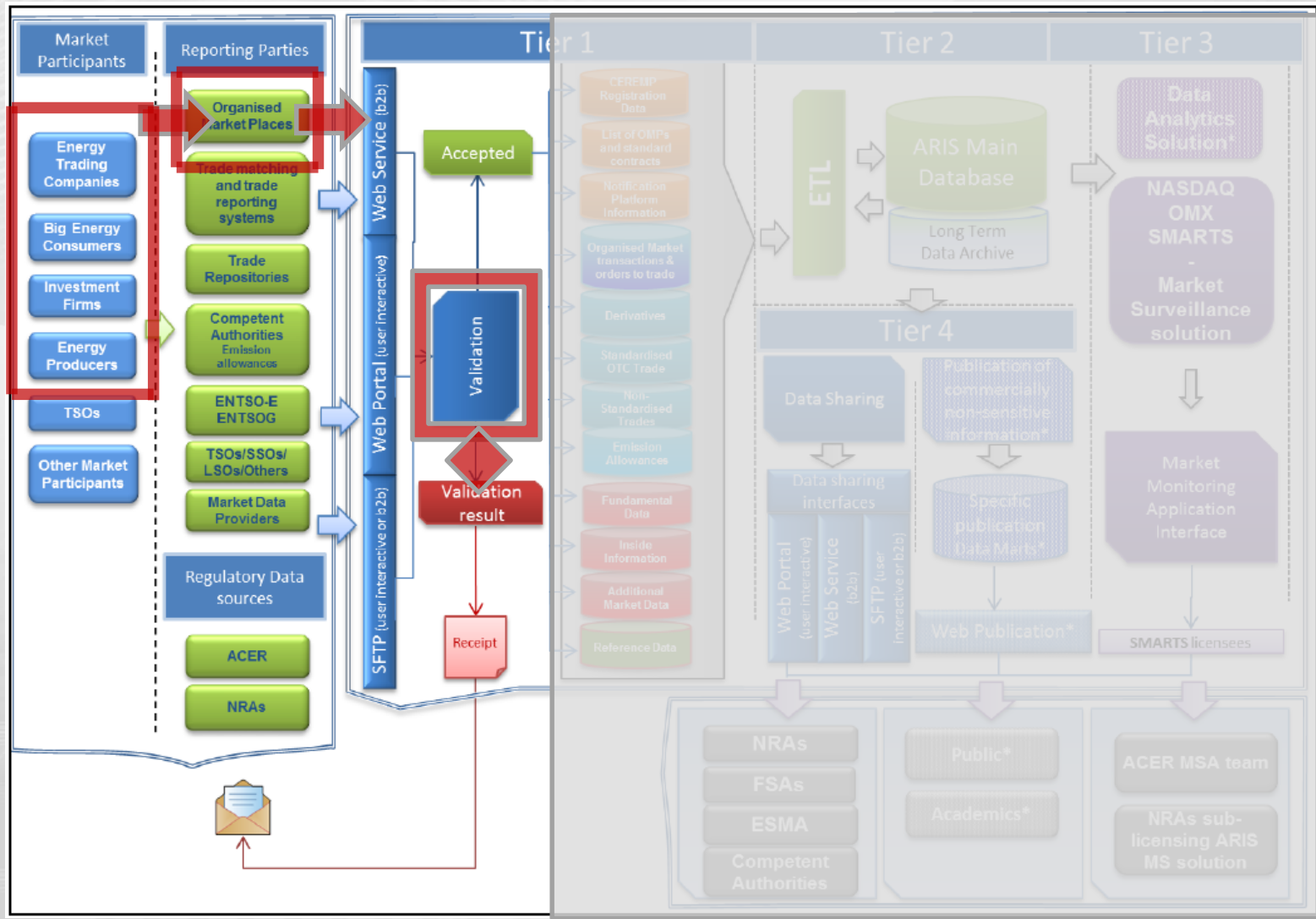
- **KARA PIENIĘŻNA 10 000 – 1 000 000 PLN:**
 - Nieprzekazanie danych transakcyjnych ACER
 - Zawieranie transakcji bez dokonania wpisu w rejestrze uczestników rynku



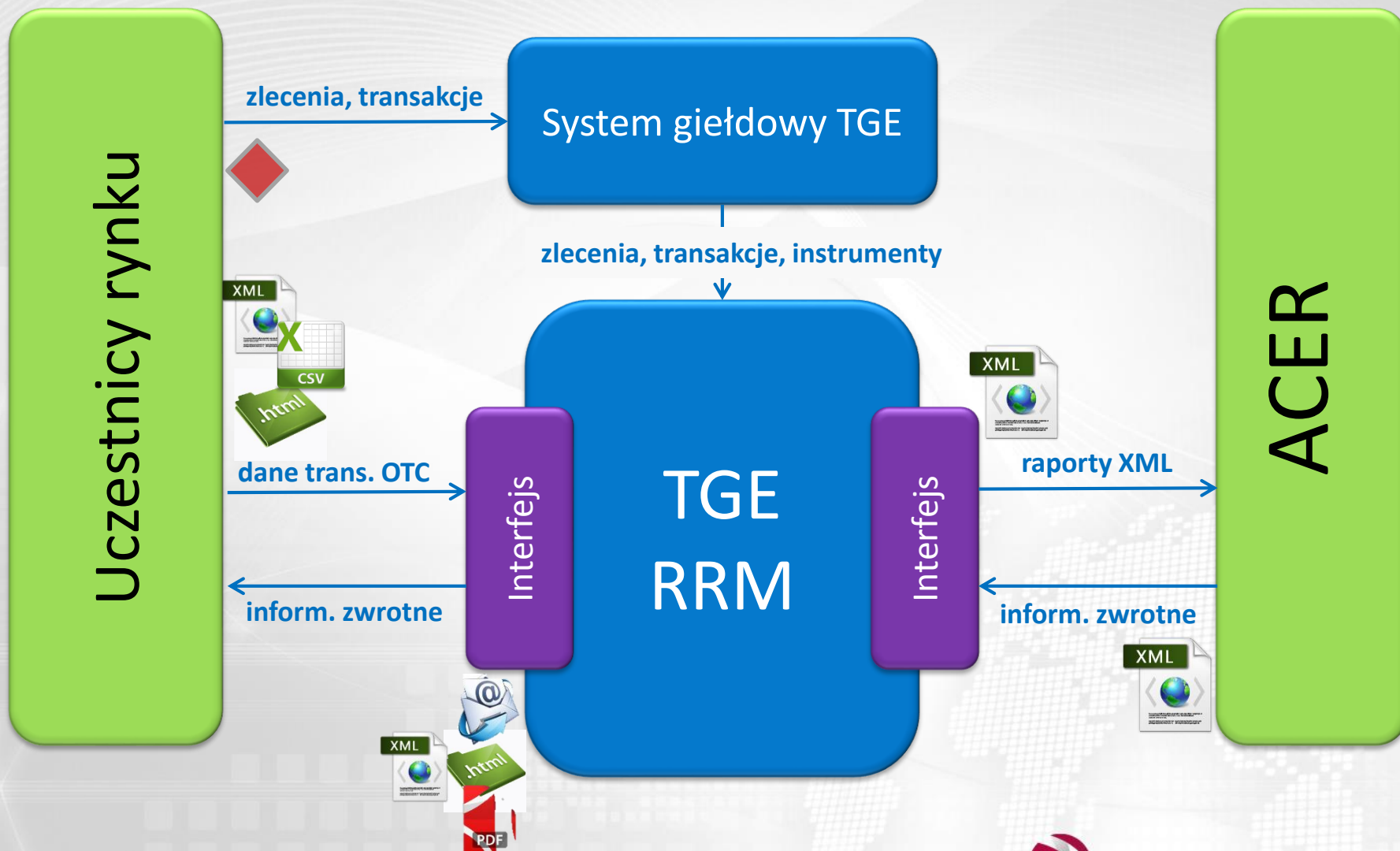
ARIS – ACER REMIT Information System



ARIS – ACER REMIT Information System



TGE RRM



Co za nami?

1. Udział w projekcie pilotażowym REMIT Pilot Project

2. Udziały w warsztatach ACER

3. Praca nad dodefiniowaniem pojęć – wspólne rozumienie danych

4. Logika mapowania pól i opisu danych transakcyjnych

5. Nawiązanie współpracy z partnerem technologicznym

6. Przygotowanie prototypu rozwiązania



Jesteśmy w trakcie / co jeszcze przed nami:

1. Uzyskanie ostatecznych wytycznych dot. logiki od ACER

2. Dopasowanie elementów infrastruktury

3. Przygotowanie podsystemów komunikacji

4. Przygotowanie logicznej ścieżki obsługi informacji zwrotnej

5. Przechowywanie danych i udostępnianie danych archiwalnych

6. Testy

7. Produkcyjny start



OFERTA TGE RRM

Intencją TGE jest zaoferowanie uczestnikom rynku raportowania:

- transakcji giełdowych i OTC
- kontraktów standardowych i niestandardowych
- usługi backloadingu transakcji

TGE rozpoczęła już proces rejestracji TGE RRM w ACER!



CENY RAPORTOWANIA ZDARZEŃ GIEŁDOWYCH

- Średnia miesięczna opłata za raportowanie transakcji giełdowych nie powinna przekroczyć 2000 PLN
- Polityka cenowa zostanie zbudowana w oparciu o aktywność na rynkach TGE
- Bazując na obecnym poziomie aktywności, opłata dla najbardziej aktywnych członków, nie powinna przekroczyć 5000 PLN
- Po 3 latach funkcjonowania systemu, TGE planuje obniżenie opłat za raportowanie transakcji giełdowych





TOWAROWA
GIEŁDA ENERGII S.A.

Grupa Kapitałowa GPW

Dziękuję za uwagę

Kontakt

E-mail: jan.noworyta@tge.pl

Telefon: +48 608 631 600