



VIII FORUM OBROTU  
2015

# Mechanizm raportowania RRM

**Grzegorz Szpecht**

Analitik Biznesowy, Dział Informatyki TGE

VIII FORUM OBROTU

Lidzbark Warmiński, 8-10 czerwca 2015



TOWAROWA  
GIEŁDA ENERGII S.A.

Grupa Kapitałowa GPW

# Plan prezentacji

1. Skąd obowiązki raportowania?
2. Co i kiedy trzeba raportować?
3. Zakres i format danych
4. Oferta RRM TGE
5. System informatyczny RRM TGE



# 1. Skąd obowiązki raportowania?



# Rozporządzenie REMIT

Zapewnienie integralności i przejrzystości hurtowych rynków energii i gazu, zapobieganie nadużyciom i ich wykrywanie.

**+ Akty Implementujące REMIT**

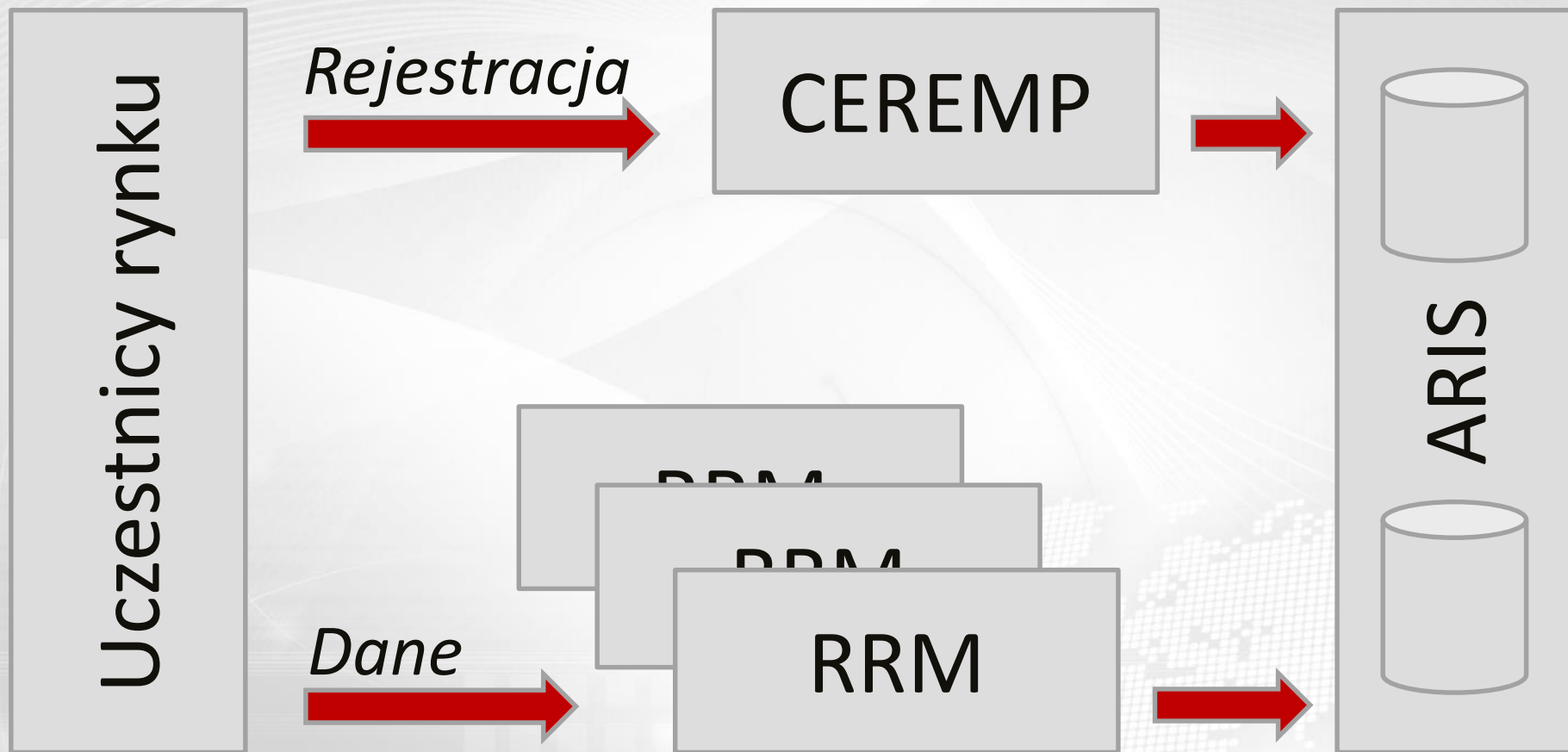


# Monitoring rynków

- Realizowany przez ACER
- Masowe gromadzenie danych transakcyjnych
- Analiza potencjalnych nieprawidłowości



# Gromadzenie danych



## 2. Co i kiedy trzeba raportować?



# Co podlega raportowaniu?

- Kontrakty na **dostawę** energii i gazu oraz kontrakty pochodne
- Kontrakty na **przesył** energii i gazu oraz kontrakty pochodne



# Od kiedy trzeba raportować?

	Raportowanie bieżące	Raportowanie backloading
Rynki zorganizowane	Od <b>07.10.2015</b>	Od <b>07.10.2015</b> Do 07.01.2016
Rynek OTC	Od <b>07.04.2016</b>	Od <b>07.04.2016</b> Do 07.07.2016



# Standardowe/Niestandardowe

- **Standardowe** – dopuszczone do obrotu na zorganizowanym rynku
- **Niestandardowe** – wszystkie pozostałe



# Standardowe/Niestandardowe

	Standardowe	Niestandardowe
Czas na zaraportowanie	T+1D	T+1M
Zakres danych (Akty Implementujące REMIT)	Tabela nr 1	Tabela nr 2
Zakres/format danych (XML)	REMITTable1	REMITTable2*

\* kontrakty ze znanym wolumenem i ceną raportowane w REMITTable1



### 3. Zakres i format danych



# Zakres/format danych (XML)

REMITTabelle1

Identyfikator RRM (reportingEntityID)

Definicje instrumentów (contractList)

- Instrument1 (contract)
- Instrument2 (contract)
- (...)

Lista zleceń (OrderList)

- Zlecenie1 (OrderReport)
- Zlecenie2 (OrderReport)
- (...)

Lista transakcji (TradeList)

- Transakcja1 (TradeReport)
- Transakcja2 (TradeReport)
- (...)

REMITTabelle1

# Zakres/format danych (XML)

REMITTABIE1

Identyfikato

Definicje ins

- Instrument1
- Instrument2
- (...)

Lista zleceń

- Zlecenie1 (O
- Zlecenie2 (O
- (...)

Lista transak

- Transakcja1 (
- Transakcja2 (
- (...)

**RDS2\_09-06-2015H01** (contractID)

**AU** (contractType)

**EL** (energyCommodity)

**P** (settlementMethod)

**PLPX** (organisedMarketPlaceIdentifier)

**10:35:00** (contractTradingHours->startTime)

**11:30:00** (contractTradingHours->endTime)

**2015-06-08T11:30:00** (lastTradingDateTime)

**10YPL-AREA-----S** (deliveryPointOrZone)

**2015-06-09** (deliveryStartDate)

**00:00:00** (loadDeliveryStartTime)

**00:59:59** (loadDeliveryEndTime)

# Zakres/format danych (XML)

REMITTABLE1

Identyfikato

Definicje ins

- Instrument1
- Instrument2
- (...)

Lista zleceń

- Zlecenie1 (O
- Zlecenie2 (O
- (...)

Lista transak

- Transakcja1 (
- Transakcja2 (
- (...)

**1** (RecordSeqNumber)

**LKJSDFL5Y.PL** (idOfMarketParticipant)

**Trader12345** (traderID)

**P** (tradingCapacity)

**B** (buySellIndycator)

**G.23LKSD89L23** (orderID)

**LIS** (orderType)

**ACT** (orderStatus)

**SES** (orderDuration)

**RDS2\_09-06-2015H01** (contractID)

**PLPX** (organisedMarketPlaceIdentifier)

**2015-06-08T10:48:12** (transactionTime)

**136.80** (price)

**PLN** (priceCurrency)

**5** (quantity->value)

**MW** (quantity->unit)

**N** (actionType)

# Zakres/format danych (XML)

REMITTABLE1

Identyfikato

Definicje ins

- Instrument1
- Instrument2
- (...)

Lista zleceń

- Zlecenie1 (O
- Zlecenie2 (O
- (...)

Lista transak

- Transakcja1 (
- Transakcja2 (
- (...)

**1** (RecordSeqNumber)

**LKJSDFL5Y.PL** (idOfMarketParticipant)

**Trader12345** (traderID)

**P** (tradingCapacity)

**B** (buySellIndycator)

**RDS2\_09-06-2015H01** (contractID)

**PLPX** (organisedMarketPlaceIdentifier)

**2015-06-08T11:46:39** (transactionTime)

**2353-9857** (uniqueTransactionIdentifier)

**G.23LKSD89L23** (linkedOrderId)

**132.40** (price)

**PLN** (priceCurrency)

**662.00** (notionalAmount)

**5** (quantity->value)

**MW** (quantity->unit)

**5** (totalNotionalContractQuantity->value)

**MWh** (totalNotionalContractQuantity->unit)

**N** (actionType)

## 4. Oferta RRM TGE



# Oferta RRM TGE

- Raportowanie bieżących danych oraz backloading
- Wszystkie kontrakty objęte obowiązkiem REMIT
- Zasady świadczenia usług opisane w Regulaminie
- Wniosek o zawarcie umowy o raportowanie
- W drugim etapie także raportowanie OTC
- Opłaty zgodnie z tabelą opłat

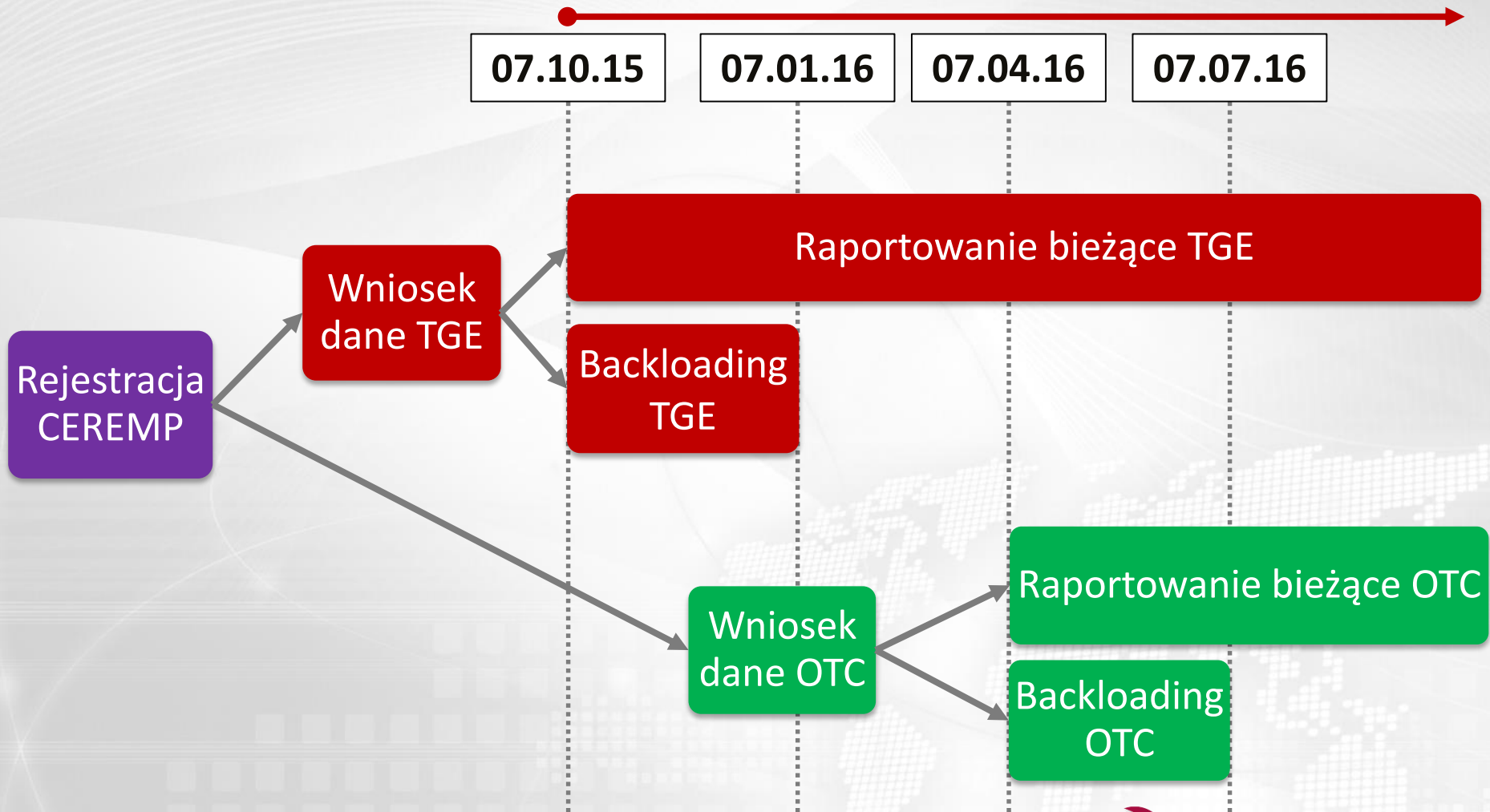


# Opłaty za raportowanie RRM

<b>miesięczna stała:</b> monthly fixed fee:	0,00 PLN		<b>liczba transakcji miesięcznie:</b> number of transactions per month:	
<b>miesięczne zmienne:</b> monthly variable fees:	0,50 PLN	→	od / from	do / to
	0,25 PLN	→	0	4 999
	0,15 PLN	→	5 000	9 999
	0,08 PLN	→	10 000	19 999
			20 000	∞

- Rozliczenie miesięczne
- Brak opłat stałych
- Opłata naliczana za każdą poprawnie zaraportowaną transakcję
- Stawka jednostkowa zależna od liczby transakcji w miesiącu
- Brak opłat za raportowanie operacji na zleceniach

# Kamienie milowe



# Rozkład odpowiedzialności

## TGE

Raportowanie spełniające obowiązek REMIT

Terminowość, integralność, kompletność oraz poufność danych

## Uczestnik RRM TGE

Rejestracja w CEREMP, poprawność przekazanych kodów ACER

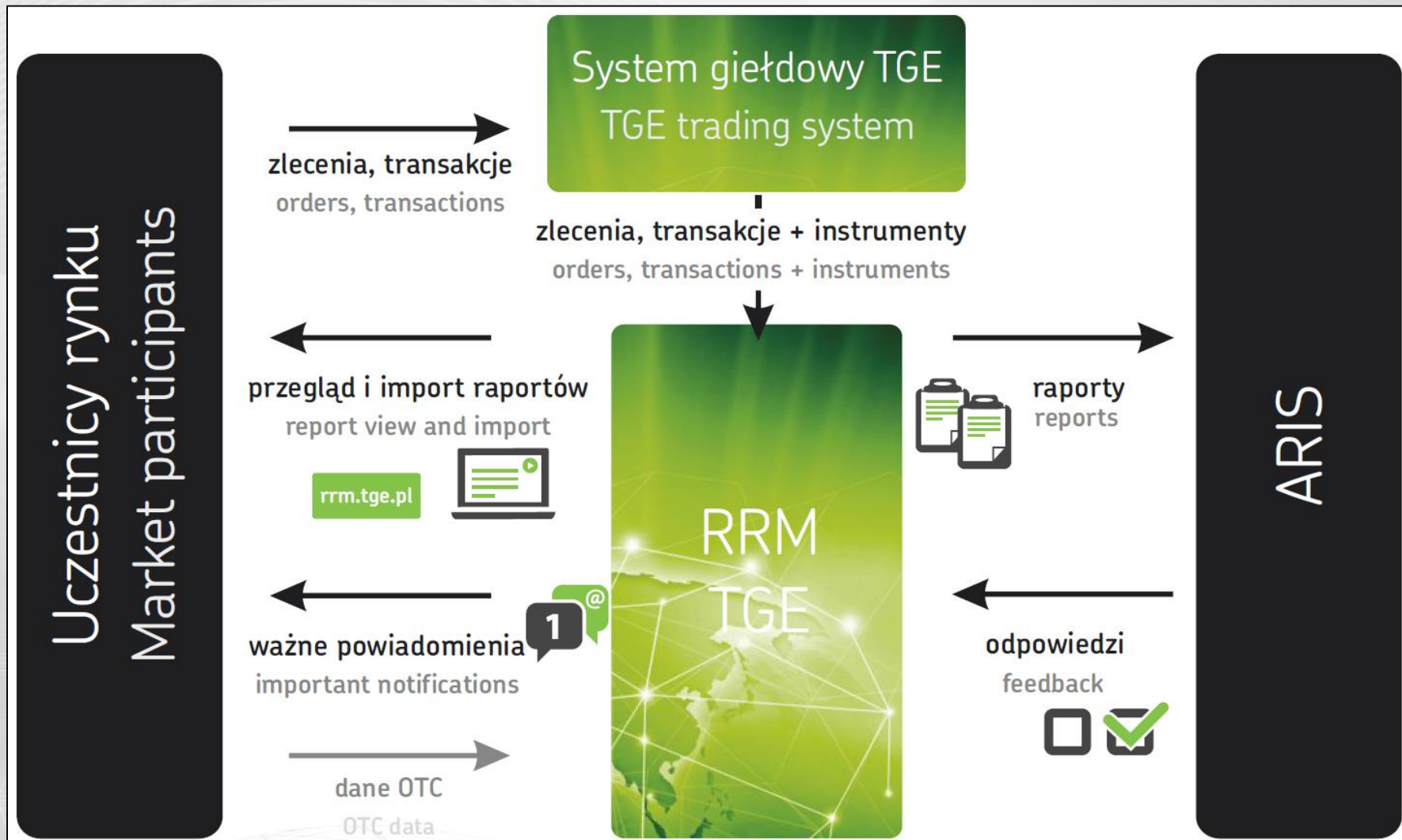
Weryfikowanie kompletności, dokładności i terminowości raportowanych danych



## 5. System informatyczny RRM TGE



# System RRM TGE



# Aplikacja RRM.TGE.PL



INFORMACJE ▾

DOKUMENTY TGE RRM ▾

WAŻNE LINKI ▾

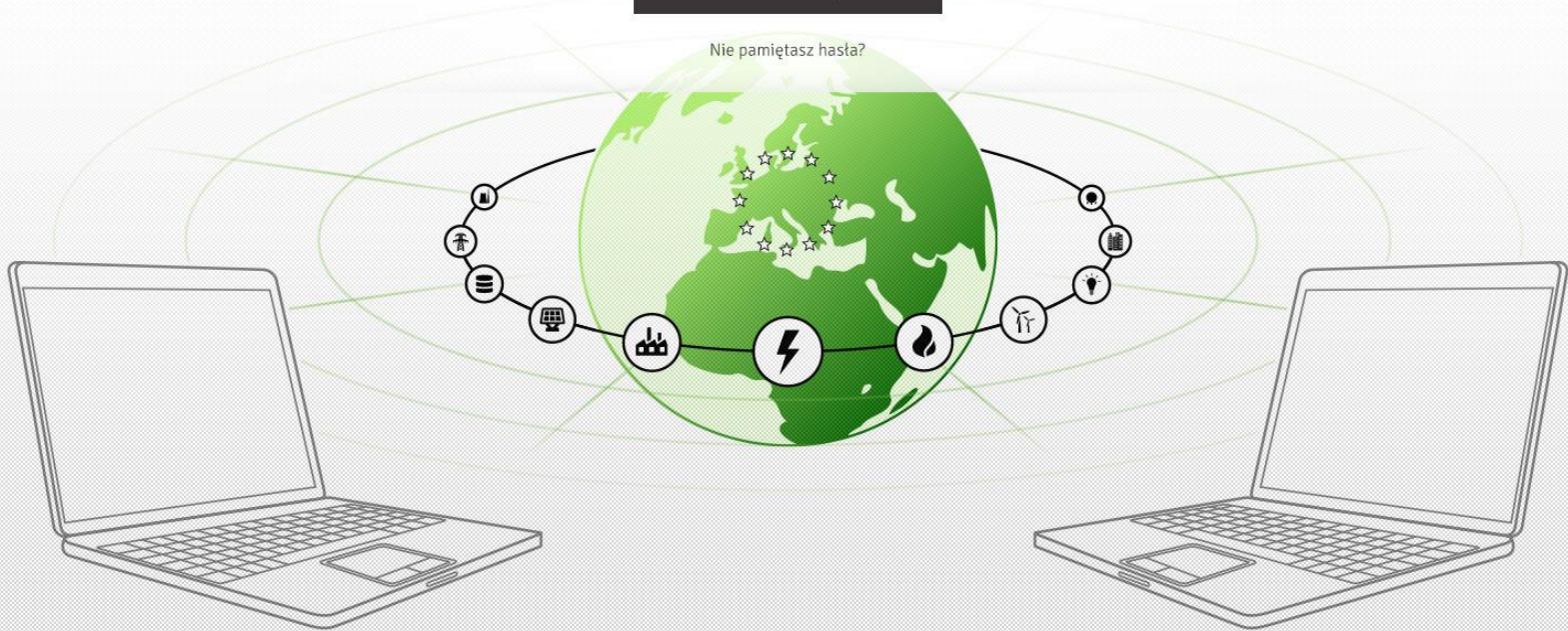
 EN

 PL

## RRM TGE

ZALOGUJ SIĘ

Nie pamiętasz hasła?



# Aplikacja RRM.TGE.PL



INFORMACJE ▾

DOKUMENTY TGE RRM ▲

WAŻNE LINKI ▾

EN

PL

- REGULAMIN RRM TGE
- WNIOSEK - UMOWA
- TABELA OPŁAT

## RRM TGE

ZALOGUJ SIĘ

Nie pamiętasz hasła?

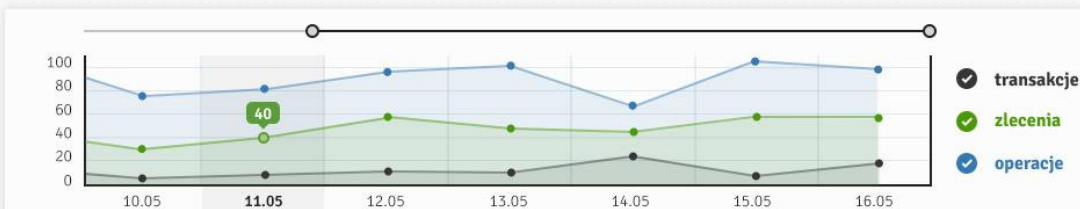


# RRM.TGE.PL – raporty – widok ogólny



🏠 > Raporty - widok ogólny

AKTUALNOŚCI ▾



Dzień raportu od:   Dzień raportu do:   Konto:  Status:

UKRYJ FILTRY ^

FILTRUJ

Status: NOT ACCEPTED ✕

✓	Doba handlowa	Nazwa konta	Nazwa raportu	Transakcje	Unikalne zlecenia	Operacje na zleceniach	Data wysłania raportu	Data odpowiedzi	Status	Podgląd szczegółów	Informacje o błędach
<input type="checkbox"/>	10.04.2015	Konto 1	31012015_REMITTable1_V1_B00001020.PL_1	14	31	73	12.04.2015 09:05:34	12.04.2015 10:43:07	Odrzucony	🔍	🚫
<input checked="" type="checkbox"/>	10.04.2015	Konto 2	31012015_REMITTable1_V1_B00001020.PL_2	8	18	33	12.04.2015 09:05:34	12.04.2015 10:43:07	Zaakceptowany	🔍	
<input type="checkbox"/>	10.04.2015	Konto 3	31012015_REMITTable1_V1_B00001020.PL_3	7	22	32	12.04.2015 09:05:34	12.04.2015 10:43:07	Zaakceptowany	🔍	
<input checked="" type="checkbox"/>	10.04.2015	Konto 4	31012015_REMITTable1_V1_B00001020.PL_4	17	29	67	12.04.2015 09:05:34	12.04.2015 10:43:07	Zaakceptowany	🔍	
<input type="checkbox"/>	10.04.2015	Konto 5	31012015_REMITTable1_V1_B00001020.PL_5	12	32	68	12.04.2015 09:05:34	12.04.2015 10:43:07	Niezaakceptowany	🔍	🚫
<input checked="" type="checkbox"/>	10.04.2015	Konto 6	31012015_REMITTable1_V1_B00001020.PL_6	23	48	84	12.04.2015 09:05:34	12.04.2015 10:43:07	Zaakceptowany	🔍	
<input checked="" type="checkbox"/>	10.04.2015	Konto 7	31012015_REMITTable1_V1_B00001020.PL_7	7	16	33	12.04.2015 09:05:34	12.04.2015 10:43:07	Zaakceptowany	🔍	
<input type="checkbox"/>	10.04.2015	Konto 8	31012015_REMITTable1_V1_B00001020.PL_8	9	23	45	12.04.2015 09:05:34	12.04.2015 10:43:07	Wysłany	🔍	🚫
<input type="checkbox"/>	10.04.2015	Konto 9	31012015_REMITTable1_V1_B00001020.PL_9	9	21	39	12.04.2015 09:05:34	12.04.2015 10:43:07	Zaakceptowany	🔍	
<input type="checkbox"/>	10.04.2015	Konto 10	31012015_REMITTable1_V1_B00001020.PL_10	3	5	12	12.04.2015 09:05:34	12.04.2015 10:43:07	Zaakceptowany	🔍	

EKSPORTUJ DO XML

EKSPORTUJ DO CSV

« Pierwsza < Poprzednia 1 2 3 Następna > Ostatnia »

# RRM.TGE.PL – raporty – szczegóły



🏠 > Raporty - widok szczegółowy

AKTUALNOŚCI ▾

Status:

NIEZAAKCEPTOWANY  
ODRZUCONY  
ZAAKCEPTOWANY

Data raportu od:

Data raportu do:

Trader:

Typ zlecenia:

Warunek zlecenia:

Instrument:

K/S:

Status zlecenia:

Typ zdarzenia:

Typ:

UKRYJ FILTRY ^

POKAŻ TYLKO BŁĘDY

FILTRUJ

K/S: KUPNO ✕

Data od: 01-05-2015 ✕

Data do: 31-05-2015 ✕

✓	Typ	Nazwa konta	Nazwa raportu	Instrument	K/S	ID zlecenia	ID transakcji	Czas zdarzenia	Cena	Wolumen	Jednostka	Wolumen catkowity	Status	Informacje o błędach
<input type="checkbox"/>	Transakcja	Konto 1	31012015_REMITTable1_V1_B00001020.PL_1	RDN_28-05-2015_H18	K		2353-9857	27.05.2015 09:05:34	150	7	MW	7	Odrzucony	🚫
<input checked="" type="checkbox"/>	Transakcja	Konto 2	31012015_REMITTable1_V1_B00001020.PL_2	RDN_28-05-2015_H18	K		2353-9858	27.05.2015 09:05:34	150	2	MW	2	Zaakceptowany	
<input type="checkbox"/>	Transakcja	Konto 3	31012015_REMITTable1_V1_B00001020.PL_3	RDN_28-05-2015_H18	K		2353-9859	27.05.2015 09:05:34	150	1	MW	1	Zaakceptowany	
<input checked="" type="checkbox"/>	Transakcja	Konto 4	31012015_REMITTable1_V1_B00001020.PL_4	RDN_28-05-2015_H18	K		2353-9855	27.05.2015 09:05:34	150	7	MW	7	Zaakceptowany	
<input type="checkbox"/>	Zlecenie	Konto 5	31012015_REMITTable1_V1_B00001020.PL_5	RDN_28-05-2015_H18	K	G.23LKSD89L23		27.05.2015 09:05:34	150	2	MW		Niezaakceptowany	🚫
<input checked="" type="checkbox"/>	Zlecenie	Konto 6	31012015_REMITTable1_V1_B00001020.PL_6	RDN_28-05-2015_H18	K	G.23LKSD89L24		27.05.2015 09:05:34	150	8	MW		Zaakceptowany	
<input checked="" type="checkbox"/>	Zlecenie	Konto 7	31012015_REMITTable1_V1_B00001020.PL_7	RDN_28-05-2015_H18	K	G.23LKSD89L25		27.05.2015 09:05:34	150	7	MW		Zaakceptowany	
<input type="checkbox"/>	Zlecenie	Konto 8	31012015_REMITTable1_V1_B00001020.PL_8	RDN_28-05-2015_H18	K	G.23LKSD89L26		27.05.2015 09:05:34	150	1	MW		Wysłany	🚫
<input type="checkbox"/>	Transakcja	Konto 9	31012015_REMITTable1_V1_B00001020.PL_9	RDN_28-05-2015_H18	K		2353-9854	27.05.2015 09:05:34	150	2	MW	2	Zaakceptowany	
<input type="checkbox"/>	Transakcja	Konto 10	31012015_REMITTable1_V1_B00001020.PL_10	RDN_28-05-2015_H18	K		2353-9853	27.05.2015 09:05:34	150	1	MW	1	Zaakceptowany	

EKSPORTUJ DO XML

EKSPORTUJ DO CSV

⏪ Pierwsza < Poprzednia 1 2 3 Następna > Ostatnia ⏩

# RRM.TGE.PL – opłaty



🏠 > Opłaty

TABELA OPŁAT

12

UKRYJ FILTRY ^

FILTRUJ

Data od:

Data do:



Data od: 05-2015 ✕

Data do: 06-2015 ✕

## Podsumowanie

Rodzaj opłaty	Miesiąc	Naliczona kwota	Podgląd szczegółów
Opłaty jednostkowe transakcyjne	Maj	31,50 zł	
	Czerwiec	31,50 zł	
Łącznie		63,00 zł	

## Szczegóły - Maj 2015

Opłaty jednostkowe transakcyjne

Nazwa portfela	Liczba transakcji	Stawka jednostkowa	Suma
Portfel 1	12	0,25 zł	3,00 zł
Portfel 2	28	0,25 zł	7,00 zł
Portfel 3	46	0,25 zł	11,50 zł
Portfel 4	40	0,25 zł	10,00 zł
Łącznie	126		31,50 zł

EKSPORTUJ DO XML

# RRM.TGE.PL – opłaty



TABELA OPŁAT

UKRYJ FILTRY ^

FILTRUJ

Data do:



Data do: 06-2015 X



Raporty



Szczegóły raportów



Opłaty

## Podsumowanie

Rodzaj opłaty	Miesiąc	Naliczona kwota	Podgląd szczegółów
Opłaty jednostkowe transakcyjne	Maj	31,50 zł	
	Czerwiec	31,50 zł	
Łącznie		63,00 zł	

## Szczegóły - Maj 2015

Opłaty jednostkowe transakcyjne

Nazwa portfela	Liczba transakcji	Stawka jednostkowa	Suma
Portfel 1	12	0,25 zł	3,00 zł
Portfel 2	28	0,25 zł	7,00 zł
Portfel 3	46	0,25 zł	11,50 zł
Portfel 4	40	0,25 zł	10,00 zł
Łącznie	126		31,50 zł

EKSPORTUJ DO XML

# Podsumowanie

## Zachęcamy do:

- Rejestracji w CEREMP
- Złożenia Wniosku o zawarcie umowy
- Testów, poznania systemu już w sierpniu
- Kontaktu na **[rrm@tge.pl](mailto:rrm@tge.pl)**





## VIII FORUM OBROTU 2015

Dziękuję za uwagę

Kontakt

E-mail: [GRZEGORZ.SZPECHT@TGE.PL](mailto:GRZEGORZ.SZPECHT@TGE.PL)

Telefon: 22 341 99 03



TOWAROWA  
GIEŁDA ENERGII S.A.

Grupa Kapitałowa GPW