

Către toate părțile interesate

Subiect: A patra scrisoare deschisă privind calitatea datelor REMIT

Stimate Domn / Stimate Doamnă,

Scopul acestei scrisori este de a facilita legătura cu părțile raportoare pentru a îmbunătăți calitatea datelor raportate în conformitate cu REMIT. Agenția Uniunii Europene pentru Cooperarea Autorităților de Reglementare din Domeniul Energiei ("ACER") continuă să efectueze evaluări periodice privind completitudinea, exactitatea și transmiterea la timp a datelor primite în temeiul Regulamentului (UE) Nr. 1227/2011 privind integritatea și transparența pieței angro de energie (REMIT).

Nivelul actual al calității datelor permite deja ACER să își desfășoare activitățile de monitorizare a pieței printr-un proces automat de examinare a tranzacțiilor cu produse energetice efectuate pe piețele angro europene. În acest scop, ACER a dezvoltat și a calibrat alerte specifice pentru a detecta cazuri de comportament de tranzacționare neobișnuit în ceea ce privește produsele de energie electrică și de gaze naturale. Cu toate acestea, în anumite cazuri, calitatea datelor împiedică ACER și Autoritățile Naționale de Reglementare să evalueze în mod eficient informațiile colectate, ceea ce poate duce la alerte pozitive false.

ACER se angajează să asigure o calitate ridicată a datelor și va continua să dedice eforturi speciale de supraveghere acestui demers pentru a-și dezvolta în continuare capacitățile. A patra Scrisoare Deschisă completează primele trei Scrisori Deschise privind calitatea datelor REMIT, pe care ACER le-a publicat în decursul ultimilor trei ani. ACER are plăcerea să raporteze că cele trei Scrisori Deschise anterioare au fost eficiente și au facilitat îmbunătățirea calității datelor, de asemenea inițiind discuții pentru a îmbunătăți în continuare ghidul de raportare a tranzacțiilor.

Cine ar trebui să citească această scrisoare?

Piețele Organizate (OMP), Participanții la Piață (MP) și Mecanismele de Raportare Înregistrate (RRM) care își asistă clienții la îndeplinirea obligației de raportare a tranzacțiilor conform REMIT.

De ce ar trebui părțile raportoare să citească această scrisoare?

ACER a revizuit datele transmise pentru a evalua completitudinea, exactitatea și transmiterea la timp a acestora.

În conformitate cu articolul 11 alineatul (2) din Regulamentul de punere în aplicare (UE) nr. 1348/2014, persoanele care trebuie să raporteze datele menționate la articolele 6, 8 și 9 din Regulamentul de punere în aplicare sunt responsabile de completitudinea, exactitatea și transmiterea la timp a datelor către ACER.

În urma evaluării calității datelor, în strânsa colaborare cu Autoritățile Naționale de Reglementare (NRA), ACER a detectat câteva probleme frecvente privind calitatea datelor (a se vedea Anexa) prin intermediul evaluărilor sale privind calitatea datelor și, prin urmare, recomandă OMP-urilor, participanților la piață și RRM-urilor să efectueze propriile analize ale datelor REMIT raportate de aceștia până în prezent. Acest lucru le va permite să furnizeze rapoarte exacte în viitor, să corecteze rapoartele incorecte transmise anterior și să furnizeze informații suplimentare atunci când solicită ACER, în conformitate cu articolul 6 (8) din Regulamentul de punere în aplicare.

Ce face ACER și de ce?

ACER examinează datele transmise pentru a ajuta părțile raportoare să asigure că datele raportate sunt în concordanță cu cerințele de raportare¹ REMIT. Această activitate va permite, de asemenea, ACER și Autorităților Naționale de Reglementare (NRA) să fie eficiente în îndeplinirea sarcinilor lor de monitorizare a pieței (articolul 7 din REMIT).

Unde tind să greșescă părțile raportoare?

Erorile tipice includ nerespectarea prevederilor privind completitudinea, transmiterea la timp și exactitatea raportării diferitelor valori ale câmpului, raportarea în mod diferit a evenimentelor similare de către OMP-uri/RRM-uri, interpretarea greșită a raportării evenimentelor ciclului de viață și problemele similare enumerate în această Scrisoare Deschisă și în cele precedente. ACER a stabilit că aparent erorile principale sunt adesea rezultatul problemelor legate de sistemul operațional, în special în situațiile în care înregistrările tranzacțiilor trebuie să treacă printr-o serie de sisteme de management al datelor înainte de a fi în cele din urmă raportate către ARIS. O defecțiune în orice punct al lanțului poate duce la un raport de tranzacții incorect.

Zone cheie pentru îmbunătățire pe baza observațiilor recente:

- Controlul exactității și al completitudinii: RRM-urile terțe părți trebuie să se asigure că datele raportate sunt corecte, așa cum au provenit de la OMP-uri sau de la participanții la piață și că nicio informație nu este pierdută sau modificată în timpul acestui proces de raportare. Este recomandat să se efectueze o verificare periodică prin sondaj. ACER a constatat neconcordanțe atunci când a comparat datele raportate de RRM-uri de tip OMP cu cele raportate de terți RRM.
- RRM-urile trebuie să asigure conformitatea continuă cu articolul 11 (1) și (2) din Regulamentul de punere în aplicare și cu Cerințele pentru Înregistrarea RRM-urilor.
- Participanții la Piață (MP) ar trebui să se asigure că toate informațiile necesare sunt înregistrate în CEREMP și sunt corecte. Înregistrările transmise ale tranzacțiilor pentru raportarea contractelor de transport al energiei electrice și gazelor naturale trebuie să conțină identificatori ai participanților la piață (coduri EIC X) care sunt înregistrați în CEREMP, în caz contrar aceste înregistrări ale tranzacțiilor vor fi respinse în viitor.

¹ Vă rugăm consultați Cerințele RRM (RRM Requirements), Manualul utilizatorului în procesul de raportare a tranzacțiilor (Transaction Reporting User Manual-TRUM), Manualul de proceduri de raportare (MoP on data reporting) și documentele Întrebări Frecvente (FAQ) privind raportarea tranzacțiilor, datele fundamentale și informațiile privilegiate disponibile pe portalul REMIT al Agenției <https://www.acer-remit.eu/portal/home>.

- Părțile raportoare trebuie să se asigure că modificările de reglementare, de afaceri sau de sistem nu conduc la raportarea neconformă a tranzacțiilor. Cele mai bune practici în procedurile de management al schimbărilor depind adesea de buna comunicare între părțile interesate, inclusiv cu ACER.
- Părțile care raportează nu ar trebui să considere conformitatea fișierelor și nerespingerea înregistrărilor prin regulile de validare ARIS ca dovadă suficientă a calității corespunzătoare a datelor. Dacă fișierele sunt compatibile cu standardele tehnice și nu există înregistrări respinse, acest lucru nu înseamnă neapărat că setul de date raportat este complet, exact și/sau transmis în timp util.

La ce se pot aștepta părțile raportoare de la ACER?

ACER poate informa RRM-urile, OMP-urile și NRA-urile relevante cu privire la problemele detectate privind calitatea datelor. RRM-urile și OMP-urile pot primi o comunicare generală și/sau specifică referitoare la problemele detectate, descriind tipul (tipurile) de probleme identificate de ACER în colaborare cu NRA-urile precum și orice acțiuni ce sunt considerate a fi necesare din partea RRM-urilor, OMP-urilor sau a participanților la piață.

Ce așteaptă ACER de la părțile raportoare?

ACER se așteaptă ca părțile raportoare să fie proactive în informarea ACER cu privire la problemele legate de calitatea datelor, precum și să răspundă și să colaboreze cu ACER pentru a clarifica și rezolva în timp util neconcordanțele în raportare detectate. Dacă părțile raportoare stabilesc că au raportat în mod eronat date, fie în baza propriilor evaluări, fie în baza tipurilor comune de probleme de calitate a datelor menționate în Anexa la prezenta scrisoare precum și în Scrisorile Deschise anterioare, ar trebui să-și contacteze RRM-ul pentru a face corecturile necesare. RRM-ul respectiv ar trebui să informeze ACER în consecință.

RRM-urile ar trebui să deschidă rapoarte de incident (contingency reports) cu privire la problemele identificate legate de calitatea datelor în timp util și să se asigure că rapoartele sunt completate cu exactitate și, de asemenea, actualizate atunci când este necesar cu informațiile disponibile legate de incidentul critic și măsurile de urgență luate. În plus, ar trebui să se asigure, de asemenea, că rapoartele de incident sunt închise în timp util după corecțiile necesare și transmiterea datelor. Părțile raportoare ar trebui să fie conștiente de faptul că ACER transmite jurnalul de incident și NRA-urilor.

ACER crede cu tărie că este în interesul părților raportoare să se asigure că orice modificări importante care le-ar putea afecta procesul de raportare a datelor sunt notificate către și coordonate cu ACER în timp util. Acest lucru ar trebui să ajute părțile raportoare să evite orice cheltuieli inutile legate de punerea în aplicare a modificărilor tehnice în procesul lor de raportare a datelor care ar putea fi ulterior corectate în scopul raportării REMIT.

ACER este gata să includă noile dezvoltări ale pieței, cum ar fi introducerea de noi contracte și modalități de tranzacționare, în procesul său de colectare a datelor conform REMIT. Pentru a evita

problemele legate de calitatea datelor în primul rând, părțile raportoare ar trebui să ia legătura *ex ante* cu ACER ori de câte ori o parte raportoare își schimbă modelul de raportare sau introduce noi contracte care ar putea să nu fie menționate în [Pachetul Utilizatorului în procesul de Raportare REMIT](#) existent.

În cazul în care există întrebări cu privire la modul de raportare a înregistrărilor tranzacțiilor REMIT, părțile raportoare ar trebui să contacteze ACER folosind canalele standard, cum ar fi formularul pentru întrebări REMIT ([REMIT Query Form](#)).

În opinia ACER, părțile raportoare care colaborează activ cu ACER în prevenirea și soluționarea problemelor legate de calitatea datelor consolidează respectarea obligației de raportare conform REMIT. Este apreciată o atitudine cooperantă față de îmbunătățirea calității datelor.

Măsuri care urmează să fie luate de ACER:

ACER preferă să rezolve problemele privind calitatea datelor prin cooperare cu părțile raportoare. Cu toate acestea, poate fi inițiată acțiunea de sancționare, dacă este necesar. În mod specific, lipsa de implicare, întâzieri nejustificate ale răspunsului la solicitările ACER, ne-raportarea, continuarea transmiterii datelor de proastă calitate sau retransmiterea repetată a datelor care nu sunt în conformitate cu îndrumările furnizate pot fi considerate nerespectare a obligațiilor de raportare REMIT (Articolele 8 și 9 din REMIT) și/sau nerespectare a Cerințelor pentru RRM-uri. ACER se asigură că NRA-urile relevante sunt informate cu privire la aceste probleme, astfel încât acestea să poată lua măsuri de sancționare.

ACER va continua să efectueze evaluări periodice ale calității datelor pentru a monitoriza calitatea acestora și va informa în mod regulat părțile interesate în această privință. ACER rămâne angajat în crearea de oportunități și practici pentru schimbul de informații, cum ar fi mese rotunde și întâlniri bilaterale, reuniuni ale grupurilor de utilizatori RRM și seminarii web și orice altă activitate care poate ajuta părțile interesate să coopereze activ cu ACER pentru a rezolva problemele privind calitatea datelor REMIT.

Dacă aveți întrebări, nu ezitați să ne contactați la adresa remit@acer.europa.eu.

Cu stimă,

Volker Zuleger
Head of the Market Integrity and
Transparency Department

Anexă: Tipuri comune de probleme privind calitatea datelor

Anexă: Tipuri comune de probleme privind calitatea datelor tranzacțiilor raportate

Această anexă descrie cele mai frecvente și critice tipuri de probleme privind calitatea datelor pe care ACER le-a observat recent. Nu trebuie considerată exhaustivă. Pentru o mai bună înțelegere a modului de a raporta în conformitate cu cerințele REMIT, consultați [Pachetul Utilizatorului în procesul de Raportare REMIT](#) al ACER.

Probleme de raportare a tranzacțiilor referitoare la cuplarea pietelor.

Referință: REMIT Tabel 1

De la introducerea Single Intraday Coupling (SIDC), ACER a analizat datele colectate cu referire la piețele de energie electrică cuplate, care reprezintă dezvoltarea principală a modelului pieței angro europene și o provocare importantă pentru viitor.

În 2019, ACER a evidențiat deja unele neconcordanțe în raportarea datelor procesate de diferite părți raportoare, confirmând astfel necesitatea armonizării în continuare a raportării datelor pentru a atenua, de exemplu, riscul de lipsă de concordanță între cele două părți ale aceleiași tranzacții executate pe o piață cuplată.

Cu referire la problemele specifice, ACER și Autoritățile Naționale de Reglementare au început să coopereze cu părțile implicate pentru a se asigura că toate informațiile relevante necesare pentru realizarea unei monitorizări efective a pieței în conformitate cu articolul 7 din REMIT sunt colectate.

Tot în 2020, ACER așteaptă introducerea armonizării în toate înregistrările SIDC ale tranzacțiilor, inclusiv ordinele de tranzacționare, în ceea ce privește câmpurile din Tabelul 1 Identificatorul Contractului (21) și Denumirea Contractului (22). În plus, ACER cooperează cu părțile SIDC în vederea armonizării câmpurilor din Tabelul 1 Identificatorul Ordinului (13) și Marca de Timp a Tranzacției (30) în lunile următoare, ca o condiție necesară pentru optimizarea analizei cu privire la datele cuplării pieței.

Incompletitudinea și inconsistența seturilor de date ale OMP-urilor.

Referință: REMIT Tabel 1, REMIT Tabel 3, REMIT Tabel 4

ACER a observat incompletitudinea și inconsistența din seturile de date provenite de la anumite OMP-uri. Uneori, datele specifice lipsesc complet, în timp ce altele există neconcordanțe între datele raportate de OMP-uri în calitate de RRM și cele raportate de către terțe RRM-uri. Această constatare pare să confirme ACER că datele care trec prin diferite entități și interfețe înainte de a fi raportate la ACER s-ar putea confrunta cu riscul pierderii de informații sau al modificării neintenționate.

Raportarea inconsistentă a evenimentelor ciclului de viață

Referință: TRUM – Câmpul de date aferent informațiilor privind ciclul de viață, Tabel 1 Câmp de date nr. (58) Tipul de acțiune

Descriere: ACER a observat raportarea inconsistentă a evenimentelor din ciclul de viață al tranzacțiilor. Pentru a oferi asistență suplimentară părților raportoare, ACER a publicat în data de

30 iunie 2020 o îndrumare suplimentară privind raportarea evenimentelor din ciclul de viață, respectiv [Anexa VII la TRUM](#).

Îndrumările furnizate în Anexa VII se bazează pe documentația disponibilă anterior, cum ar fi TRUM, întrebări frecvente privind raportarea tranzacțiilor REMIT, întrebări și răspunsuri despre REMIT, analiza datelor efectuată de ACER, precum și pe numeroase instrucțiuni consolidate furnizate ca răspunsuri la întrebările primite de la participanții la piață, RRM-uri și OMP-uri.

Odată cu Anexa VII, ACER își propune să consolideze și să clarifice în continuare cerințele de raportare a ciclului de viață. Versiunea actuală a ghidului (v1.0) acoperă raportarea evenimentelor ciclului de viață pentru contractele de furnizare a gazului natural și a energiei electrice și poate fi modificată în viitor pentru a oferi îndrumări cu privire la contractele de transport.

Raportarea corectă și în timp util, inclusiv evenimentele din ciclul de viață, reprezintă obligația și responsabilitatea participanților la piață. Piețele organizate ar trebui să ofere un acord de raportare a datelor pentru tranzacțiile executate pe platformele lor. Un astfel de acord de raportare poate include sau nu posibilitatea de a actualiza înregistrările raportate inițial în cazul evenimentelor din ciclul de viață care au loc în afara pieței respective. Participanții la piață ar trebui să poată furniza ACER toate informațiile despre orice modificare a datelor raportate ca urmare a evenimentelor din ciclul de viață.

Toate evenimentele tranzacției care trebuie raportate conform REMIT, de la început, toate etapele duratei de viață a tranzacției și până la actul final al executării sau anulării tranzacției, trebuie raportate cu aceeași diligență pentru a oferi detalii în timp util și exacte cu privire la conținut.

Raportarea inexactă a informațiilor și valorilor în rapoartele contractelor standard și non-standard

Referință: TRUM – Tabel 1 și Tabel 2 Câmpuri de date referitoare la ordin, contract, tranzacție, detalii despre opțiuni, indicele de fixare și profilul de livrare

Descriere: ACER continuă să observe raportarea inexactă a diferitelor câmpuri de date din rapoartele contractelor standard și non-standard. Informații și valori care descriu evenimente de afaceri, cum ar fi prețuri, tipuri de contract, indici, identificarea produsului, ID-uri ale OMP-urilor, marca de timp și data, ID-uri ale tranzacțiilor și ordinelor, valute, sume noționale, cantități totale noționale ale contractelor, volume, unități, profiluri de livrare și altele sunt adesea raportate inexact.

Raportarea inexactă a mărcii de timp a Tranzacției

Referință: TRUM – Tabel 1 Câmp de date nr. (30)

Descriere: ACER a observat că uneori, mărcile de timp ale tranzacțiilor raportate nu reprezintă cu exactitate evenimentul, ci mai degrabă reflectă timpul sistemului IT sau sunt create artificial de către părțile raportoare. Deoarece mărcile de timp exacte sunt esențiale pentru analiza comportamentului manipulativ, cum ar fi layering-ul, ACER se așteaptă ca părțile raportoare să „identifice marca de timp a tranzacției, adică ora la care a avut loc evenimentul raportat”.

Marca de timp a tranzacției raportată ar trebui să reflecte aceeași granularitate de timp ca și cea utilizată în sistemele OMP-urilor. Dacă sistemul unui OMP funcționează în milisecunde, marca de

timp raportată ar trebui să fie din punctul de vedere al granularității în milisekunde. De exemplu, dacă un ordin a fost plasat într-un registru de ordine în data de 08.10.2019 la 14:45:23.123, ar trebui să fie raportată aceeași marcă de timp exactă. Orice rotunjire trebuie evitată.

ACER se așteaptă ca părțile raportoare să se coordoneze cu ACER în timpul implementării oricărei modificări a sistemelor IT și să notifice ACER referitor la orice intenție de implementare a modificărilor privind raportarea datelor cu mult timp în avans pentru a asigura respectarea prevederilor REMIT.

Inexactitatea câmpurilor aferente cantității și valorii raportate atunci când se compară între ele și a profilului de livrare raportat

Referință: TRUM – Tabel 1 și 2 Câmpurile de date referitoare la cantități și valori

Descriere: ACER a observat nepotriviri între câmpuri, în special câmpurile Preț (35), Moneda în care este exprimat prețul (37), Valoare Noțională (38), Monedă Națională (39), Cantitate/Volum (40), Cantitatea Contractuală Noțională Totală (41), Unitatea Cantității (42) pentru câmpurile (40) și (41) și Prețul de exercitare a opțiunii (47).

Deși există un grad ridicat de coerență între tranzacțiile corespunzătoare contractelor standard referitoare la tipul de contract „AU” și „CO” (a se vedea TRUM, câmpul de date nr. (23) Tipul de contract), există loc de îmbunătățire atunci când vine vorba de tranzacții efectuate cu contracte de alte tipuri, deoarece acestea conțin adesea inconsecvențe legate de diferitele stiluri de raportare. Pentru a contracara astfel de probleme în viitor, ACER intenționează să elaboreze în continuare îndrumările legate de raportarea profilurilor de livrare.

Cu toate acestea, participanții la piață, OMP-urile și RRM-urile trebuie să se asigure că datele raportate sunt exacte și că nu se pierd sau modifică informații în procesul de raportare. Este recomandabil să verificați periodic prin sondaj și să aveți la dispoziție controale de precizie.

Definiție incorectă a profilului de livrare

Referință: TRUM – Tabel 1 și 2 Câmpurile de date referitoare la profilul de livrare, în special Intervale de livrare a sarcinii (54)

Descriere: ACER continuă să observe definițiile inexacte ale profilului de livrare. Există îndrumări extinse furnizate cu privire la acest subiect în REMIT Reporting User Package al ACER. Câmpul Intervale de livrare a sarcinii (54) identifică intervalele sarcinii pentru livrarea produsului (gaz natural sau energie electrică) și trebuie exprimat în ora locală la punctul sau zona de livrare. De asemenea, câmpurile Data de începere și de încheiere a livrării (49, 50) ar trebui să corespundă orei locale la punctul sau zona de livrare.

ACER este conștientă de faptul că REMIT XSD permite diverse interpretări ale raportării profilului de livrare. Pentru a armoniza stilurile pe care le-au adoptat anumite RRM-uri, ACER intenționează să elaboreze în continuare îndrumări legate de raportarea profilelor de livrare.

ID-ul Beneficiarului și Capacitatea de tranzacționare a participantului la piață raportor (în continuare Capacitatea de tranzacționare)

Referință: TRUM – Tabel 1 Câmp de date nr. (8) și nr. (10)

Descriere: ACER continuă să observe diferite probleme de raportare cu privire la câmpurile de raportare ID-ul Beneficiarului și Capacitatea de tranzacționare. Trei probleme comune sunt (i) popularea câmpului Capacitatea de tranzacționare cu "P" pentru Principal și, în același timp, popularea câmpului ID Beneficiar, (ii) popularea câmpului ID Beneficiar cu codul participantului care execută tranzacția și (iii) neraportarea ID-ului Beneficiarului atunci când câmpul Capacitatea de tranzacționare este populat cu "A" pentru Agent.

Vă rugăm să rețineți că respectivul câmp, ID-ul Beneficiarului, ar trebui să fie completat doar atunci când participantul la piață acționează în numele unui al treilea participant cunoscut. În acest caz, câmpul Capacitatea de tranzacționare ar trebui să fie completat cu "A" pentru Agent. În toate celelalte cazuri, câmpul ID Beneficiar trebuie lăsat gol, iar câmpul Capacitatea de tranzacționare trebuie să fie populat cu "P" pentru Principal.

Tipul de acțiune "M" (modify) trebuie utilizat în cazul în care raportul original al tranzacției nu are ID-ul beneficiarului completat, dar are câmpul de date nr. (10) Calitatea participantului la piață sau a contrapărții populate cu „A” pentru agent. În acest caz specific, înregistrarea cu tipul de acțiune "M" trebuie să aibă aceeași marcă de timp ca ultima înregistrare raportată cu succes, dat fiind faptul că furnizarea de informații lipsă nu este considerată ca un eveniment de afaceri nou.

Raportarea contractelor spread și swap

Referință: TRUM – Tabel 1

Descriere: ACER continuă să observe problemele legate de calitatea datelor legate de raportarea tipurilor de contracte spread și swap. Aspectele critice se referă în principal la completarea corectă a câmpurilor din Tabelul 1 Tipul de contract (23), Identificatorul conex al tranzacției (32) și Preț (35).

ACER intenționează să elaboreze în continuare îndrumările legate de raportarea acestor tipuri de contracte.

Raportarea la timp a tranzacțiilor

Referință: Articolul 8 din REMIT; Articolul 7 din Regulamentul de Implementare

Descriere: În evaluarea raportării la timp a datelor REMIT, ACER a identificat tranzacții care nu respectă cerințele referitoare la promptitudinea raportării acestora. Tranzacțiile cu produse admise la tranzacționare la OMP-uri sunt supuse obligațiilor de raportare pentru contractele standard și trebuie raportate în termen de o zi D+1, indiferent dacă sunt tranzacționate pe ecran sau prin intermediere vocală. Tranzacțiile referitoare la orice alt produs care nu este un contract standard sunt supuse obligațiilor de raportare pentru contractele nestandardizate și trebuie raportate în termen de o lună D+1.