

La Piattaforma Dati Esterna (PDE)

Adempimenti degli articoli 8.4-8.6 della delibera 115/08

dr. Cosimo Campidoglio
Responsabile Monitoraggio del mercato

Milano, 30 Giugno 2009

- **Gli adempimenti regolatori previsti dal TIMM a carico degli operatori**
- **I contratti a termine**
- **Le quote di capacità disponibile**
- **La PDE**

Le previsioni contenute nel TIMM

- Il 05/08/08 l'AEEG pubblica il Testo integrato del monitoraggio del mercato (TIMM).
 - Il TIMM regola l'esercizio *"da parte di Terna, GME e GSE delle attività strumentali all'esercizio della funzione di monitoraggio del mercato elettrico da parte dell'Autorità"* (articolo 2.1)
 - *"GME svolge le attività di acquisizione, organizzazione, stoccaggio dati per il monitoraggio di cui all'Allegato A, l'attività di condivisione dei medesimi dati con l'Autorità, nonché le attività di elaborazione e analisi di cui all'articolo 5 in quanto attività strumentali all'esercizio della funzione di monitoraggio da parte dell'Autorità"* (articolo 3.1).
 - Il TIMM prevede obblighi informativi a carico degli operatori elettrici e degli utenti del dispacciamento (articolo 8):
 - Relazioni tra operatori (articoli 8.1, 8.2, 8.3)
 - Contratti a termine (articolo 8.4)
 - Quote di capacità disponibile per unità e operatore (articolo 8.6)
- Il 16/03/09 l'AEEG pubblica una nota di chiarimento circa la natura dei contratti a termine di cui all'articolo 8.4
- Il 19/05/09 l'AEEG pubblica la delibera 60/09 che modifica il TIMM. Tra le altre cose:
 - Recepisce la nota del 16/03/09
 - Restringe l'obbligo di cui all'articolo 8.4 ai soli "operatori rilevanti"
 - Trasforma la facoltà di cui all'articolo 8.6 in obbligo

Le previsioni contenute nel TIMM

- Articolo 8.4 modificato
 - “Entro il giorno 15 del mese successivo a quello di negoziazione, gli operatori di mercato **rilevanti** dichiarano a GME, con le modalità dallo stesso definite, le **informazioni rilevanti** relative alle vendite e gli acquisti di **contratti a termine** sull’energia elettrica negoziata nel mercato elettrico conclusi dai medesimi operatori, anche indirettamente tramite qualsiasi tipo di intermediazione.
 - **Qualora fra l’operatore di mercato rilevante e altri operatori di mercato non rilevanti sussistano rapporti di controllo ai sensi dei commi 8.1, 8.2 e 8.3, l’obbligo di cui al presente comma si estende anche a questi ultimi operatori”**

- Articolo 8.6 modificato
 - “Entro il termine di chiusura del MGP, gli operatori di mercato hanno **l’obbligo** di dichiarare a GME, con le modalità dallo stesso definite, le quote di capacità disponibile oraria di ciascuna unità su cui hanno ricevuto delega ad offrire nel MGP dal relativo utente di dispacciamento.
 - In assenza di tale dichiarazione, GME assume valida ai fini del computo degli indici di monitoraggio di cui al presente provvedimento la dichiarazione resa dal medesimo utente del dispacciamento ai sensi dell’articolo 18.3.b della deliberazione 111/06”

Le parti in rosso indicano le modifiche alla delibera 115/08 introdotte dalla delibera 60/09

Il ruolo del GME

In adempimento a quanto previsto dall'articolo 8 del TIMM, GME:

- ha predisposto un'apposita **Piattaforma Dati Esterni (PDE)** per la raccolta dei dati di cui agli articoli 8.4 e 8.6
- il 19/12/08 ha pubblicato sul proprio sito un comunicato – definito sulle indicazioni dell'AEEG – che specifica nel dettaglio le informazioni da inviare sulla PDE
- il 02/04/09 ha pubblicato sul proprio sito un secondo comunicato che specifica nel dettaglio le modalità di invio delle informazioni sulla PDE e le relative tempistiche.
 - Abilitazione alla PDE: 21 aprile 09
 - Avvio prove: 27 aprile 09
 - Avvio comunicazioni ufficiali: 1 giugno 09
- il 27 aprile ha avviato con gli operatori la fase di test della PDE
 - 56 operatori si sono accreditati
 - 22 operatori hanno partecipato alle prove
- il 26/05/09 – a valle della richiesta di diversi operatori e ottenuta l'approvazione dell'AEEG, nonché della pubblicazione della delibera 60/09 dell'AEEG – ha pubblicato sul proprio sito un terzo comunicato che posticipa al 01/10/09 l'avvio operativo della PDE.

- **Gli adempimenti regolatori previsti dal TIMM a carico degli operatori**
- **I contratti a termine**
- **Le quote di capacità disponibile**
- **La PDE**

I soggetti obbligati

- Sono tenuti alla comunicazione dei contratti a termine:
 - Gli operatori elettrici rilevanti , sia in immissione che in prelievo, che abbiano siglato contratti a termine della tipologia indicata dall'AEEG
 - Gli operatori non rilevanti ad essi connessi che abbiano siglato contratti a termine della tipologia indicata dall'AEEG

- Non sono tenuti alla comunicazione dei contratti a termine :
 - Gli operatori elettrici non rilevanti, salvo che abbiano rapporti di controllo con un operatore rilevante ai sensi degli articoli 8.1, 8.2 e 8.3
 - Gli operatori con contratti diversi da quelli identificati dall'AEEG
 - Gli operatori con contratti con controparti istituzionali (GME, GSE, AU, Terna)

- Gli operatori rilevanti senza contratti della tipologia indicata dall'AEEG devono darne comunicazione al GME mediante *email certificata* con *firma digitale del legale rappresentante* inviata all'indirizzo monitoraggio@pec.mercatoelettrico.org

Le informazioni richieste/1

LE CONTROPARTI

- *mittente*
 - codice ETSO (o Partita IVA)*
 - è il primo dei due che sottomette il contratto

- *controparte*
 - codice ETSO (o Partita IVA)*
 - è l'operatore che conferma il contratto

- *parte cedente*
 - codice ETSO (o Partita IVA) *
 - ragione sociale
 - è l'operatore che immette l'energia in rete (o che riceve il pagamento)

- *parte acquirente*
 - codice ETSO (o Partita IVA) *
 - ragione sociale
 - è l'operatore che preleva l'energia dalla rete (o che effettua il pagamento)

- *controparte elettrica*
 - Flag

* Soggetto a verifica

Le informazioni richieste/1

CODICE CONTRATTO

- *Codice alfanumerico univoco assegnato dal mittente **
- Utilizzato per:
 - identificare i singoli contratti, ai fini di modifica, revoca, modifica ex post
 - identificare i contratti abbinati, ai fini di conferma (distinguere quale contratto sia un invio ex novo e quale una semplice conferma)
- La necessità di condividere tra le parti un codice contratto riguarda solo *i contratti OTC tra operatori rilevanti*. Non riguarda i contratti:
 - con controparti istituzionali
 - con controparti "centrali" (contratti trattati su "mercati organizzati")
- Per semplificare la condivisione del codice tra controparti, ciascun operatore potrà visualizzare tutti i contratti di cui sia controparte.
 - Un operatore registra il proprio contratto, scegliendo un codice a piacimento
 - Se il codice è già utilizzato, il sistema lo rifiuta comunicandolo al mittente
 - Il contratto viene automaticamente visualizzato sulla "lista contratti" della controparte e può confermare con un click
 - L'unica necessità di coordinamento riguarda l'identificazione di mittente e controparte: di principio si può decidere che "mittente=cedente"

* Soggetto a verifica

Le informazioni richieste/2

➤ **CARATTERISTICHE DEL CONTRATTO**➤ *Tipologia di contratto:* *

- Standard: contratto trattato su mercato organizzato (es MTE o IDEX)
- OTC organizzato: contratto over-the-counter per il quale i contraenti si sono avvalsi di servizi forniti nell'ambito di un mercato organizzato (es OTC registrato su MTE)
- OTC: contratto over-the-counter diverso dal precedente (es PCE).

➤ *Mercato organizzato* *

- MTE
- IDEX
- TFS
- ...

➤ *Struttura del contratto:* *

- Future: contratto a prezzo fisso regolato cash (es. IDEX)
- Forward: contratto con consegna fisica (es. MTE)
- Swap: contratto differenziale a due vie
- Opzione: contratto differenziale a una via (es. VPP)
- altro

* Soggetto a verifica

Le informazioni richieste/3

CARATTERISTICHE DEL CONTRATTO

- *Descrizione del contratto*
 - voce da compilare solo nel caso di contratti di struttura "altro" indicando la struttura di detto contratto e, nel caso di contratti con struttura mista tra quelle tipizzate, le percentuali dei volumi afferenti a ciascuna di esse;

- *Indicizzato **
 - Flag che assume valore "1" se il contratto è indicizzato e "0" altrimenti
 - E' indicizzato un contratto con prezzo a termine variabile
 - Oltre alla comunicazione ex ante, è prevista anche la comunicazione ex post
 - La comunicazione ex post può modificare solo il campo "prezzo"
 - I valori ex ante riflettono la miglior stima del valore futuro delle variabili all'invio

- *Indicizzazione*
 - descrizione della formula di indicizzazione
 - da compilare solo con riferimento ai contratti il cui prezzo di esercizio sia oggetto di qualche forma di indicizzazione

* Soggetto a verifica

Le informazioni richieste/3

CARATTERISTICHE DEL CONTRATTO

- *Flessibile* *
 - Flag che assume valore "1" se il contratto è flessibile e "0" altrimenti
 - E' flessibile un contratto con clausole di flessibilità sui volumi o la cui durata è prorogabile/accorciabile
 - Oltre alla comunicazione ex ante, è prevista anche la comunicazione ex post
 - La comunicazione ex post può modificare i valori dei campi "quantità" e "prezzo" o allungarne/accorciarne il profilo
 - I valori ex ante riflettono la miglior stima del valore futuro delle variabili all'invio

- *Flessibilità*
 - descrizione del tipo di opzionalità
 - da compilare solo con riferimento ai contratti con campo "flessibile" pari a 1

* Soggetto a verifica

Le informazioni richieste/4

DATI DEL CONTRATTO

- *data di stipula del contratto**
- *data di esecuzione**
- *ora di esecuzione **
- *prezzo di riferimento: (Pzona, Pun, Altro)**
- *prezzo a termine fissato ex ante nel contratto**
- *prezzo a termine calcolato contrattualmente ex post: valido solo per contratti indicizzati o flessibili**
- *premio indicato nel contratto: da indicare nel caso di opzioni**
- *quantità oraria pattuita ex ante nel contratto**
- *quantità oraria esercitata ex post: valido solo per contratti flessibili;**

* Soggetto a verifica

Tempistiche

DATI DEL CONTRATTO

- I contratti devono essere comunicati entro il giorno 15 del mese successivo al mese di stipula (articolo 8.4)
 - I dati (P,Q) devono essere comunicati per l'intero profilo del contratto
 - I dati (P,Q) ex ante devono essere comunicati per tutti i contratti, entro il 15 del mese successivo al mese di stipula
 - I dati (P,Q) ex post devono essere comunicati solo per i contratti indicizzati, entro il 15 del mese successivo al mese di esercizio
- Su richiesta dell'AEEG, devono essere comunicati anche i contratti precedentemente stipulati, con periodo di esercizio nel 2009 o successivo
 - Le comunicazioni dovranno avvenire a partire dal 1 ottobre 2009
 - Dal 1 al 31 ottobre dovranno e potranno essere comunicati i contratti pregressi relativi al 2009 e successivi (in qualunque momento siano registrati), nonché i relativi aggiornamenti ex post
 - Dal 1 novembre entro il 15 di ogni mese dovranno e potranno essere registrati solo i contratti stipulati nel mese precedente e/o gli aggiornamenti ex post dei contratti indicizzati relativi al mese precedente

Tempistiche

ESEMPI: Il 30 settembre 2009 viene siglato un contratto annuale per il 2010

- Future/Forward non indicizzato (p,q fissi)
 - entro il 15 ottobre 2009, registrare il contratto indicando le 8760 ore
- Forward indicizzato (p variabile)
 - entro il 15 ottobre 2009, registrare il contratto indicando le 8760 ore
 - entro il 15 febbraio 2010 registrare l'aggiornamento per gennaio 2010, indicando le 744 ore
 - ...e via di seguito
- Forward flessibile prorogato al 31/12/10 (q e profilo variabili)
 - entro il 15 ottobre 2009, registrare il contratto indicando le 8760 ore
 - entro il 15 febbraio 2010 registrare l'aggiornamento per gennaio 2010, indicando le 744 ore
 - entro il 15 febbraio 2011 registrare la proroga per il 2011, indicando le ulteriori 8760 ore
- Forward flessibile rescisso al 31/10/10 (q e profilo variabili)
 - entro il 15 ottobre 2009, registrare il contratto indicando le 8760 ore
 - entro il 15 febbraio 2010 registrare l'aggiornamento per gennaio 2010, indicando le 744 ore
 - entro il 15 novembre 2010 registrare la rescissione, indicando le ulteriori 1464 ore "a zero"
- Per le opzioni non è più previsto invio ex post

Controlli

LE INFORMAZIONI ...

a) ESSENZIALI

1. Codice ETSO mittente
2. Codice ETSO controparte
3. Codice ETSO cedente
4. Codice ETSO acquirente
5. Controparte elettrica
6. Codice contratto
7. Data di stipula del contratto
8. Tipologia contratto
9. Struttura contratto
10. Indicizzato
11. Flessibile
12. Prezzo di riferimento
13. Data/ora di esercizio
14. Prezzo/Quantità (ex ante/ex post)
15. Premio

b) DESCRITTIVE

14. Ragione sociale (mitt,contr, ced,acq)
15. Mercato organizzato
16. Descrizione contratto (essenziale se la Struttura contratto è "Altro")
17. Indicizzazione
18. Flessibilità
19. Descrizione Prezzo di riferimento (essenziale se il Prezzo di riferimento è "Altro")

- *Le informazioni descrittive non sono soggette a controllo*

IL CONTROLLO

a) ALLA COMUNICAZIONE

1. Correttezza
2. Correttezza, diverso da 1
3. Correttezza, diverso da 4
4. Correttezza, diverso da 3
5. Formato
6. Univocità
7. Formato (YYYYMMDD), anteriore a gate closure
8. Formato (Enum)
9. Formato (Enum)
10. Formato (0/1)
11. Formato (0/1)
12. Formato (Enum)
13. Formati (Data: YYYYMMDD; Ora: Num), ora legale
14. Formati (Decimal rispettivamente a 2 e 3 cifre)
15. Formati (Decimal rispettivamente a 2)

b) ALLA MODIFICA

Coincidenza delle informazioni 1,2,3,4,5,6

c) ALLA REVOCA

Coincidenza delle informazioni 1,6

d) ALLA CONFERMA ex ante (solo nel caso di invio)

Coincidenza delle informazioni da 1 a 15

e) ALL'AGGIORNAMENTO (comunicazione ex post)

Se indicizzato: coincidenza informazioni 6,13 e verifica della gate closure

Se flessibile: coincidenza informazioni 6 e verifica della gate closure

f) ALLA CONFERMA ex post (solo nel caso di invio)

Coincidenza delle informazioni 6,13,14 e verifica della gate closure

- **Gli adempimenti regolatori previsti dal TIMM a carico degli operatori**
- **I contratti a termine**
- **Le quote di capacità disponibile**
- **La PDE**

I soggetti obbligati

- Sono tenuti alla comunicazione delle quote capacità disponibile
 - tutti gli operatori con delega su unità di produzione

- Non sono tenuti alla comunicazione delle quote capacità disponibile
 - Tutti gli operatori relativamente alle deleghe su unità di consumo

- L'obbligo può essere assolto senza invii di dati per:
 - gli operatori con quote stabilmente pari alle quote "alfa" già comunicate sulla PCE
 - tutti gli operatori relativamente alle deleghe su unità di produzione virtuali estere, cui verrà assegnato di default una quota di capacità pari a 1

Informazioni richieste, tempistiche, controlli

- Informazioni:
 - Data*
 - Ora*
 - Codice unità*
 - quota oraria di capacità disponibile per singola unità*

- Tempistica
 - giornalmente entro la chiusura del MGP
 - In caso di mancata comunicazione, viene utilizzato l'ultimo dato valido disponibile
 - In assenza di un qualsiasi dato, viene utilizzata la quota "alfa" già comunicata sulla PCE e, in sua assenza viene assegnato tutto all'UdD

- Controlli
 - La quota è un numero compreso tra 0 e 1
 - La somma delle quote riferite a una stessa unità e una stessa ora è pari a 1
 - In caso contrario viene utilizzato l'ultimo dato valido disponibile per tutti i mittenti

* Soggetto a verifica

- **Gli adempimenti regolatori previsti dal TIMM a carico degli operatori**
- **I contratti a termine**
- **Le quote di capacità disponibile**
- **La PDE**

Abilitazione

- L'accREDITamento avviene inviando i seguenti documenti alla casella di posta certificata monitoraggio@pec.mercatoelettrico.org mediante e-mail certificata con firma digitale del legale rappresentante :
 - nominativo e profilo degli utenti
 - procura del legale rappresentante
 - copia di un documento di riconoscimento del legale rappresentante
- Sono previste 4 profili-utente
 - User: accesso, navigazione e invio dei contratti
 - Viewer: accesso e navigazione della piattaforma, ma privo dei diritti di invio
 - Supervisor (solo GME): supervisione della piattaforma (solo lettura)
 - Administrator (solo GME): gestione della piattaforma (lettura e scrittura)
- Pervenuta la richiesta secondo la procedura prestabilita, ciascun utente riceverà le credenziali di accesso alla piattaforma (user e password modificabile), attraverso le quali potrà operare sulla PDE in funzione dei diritti previsti dal suo profilo.

Funzionalità

La PDE è accessibile su connessione sicura all'indirizzo <https://pde.ipex.it>

Dispone di un Menù di navigazione organizzato in 4 sezioni:

- **Anagrafica**, nella quale sono disponibili:
 - "Operatori": elenco degli Operatori elettrici con il rispettivo Codice ETSO
 - "Utenti": lista degli utenti registrati, dei profili associati a ciascuno di essi e delle società per cui questi ultimi risultano abilitati ad operare sulla PDE
 - "Cambio Password": è possibile modificare la password ricevuta di default dal GME

- **Contratti**, la sezione di reportistica in cui è possibile:
 - "Lista Contratti": visionare, revocare, esportare i contratti sottomessi alla PDE
 - "Conferma Contratti": confermare i contratti sottomessi alla PDE
 - "Sintesi Contratti": ottenere informazioni riepilogative sullo stato dei contratti in cui l'Operatore risulta controparte

- **QuoteCapacità**
 - visualizzazione delle quote di capacità disponibile oraria comunicate dall'Operatore per ciascuna unità su cui ha ricevuto delega

- **Gestione File**
 - "Upload": caricamento manuale dei dati da comunicare
 - "Messaggi": ricezione dei messaggi restituiti dal sistema

Gli utenti accreditati presso più società avranno la possibilità di accedere ai dati e alle informazioni di tutte le società per cui risultano abilitati ad operare (dimostrazione pratica).

Comunicazione dei dati

- I dati da comunicare devono essere inviati attraverso file xml, costruiti sulla base delle specifiche riportate nell'Implementation Guide pubblicata sulla piattaforma e sul sito istituzionale del GME all'indirizzo <http://www.mercatoelettrico.org/It/Statistiche/Monitoraggio/PDE.aspx>
- L'invio dei dati può essere effettuato sia tramite "upload" manuale da pagina web, sia attraverso web services disponibili all'indirizzo <https://provepde.ipex.it/PdeWebService/pdeservice.asmx>
- L'esito dell'invio viene comunicato dalla piattaforma nelle seguenti modalità:
 - in forma sintetica e solo nella sessione corrente, attraverso le informazioni riportate nell'Area di notifica inferiore del portale;
 - nella sezione "Messaggi" del Menù di navigazione, attraverso le FA di dettaglio restituite dal sistema. Queste ultime evidenziano lo stato dell'avvenuta transazione, certificando il corretto caricamento del file sottomesso o, in alternativa, segnalando la motivazione associata al suo rifiuto.

Controlli automatici

La PDE sottopone il file inviato a 2 tipi di controlli:

1) *Controlli di validità formale*

1a) il file xml deve essere costruito secondo le specifiche previste nell'Implementation Guide

1b) l'Operatore loggato al sistema e mittente del file deve corrispondere all'Operatore mittente indicato nel codice xml

Nel caso in cui il file non superi controlli di **tipo 1** il file viene *respinto* e posto in stato **"ERR"**.

Il sistema restituisce le seguenti FA:

1a) Error Code="M01": il messaggio non è un formato xml, oppure è un formato xml non supportato. Il campo "Description" fornisce diverse indicazioni relative all'incongruenza formale rilevata.

1b) Error Code="MSG01" Description="Mittente non coincidente con Sender del messaggio"

2) *Controlli di congruità*

- il file, formalmente corretto, non deve presentare incongruità (operatore mittente non abilitato, mittente non coincidente né con parte cedente né con parte acquirente, rispetto della gate closure,...)*

➤ Nel caso in cui il file non superi controlli di **tipo 2** il file viene *respinto* e posto in stato **"OUT"**.*

* per la lista completa delle incongruità e delle FA associate si rimanda al Manuale Utente

GRAZIE PER L'ATTENZIONE

Ulteriori domande o suggerimenti possono essere inviate ai seguenti riferimenti:

monitoraggio@mercatoelettrico.org

GME – Gestore del mercato elettrico
Viale Pilsudski 92, 00194, Rome
monitoraggio@mercatoelettrico.org