

INSTRUCCIÓN 2021/04– REGISTRO DE TRANSACCIONES OTC

28 de julio de 2022

De conformidad con lo establecido en el punto 6.2 “Detalles operativos del registro de Transacciones OTC” del Anexo I: Reglas específicas de MIBGAS Derivatives plazo, por la presente Instrucción de Mercado se procede a la comunicación de los pasos a seguir, por parte de un Bróker o un Agente, para el registro de Transacciones OTC en MIBGAS Derivatives, así como desarrollar los detalles operativos del registro de estas transacciones.

1. ALTA EN EL SERVICIO

1.1 REQUISITOS

Todos los Agentes dados de alta en MIBGAS Derivatives Plazo podrán registrar transacciones OTC a través de la Plataforma de Registro y Consultas sin necesidad de proceder a la firma de ningún documento adicional; para ello, deberán utilizar un certificado electrónico emitido por MIBGAS con perfil de “Actualización” en la Plataforma de Negociación.

En el caso de que la transacción vaya a ser registrada a través de una agencia de intermediación (bróker) dicha entidad deberá, de manera previa, haber suscrito el acuerdo de registro de intermediario de operaciones bilaterales, en virtud del cual se le permita adquirir la condición de bróker autorizado en la plataforma de MIBGAS Derivatives. Así mismo, el Agente deberá notificar a través del modelo puesto a disposición por MIBGAS Derivatives (Declaración de Brókeres Autorizados), la identificación de aquellos brókeres a los que autoriza para registrar operaciones OTC en su nombre.

En este último caso, la documentación física deberá ser enviada a la siguiente dirección:

- › MIBGAS S.A.
- › Att: Alta de Agentes
- › C/Alfonso XI, 6, 5ª planta
- › 28014 Madrid

2. ENVÍO DE SOLICITUD DE REGISTRO DE TRANSACCIÓN OTC

Existen tres formas de enviar una solicitud de registro de transacción OTC:

- **Por Pantalla:** a través de la **Plataforma de Registro y Consultas** se debe rellenar un formulario web con toda la información de la transacción OTC.
- **Mediante un fichero CSV:** en la **Plataforma de Registro y Consulta** se debe subir un fichero con formato determinado que incluya toda la información de la transacción OTC.
- **Por email y teléfono:** enviando un email a otc@mibgas con la información del OTC en el texto, con el mismo detalle que el fichero y la pantalla anteriores.

En caso de que la solicitud sea enviada por un **Agente**, la información deberá ser confirmada por su contraparte antes de que la Transacción sea registrada; sin embargo, si es un **Bróker** el que envía la

solicitud, éste será el único responsable de la exactitud y veracidad de la información sin que sea requerida ninguna confirmación previa o adicional, para proceder al registro de la Transacción.

Tras enviar una solicitud nueva, bien sea por email o a través de la Plataforma, se solicita que el Bróker o Agente que la ha enviado se ponga en contacto telefónicamente con MIBGAS Derivatives para iniciar la tramitación de la solicitud (+34 91 2682601/+34 91 6598960).

El registro de transacciones OTC, tanto bilaterales como intermediadas, se permite desde el inicio de la Sesión de Negociación de estos productos hasta las 18:30 (CET).

2.1 INFORMACIÓN NECESARIA

Para registrar una Transacción OTC se deben definir los siguientes campos:

- **Código** de producto¹
- **Cantidad:** N° sin decimales (MWh/día)
- **Precio:** N° de hasta tres decimales, utilizando el punto como separador (€/MWh)
- **Bróker:** Código EIC del Bróker (opcional)
- **Agente Comprador:** Código EIC del Agente comprador
- **Trader del Agente Comprador:** Nombre del trader del Agente comprador
- **Agente Vendedor:** Código EIC del Agente vendedor
- **Trader del Agente Vendedor:** Nombre del trader del Agente vendedor
- **Identificador de quien ha sido el agresor:** “C” (si ha sido el Agente comprador) o “V” (si ha sido el Agente vendedor).

El Agente o bróker deberá incluir estos campos en el fichero a subir a la plataforma, introducirlos en el formulario por pantalla o aportarlos directamente a MIBGAS Derivatives por email.

2.2 ENVÍO POR PANTALLA

Para enviar una solicitud a través del formulario web en la [Plataforma de Registro y Consultas](#), se debe acceder a la consulta de *Negociación del agente > Registro de transacciones OTC > Registro de Transacciones OTC por pantalla*.

En esta pantalla aparece un formulario web que contiene los campos necesarios para el registro del OTC. Deben completarse introduciendo el valor correspondiente, o seleccionando un valor entre los disponibles de cada desplegable.

¹ Pueden consultar los códigos de los productos en negociación en cada sesión de negociación desde la [Plataforma de Registro y Consultas](#): *Información pública > Sesiones de negociación > Sesiones activas*

2.3 ENVIO A TRAVÉS DE UN FICHERO CSV

Para enviar una solicitud mediante un fichero CSV a través de la [Plataforma de Registro y Consultas](#), se debe acceder a la consulta de *Negociación del agente > Registro de transacciones OTC > Registro de Transacciones OTC por fichero*.

En esta pantalla se permite subir un fichero en formato CSV con la información solicitada para el registro de Transacciones OTC. Un mismo fichero puede contener varias Transacciones.

En el siguiente enlace se encuentra disponible un fichero CSV a modo de ejemplo que se puede descargar y utilizar como plantilla para subir a la plataforma. Les recomendamos que para su edición utilicen un editor de textos.

www.mibgas.es/sites/default/files/ejemplofichero csv_registrootc.csv

2.4 VALIDACIONES Y REGISTRO DE TRANSACCIONES OTC

Si la solicitud se envía a través del formulario **por pantalla**, se realizarán validaciones sintácticas sobre los campos completados manualmente (longitudes y formatos).

Si la solicitud se envía **a través de un fichero CSV**, en primer lugar, se realizará la validación sintáctica de la estructura del fichero (número de campos de cada línea, longitudes y formatos de cada campo). En caso de error en el fichero CSV, se rechazará el fichero completo mostrando un mensaje de error describiendo el problema y ninguna de las Transacciones contenidas en el fichero se incorporarán al sistema para su posterior registro.

Posteriormente, tanto a través del formulario o del fichero CSV, si se pasa la validación sintáctica, se aplicarán las validaciones recogidas en las Reglas de MIBGAS Derivatives sobre cada una de las Transacciones de forma individual.

Si la solicitud es enviada **por email**, MIBGAS revisará la información aportada y en caso de errores contactará con el solicitante para definir correctamente todos los valores necesarios para el registro de la Transacción OTC.

Si la solicitud ha sido enviada **por un Agente**, bien por email o a través de la Plataforma, las Transacciones que pasen las validaciones se darán de alta en el sistema en estado **“Pendiente”**. Posteriormente cuando el Operador del Mercado reciba la confirmación de la contraparte y de la cámara de compensación actualizará el estado de la Transacción a **“Confirmado”** y quedará registrada.

Si la solicitud es enviada **por un bróker**, tras pasar las validaciones anteriores y la confirmación de la cámara, las Transacciones se darán de alta en el sistema directamente en estado **“Confirmado”**.

Al dar de alta una Transacción en estado “Pendiente” y/o “Confirmado” se enviará un email de aviso a todas las partes involucradas².

Adicionalmente,

- si es un Bróker el que envía la solicitud se comprobará que haya sido autorizado³ previamente por los Agentes participantes de cada Transacción.
- si el envío lo realiza uno de los Agentes participantes en la Transacción, la contraparte, a través de un usuario que disponga de un certificado con permiso de actualización en la Plataforma de Negociación, deberá confirmar que todos los detalles de la Transacción son correctos enviando un email a trading@mibgas.es.

Desde la [Plataforma de Registro y Consultas](#), se puede consultar la información y el estado de todas las Transacciones OTC dadas de alta: *Negociación del agente > Transacciones y posición neta > Transacciones OTC*.

2.5 INTERCAMBIO DE INFORMACIÓN CON OMICLEAR

MIBGAS Derivatives enviará a OMIClear la información de cada Transacción OTC en el momento de registrarla, es decir, antes de cambiar su estado a “Confirmado”. Una vez comunicada y asumida por la ECC, ésta devendrá en contraparte del vendedor y del comprador de la Transacción OTC, estando la Transacción OTC desde ese momento sujeta a los procedimientos de compensación y liquidación de la ECC.

3. ENVÍO DE SOLICITUD DE CANCELACIÓN DE TRANSACCIÓN OTC

Para solicitar la cancelación de una Transacción previamente dada de alta en la Plataforma de Registro y Consultas, independientemente de que su estado sea “Confirmado” o “Pendiente”, se debe enviar un email a otc@mibgas.es informando del código de la Transacción que se quiere anular. Adicionalmente es necesario comunicarlo a MIBGAS Derivatives por teléfono.

En caso de que la Transacción haya sido enviada por un Agente, sin intermediación de un Bróker, será necesario que ambas contrapartes, a través de un usuario que disponga de un certificado con permiso de actualización en la Plataforma de Negociación, envíen un email solicitando la cancelación de la Transacción.

² El email se enviará a la persona de contacto de MIBGAS Derivatives y al contacto general que cada Agente/Bróker tenga dados de alta en la Plataforma de Registro y Consultas. Se pueden modificar estas direcciones accediendo a: *Datos de participantes > Modificación de datos de referencia > Personas de contacto*.

³ Los Brókeres sólo podrán registrar Transacciones OTC de aquellos Agentes de MIBGAS Derivatives Plazo que les hayan autorizado a tal efecto, mediante el envío la Declaración de Brókeres Autorizados.

De forma general, sólo se podrán enviar solicitudes de cancelación de Transacciones OTC antes del final de la Sesión de Negociación.

4. FACTURACIÓN DEL SERVICIO Y TARIFAS

MIBGAS Derivatives emitirá una factura con carácter mensual por el importe de esta cuota, que tendrá un coste variable, en función del volumen y del tipo de producto negociado por el Agente.

La tarifa que aplica a este servicio será la tarifa de negociación que está detallada en la Instrucción de Tarifas correspondiente publicada en el web público de MIBGAS Derivatives.

5. ASISTENCIA TELEFÓNICA Y DATOS DE CONTACTO DE MIBGAS DERIVATIVES

Para cualquier duda, aclaración o cuestión relacionada con la plataforma o con el proceso de registro y/o cancelación de Transacciones OTC se puede poner en contacto con el personal de MIBGAS Derivatives:

- » Correo electrónico: otc@mibgas.es
- » Teléfono principal: +34 91 6598960
- » Teléfono secundario: +34 91 2682601