

INSTRUCCIÓN 2019/01 – REGISTRO DE TRANSACCIONES OTC

08 de enero de 2019

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.

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

1.2 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.

2. ENVÍO DE SOLICITUD DE REGISTRO DE TRANSACCIÓN OTC

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.

Las solicitudes deben enviarse a través de: [Plataforma de Registro y Consultas](#), consulta de *Resultados > Transacciones OTC > Registro de Transacciones OTC*.

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

Solo se permite el registro de transacciones OTC, tanto bilaterales como intermediadas, mientras la Sesión de Negociación de estos productos está abierta.

MIBGAS Derivatives no ofrece el servicio de reporte REMIT de estas Transacciones.

2.1 FICHERO CSV

El fichero CSV debe contener los siguientes campos para cada Transacción OTC que se quiera registrar. Un mismo fichero puede contener varias Transacciones:

- **Código** de producto¹
- **Cantidad:** N° de hasta dos decimales, utilizando el punto como separador (MWh/día)
- **Precio:** N° de hasta dos 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).

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.

<http://www.mibgasderivatives.es/es/blog/reglas>

2.2 VALIDACIONES Y REGISTRO DE TRANSACCIONES OTC

En primer lugar, se realizará la validación sintáctica de la estructura del fichero (n° campos de cada línea, longitudes y formatos de cada campo). En caso de error 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.

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

Si se pasa la validación sintáctica del fichero, se aplicarán las validaciones recogidas en las Reglas de MIBGAS Derivatives sobre cada una de las Transacciones de forma individual. Las Transacciones que pasen las validaciones se darán de alta en el sistema en estado “Pendiente” asignándoles un código de Transacción para posteriormente ser registradas por el Operador del Mercado.

Al dar de alta una Transacción en estado “Pendiente” se enviará un email de aviso a todas las partes involucradas². Tras recibir este email de aviso, se solicita que el Bróker o Agente que ha subido el fichero a la plataforma se ponga en contacto telefónicamente con MIBGAS Derivatives para iniciar la tramitación de la solicitud (+34 91 2682601/+34 91 6598960).

Adicionalmente,

- si es un Bróker el que envía el fichero CSV se comprobará que haya sido autorizado³ previamente por los Agentes participantes de cada Transacción.
- si el envío del fichero 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.

Una vez pasadas todas las validaciones anteriores, el Operador del Mercado actualizará el estado de la Transacción a “Confirmado” y quedará registrada. En este momento se enviará otro email de aviso a las partes involucradas.

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

2.3 INTERCAMBIO DE INFORMACIÓN CON OMICLEAR

MIBGAS Derivatives enviará a OMIClear la información de cada Transacción OTC en el momento de registrarla, es decir, tras 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

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 participante > 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.

email a trading@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.

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

4. 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: trading@mibgas.es
- » Teléfono principal: +34 91 6598960
- » Teléfono secundario: +34 91 2682601