

OMIClear, C.C., S.A. – Câmara de Compensação e Contraparte Central (CCP) de Mercados de Derivados de Energia

Abertura de candidaturas para admissão de colaborador no Departamento de Compensação

Lisboa, Agosto de 2020

A OMIClear procura reforçar a sua equipa do Departamento de Compensação, o qual abrange actividades de compensação, liquidação, gestão e monitorização do risco, relacionadas com o registo das transacções em contratos de derivados de energia provenientes de mercados organizados para os quais a OMIClear presta serviços de Contraparte Central (CCP).

1. Sobre o grupo OMI e a OMIClear.

O grupo OMI (Operador do Mercado Ibérico) têm com função principal a gestão de mercados energéticos na Península Ibérica (www.grupoomi.eu/pt).

O grupo OMI é um grupo composto principalmente pelo OMIE (Operador del Mercado Ibérico de Electricidad – Polo Español) e o OMIP - Pólo Português, S.G.M.R., S.A. e a OMIClear C.C., S.A..

O OMIE actua como operador do mercado de curto prazo (mercado spot) de electricidade em Madrid e o OMIP como operador do mercado de derivados, quer de electricidade, quer de gás natural, estando sediado em Lisboa.

O Grupo OMI têm sido designado como Gestor Integrado de Garantias do Sistema Eléctrico Nacional (SEN), a través da empresa OMIP S.A. sediada em Lisboa..

A OMIClear, C.C., S.A. é a Contraparte Central em operações de derivados de electricidade e de gás natural e está sediada em Lisboa. A OMIClear iniciou as suas operações em Julho de 2006. A OMIClear é uma Câmara de Compensação com funções de Contraparte Central (CCP) autorizada pela CMVM ao abrigo do disposto no Regulamento Europeu 648/2012 (*European Market Infrastructure Regulation, EMIR*), sendo responsável pelo registo de transacções de contratos de derivados, compensação das posições resultantes dessas transacções, gestão do risco e cálculo de margens para cobertura da exposição dos participantes e liquidação financeira de tais contratos (actualmente derivados de electricidade e de gás natural, quer negociados em mercados organizados, quer registados como operações bilaterais com ou sem intermediação de *brokers* (“OTC” – *Over-The-Counter*)).

Como CCP, as actividades principais da OMIClear consistem no registo, compensação e liquidação das transacções realizadas ou registadas nos mercados que lhe estão conectados, nomeadamente o mercado OMIP (desde Julho 2006, com início nos contratos de derivados de electricidade e estendendo mais tarde aos contratos de derivados de gás natural) e os mercados MIBGAS Derivatives e MIBGAS (exclusivamente para contratos de derivados de gás natural de curto prazo, médio e longo prazo).

A actividade da OMIClear iniciou-se em Julho de 2006 e actualmente conta com mais de 80 Agentes de Registo (isto é, participantes que actuam como membros negociadores nos mercados organizados acima referidos), provenientes de diferentes países (cerca de 70% da Península Ibérica e os restantes do resto da Europa).

Para obter mais informações, visite os sites: www.grupoomi.eu; www.omiclear.eu, www.omip.eu, www.omie.es, www.mibgas.es, www.mibgasderivatives.es e <https://gestorgarantias.omip.pt>

2. Função do Candidato

Assegurar a execução dos procedimentos operacionais diários efectuados pelo Departamento de Compensação da OMIClear, tais como:

- O processo de registo das transacções sobre os contratos de derivados que sejam negociados nos respectivos mercados (OMIP, MIBGAS Derivatives, MIBGAS);
- Monitorização da actividade dos participantes da OMIClear, nomeadamente dos Membros Compensadores (que consistem nas contrapartes da CCP) e solicitação de garantias sempre que atingem determinados limites operativos,
- O cálculo dos parâmetros de risco subjacente às margens requeridas para cobrir o risco inerente às posições compradoras ou vendedoras que advêm das transacções registadas;
- A gestão das garantias depositadas pelos Membros Compensadores (nomeadamente, processo de custódia em bancos ou centrais de valores mobiliários, cálculo e monitorização dos limites de concentração, cálculo de juros aplicáveis ao montante das garantias, cálculo de *haircuts* etc.);
- O processamento e controlo das liquidações financeiras no sistema de pagamentos Europeu (Target2) ao longo dos ciclos de vida dos contratos de derivados e execução das notificações das posições em contratos de derivados físicos durante o seu período de entrega aos respectivos operadores de mercado ou operadores técnicos de sistema;
- Conhecer as ferramentas de gestão de risco da CCP, em particular para a aplicação da metodologia de cálculo de margens, testes de validação do modelo (execução e análise de resultados *backtests*, *stress tests*, *reverse stress tests* e *sensitivity tests*) e avaliação periódica do risco das contrapartes da OMIClear, com base nas políticas de risco (risco de crédito, risco de mercado, risco de liquidez) em vigor;
- Participar das especificações técnicas e testes relativamente a processos de melhoria, correcção de *bugs* e desenvolvimento de novas funcionalidades ao nível do sistema de compensação utilizado pela OMIClear ("MiClear") e promover a eficiência ao nível dos processos operativos existentes no Departamento;
- Participação activa no desenho, implementação e optimização dos processos de gestão de risco, elaboração de relatórios para o *Chief Risk Officer*, Comité de Risco, Conselho de Administração e entidades reguladoras.

A função exige um elevado grau de rigor de análise e de produção de informação. O candidato terá uma interacção directa com o Responsável do Departamento de Compensação e o *Chief Risk Officer* da OMIClear.

Perfil do Candidato

Formação base:

- Licenciatura em Economia ou Gestão de Empresas com especialização nas áreas da Estatística, Métodos Quantitativos, Econometria, Gestão do Risco, Finanças Quantitativas, Simulação;
- Licenciatura em Matemática aplicada, com iniciação à especialização nas áreas da Estatística Aplicada, Métodos Quantitativos, Simulação, Finanças ou similares;
- Mestrado em área financeira, focado principalmente em derivados e gestão do risco.

Conhecimentos nas seguintes áreas:

- Informática em especial MS Office.
- Valoriza-se conhecimentos em software econométrico/estatístico (R, MATLAB, Python...).
- Valoriza-se conhecimentos em Visual Basic e experiência no desenvolvimentos de macros.
- Valoriza-se conhecimentos em base de dados relacionais.
- Valoriza-se conhecimentos nos mercados de energia mas não é imprescindível.

Idiomas:

- Boa expressão oral e escrita em Inglês.
- Valoriza-se conhecimentos de Espanhol.

Experiência profissional:

Valoriza-se a experiência profissional em alguma(s) das seguintes actividades:

- Gestão do risco; Mercados financeiros; Matemática Financeira;
- Programação; Modelação; Estatística Aplicada; Simulação; Optimização e desenvolvimento de ferramentas de apoio à análise estatística.

Características pessoais:

- Boa capacidade de comunicação; espírito da equipa; proatividade, sentido de organização e método, responsabilidade, pensamento crítico, criatividade, flexibilidade cognitiva, orientação para prestar suporte aos clientes.

Local de Trabalho

Sede da OMIClear: Av. Casal Ribeiro 14; 7º piso; 1000-092 Lisboa.

Processo de Candidatura

O processo de candidatura inclui os seguintes passos:

1. Envio da candidatura, incluindo o *Curriculum Vitae*, ao seguinte endereço da OMIClear: work@omiclear.pt;
2. Selecção curricular, com base nos elementos recolhidos;
3. Selecção com base em entrevista individual.

Para qualquer clarificação, por favor utilizar o correio electrónico acima indicado.