

DELIBERAZIONE 23 OTTOBRE 2018

535/2018/R/EEL

APPROVAZIONE DELLA PROPOSTA DI TERMINI E CONDIZIONI RELATIVI AL BILANCIAMENTO, PRESENTATA AI SENSI DEL REGOLAMENTO UE 2017/2195 (REGOLAMENTO BALANCING) E VERIFICA DI CONFORMITÀ DI RELATIVE PROPOSTE DI MODIFICA DEL CODICE DI TRASMISSIONE, DISPACCIAMENTO, SVILUPPO E SICUREZZA DELLA RETE

L'AUTORITÀ DI REGOLAZIONE PER ENERGIA RETI E AMBIENTE

Nella 1038^a riunione del 23 ottobre 2018

VISTI:

- la direttiva 2009/72/CE del Parlamento europeo e del Consiglio, del 13 luglio 2009;
- il regolamento (UE) 2017/2195 della Commissione, del 23 novembre 2017, che stabilisce orientamenti in materia di bilanciamento del sistema elettrico (di seguito: Regolamento Balancing);
- il regolamento (UE) 2015/1222 della Commissione, del 24 luglio 2015, che stabilisce linee guida per l'allocazione della capacità e la gestione delle congestioni (di seguito: Regolamento CACM)
- il regolamento (UE) 2017/2196 della Commissione, del 24 novembre 2017, che istituisce un codice in materia di emergenza e ripristino dell'energia elettrica;
- regolamento (UE) 2017/1485 della Commissione, del 2 agosto 2017, che stabilisce orientamenti in materia di gestione del sistema di trasmissione dell'energia elettrica (di seguito: Regolamento System Operation);
- la legge 14 novembre 1995, n. 481 e successive modifiche e integrazioni;
- il decreto legislativo 16 marzo 1999, n. 79;
- il decreto legislativo 1 giugno 2011, n. 93;
- il codice di trasmissione, dispacciamento, sviluppo e sicurezza della rete di cui all'articolo 1, comma 4, del DPCM 11 maggio 2004 (di seguito: Codice di rete);
- il documento di consultazione dell'Autorità di Regolazione per Energia Reti e Ambiente (di seguito: Autorità) 28 dicembre 2016, 798/2016/R/eel, relativo all'introduzione del mercato *intraday* continuo ai sensi del Regolamento CACM e i primi orientamenti per il coordinamento con il mercato per il servizio di dispacciamento (di seguito: DCO 798/2016/R/eel);
- la lettera di Terna del 3 agosto 2018, prot. Autorità 23295, del 3 agosto 2018 (di seguito: proposta di termini e condizioni relativi al bilanciamento);

- la deliberazione dell’Autorità 5 aprile 2018, 224/2018/R/eel (di seguito: deliberazione 224/2018/R/eel);
- la deliberazione dell’Autorità 5 maggio 2017, 300/2017/R/eel (di seguito: deliberazione 300/2017/R/eel);

CONSIDERATO CHE:

- il Regolamento Balancing è entrato in vigore il 18 dicembre 2017;
- l’obiettivo del Regolamento Balancing è quello di favorire l’integrazione dei mercati di bilanciamento dei paesi europei, attraverso l’adozione di regole armonizzate e la creazione di piattaforme europee comuni per lo scambio di energia di bilanciamento, tra cui in particolare la piattaforma per lo scambio di *Replacement Reserve* (di seguito: Piattaforma RR);
- l’articolo 18(1) del Regolamento Balancing prevede che entro sei mesi dalla sua entrata in vigore il TSO elabori una proposta di termini e condizioni per i prestatori di servizi di bilanciamento (di seguito: BSP) e di termini e condizioni per i responsabili del bilanciamento (di seguito: BRP);
- l’articolo 18(5) del Regolamento Balancing definisce il contenuto dei termini e condizioni per i BSP;
- l’articolo 18(6) del Regolamento Balancing definisce il contenuto dei termini e condizioni per i BRP;
- l’articolo 18(8) del Regolamento Balancing definisce l’ulteriore contenuto dei termini e condizioni relativi al bilanciamento che deve essere incluso dai TSO che applicano un modello di dispacciamento centralizzato;
- l’articolo 18(2) del Regolamento Balancing richiede che i termini e condizioni relativi al bilanciamento includano anche specifiche disposizioni per la sospensione e la ripresa delle attività di mercato e per la regolazione delle partite economiche in caso di sospensione delle attività di mercato;
- l’articolo 10(5) prevede che la proposta di termini e condizioni per il bilanciamento sia posta in consultazione a livello nazionale per un periodo non inferiore a un mese;
- Terna ha svolto una consultazione pubblica per la proposta di termini e condizioni relativi al bilanciamento, dal 28 maggio 2018 al 29 giugno 2018;
- l’articolo 5(4) del Regolamento Balancing prevede che ogni singola Autorità di regolazione decida in merito ai termini e alle condizioni trasmesse ai sensi dell’articolo 18;
- l’articolo 5(5) del Regolamento Balancing prevede che le proposte di termini e condizioni inviate alle Autorità di regolazione, includano un cronoprogramma per la loro implementazione e una descrizione degli impatti attesi sugli obiettivi del Regolamento stesso;
- alcuni requisiti dell’articolo 18 del Regolamento Balancing sono già contenuti nella versione del Codice di Rete verificata positivamente con la deliberazione 224/2018/R/eel;
- Terna ha inviato all’Autorità la proposta di termini e condizioni relativi al bilanciamento, recante la seguente documentazione:

- il documento “Termini e condizioni relativi al bilanciamento”, ai sensi dell’articolo 18 del Regolamento Balancing;
- le proposte di modifica al capitolo 4 del codice di rete e relativi allegati (A.22, A.23, A.25);
- le osservazioni presentate dagli operatori nell’ambito della consultazione e una relazione riepilogativa delle stesse;
- le proposte di modifica al codice di rete di cui al punto precedente hanno l’obiettivo principale di disciplinare:
 - il coordinamento tra il Mercato Infragiornaliero (MI) e il Mercato per il Servizio di Dispacciamento (MSD) che si renderà necessario con la futura introduzione della contrattazione *intraday* continua fino all’ora H-1 richiesta dal Regolamento CACM;
 - il coordinamento tra MSD e la Piattaforma RR, che si renderà necessario per la condivisione e attivazione delle risorse di bilanciamento su tale piattaforma, come richiesto dal Regolamento Balancing;
 - l’introduzione della possibilità di presentare offerte in modalità continua su MB fino all’ora H-1, per consentirne l’aggiornamento più vicino al tempo reale, come previsto dal Regolamento Balancing;
- per quanto riguarda le disposizioni di termini e condizioni per l’aggregazione degli impianti di consumo, degli impianti di stoccaggio e degli impianti di generazione di cui all’articolo 18(5)(c) del Regolamento Balancing, Terna se ne riserva la definizione in esito alle procedure svolte ai sensi della deliberazione 300/2017/R/eel;
- per quanto riguarda le disposizioni di cui all’articolo 18(6)(k) relative al settlement degli sbilanciamenti, Terna se ne riserva l’aggiornamento a valle del recepimento da parte dell’Autorità della metodologia di armonizzazione che sarà presentata dai TSO ai sensi dell’articolo 52 del Regolamento Balancing;
- per quanto riguarda le disposizioni per la sospensione e la ripresa delle attività di mercato, nonché per la regolazione delle partite economiche in caso di sospensione delle attività di mercato, di cui all’articolo 18(2) del Regolamento Balancing, Terna se ne riserva la definizione a seguito della finalizzazione delle metodologie di cui agli articoli 36 e 39 del Regolamento (UE) 2017/2196;
- la proposta di termini e condizioni per il bilanciamento individua, per ciascuna richiesta elencata nell’articolo 18 del Regolamento Balancing, una corrispondenza con quanto disciplinato nel Codice di Rete o future modifiche di esso.

CONSIDERATO, INOLTRE, CHE:

- buona parte delle proposte di modifica al Codice di Rete inviate da Terna sono riconducibili a due tematiche principali: il coordinamento tra MI ed MSD ed il coordinamento tra MSD e la Piattaforma RR;
- per quanto riguarda il coordinamento tra MI e MSD, Terna propone di consentire agli operatori di modificare i propri programmi fino all’ora H-1, quindi anche successivamente alla determinazione degli esiti di MSD ex-ante, compatibilmente

con gli eventuali intervalli di fattibilità determinati da Terna su MSD ex-ante, all'interno dei quali devono ricadere i programmi finali cumulati. In particolare, per garantire il funzionamento della fase di MSD ex-ante, che ha luogo in un istante di tempo precedente alla chiusura del mercato *intraday* continuo all'ora H-1, Terna propone un obbligo per le unità abilitate di pre-nominare le quantità negoziate fino a quel momento sul mercato *intraday* continuo, in modo da fornire un programma aggiornato come punto di partenza per la fase di programmazione di MSD. Secondo la proposta, l'esito di MSD ex-ante restituisce le quantità selezionate (ma non soggette a remunerazione) e i vincoli operativi per le unità abilitate, sotto forma di intervalli di fattibilità che il programma finale cumulato dovrà rispettare. Alla chiusura del mercato *intraday* all'ora H-1, successiva all'esito di MSD ex-ante, gli operatori hanno l'obbligo di nominare in via definitiva tutte le contrattazioni svolte su tale mercato. In esito a questo processo di nomina Terna determina le quantità effettivamente accettate e remunerate su MSD ex-ante, oltre all'eventuale sbilanciamento a programma MSD, finalizzato a rendere congruenti i programmi aggiornati cumulati e le quantità accettate su MSD con gli intervalli di fattibilità;

- le modifiche proposte al Codice di Rete per introdurre le misure di coordinamento tra MI e MSD sono indicativamente concentrate negli articoli 4.7, 4.9 e nell'Allegato A22;
- per quanto riguarda il coordinamento tra MSD e la Piattaforma RR, Terna introduce la possibilità di avvalersi della Piattaforma RR ai fini delle azioni di bilanciamento, convertendo a tal fine le offerte presentate dagli operatori su MSD, nel prodotto standard negoziato sulla piattaforma. Le modifiche proposte da Terna consentono agli operatori di specificare, in aggiunta ai prezzi presentati su MSD, un prezzo in acquisto e un prezzo in vendita, per le offerte convertite che saranno condivise sulla Piattaforma RR. In tal modo è possibile tener conto delle differenti modalità di remunerazione, a prezzo marginale per la Piattaforma RR e *pay-as bid* per MSD. In particolare, il processo di conversione delle offerte MSD nel prodotto standard avviene successivamente alla definizione del programma finale cumulato per un determinato periodo rilevante, tenuto conto:
 - della massima variazione di potenza che può essere erogata dall'unità al fine di raggiungere le caratteristiche del prodotto standard di *Replacement Reserve*;
 - delle limitazioni per vincoli di rete in sicurezza N e N-1;
 - delle limitazioni derivanti dai vincoli di *unit commitment* delle unità;
 - delle limitazioni derivanti dall'assegnazione di riserva secondaria sull'unità;
 - delle limitazioni per energia delle unità idroelettriche di produzione o di produzione e pompaggio;
- la valorizzazione prevista per le quantità accettate in vendita (acquisto) sulla Piattaforma RR avviene attraverso il prezzo marginale in vendita (acquisto) determinatosi su tale piattaforma nel periodo di riferimento per la zona in cui è localizzata l'unità. La valorizzazione prevista per le quantità accettate in acquisto (vendita) su MB, in contromodulazione rispetto alle quantità accettate in vendita (acquisto) sulla Piattaforma RR, avviene al prezzo offerto in vendita (acquisto) definito per lo scambio sulla piattaforma. Le modifiche proposte includono un

cambio dell'algoritmo di determinazione della remunerazione dell'offerta di accensione e dell'offerta di cambio assetto, per tenere conto delle quantità accettate in vendita e in acquisto sulla Piattaforma RR;

- l'implementazione e la partecipazione alla Piattaforma RR implica una contrazione dei tempi a disposizione di Terna e pertanto una modifica alle regole di definizione dei programmi vincolanti. A tal riguardo le modifiche proposte nell'Allegato A25, prevedono che il trasferimento parziale di energia consideri i 15 minuti finali di un dato periodo orario e i 15 minuti iniziali del periodo orario contiguo, in luogo dei 30 minuti considerati attualmente;
- le modifiche al Codice di Rete proposte da Terna includono ulteriori elementi non direttamente riconducibili alle due tematiche principali sopra richiamate (coordinamento tra MI e MSD e coordinamento tra MSD e Piattaforma RR), ma funzionali alla definizione dei termini e condizioni per il bilanciamento e agli adempimenti del Regolamento *Balancing* e del Regolamento *System Operation*; più in dettaglio Terna propone di:
 - introdurre la possibilità per gli operatori di presentare offerte in modalità continua su MB, con riferimento a un dato periodo orario, fino a 60 minuti dall'inizio dello stesso. Tale previsione è in adempimento alle richieste dell'art. 24 del Regolamento *Balancing*;
 - modificare la definizione del fabbisogno di riserva terziaria contenuta nell'Allegato A22, includendo la perdita del collegamento in corrente continua con il più elevato valore di transito, ai sensi dall'art. 157 del Regolamento *System Operation*.

CONSIDERATO, INFINE, CHE:

- in risposta alla consultazione di Terna, gli operatori hanno manifestato la necessità di conoscere in dettaglio le modalità di valorizzazione dello "sbilanciamento a programma MSD", nonché gli eventuali meccanismi di remunerazione dei costi opportunità che si vengono a creare con l'introduzione degli intervalli di fattibilità;
- sempre in risposta alla consultazione di Terna, gli operatori hanno manifestato la necessità di istituire uno *stakeholder group* nazionale, finalizzato a monitorare gli impatti dell'implementazione del Regolamento *Balancing* sulla disciplina nazionale.

RITENUTO CHE:

- le richieste dell'articolo 5(5) del Regolamento *Balancing*, sono implicitamente soddisfatte nella proposta di termini e condizioni per il bilanciamento;
- sia opportuno approvare la proposta di termini e condizioni per il bilanciamento inviata da Terna, come ulteriore passo per l'implementazione del Regolamento *Balancing*;
- la proposta di Terna relativa al coordinamento tra MSD e la Piattaforma RR sia una valida soluzione per integrare il segmento di mercato di bilanciamento europeo nel dispacciamento nazionale, poiché consente la conversione delle offerte in prodotti

standard per la piattaforma, nel rispetto dei vincoli di sistema, prevedendo inoltre la possibilità di formulare un prezzo specifico, per tenere conto della diversa modalità di valorizzazione tra MSD e Piattaforma RR;

- le altre modifiche proposte da Terna al Codice di Rete (non direttamente riconducibili al coordinamento tra MI e MSD e al coordinamento tra MSD e Piattaforma RR) non presentino criticità;
- sebbene la proposta di Terna relativa al coordinamento tra MI e MSD sia in linea con gli orientamenti dell’Autorità già espressi nel DCO 798/2016/R/eel e persegua l’obiettivo di preservare l’efficienza del MSD, sia necessario inquadrare le tematiche afferenti al coordinamento tra MI e MSD nell’ambito della più generale riforma del servizio di dispacciamento;
- sia pertanto opportuno verificare positivamente tutte le modifiche proposte al Codice di Rete, ad eccezione di quanto proposto per il coordinamento tra MI e MSD (tali misure sono indicativamente concentrate negli articoli 4.7, 4.9 e nell’Allegato A22).

RITENUTO, INOLTRE, CHE:

- il processo di conversione delle offerte presentate in MSD nell’equivalente prodotto standard per la Piattaforma RR possa risultare poco trasparente, specialmente per quanto riguarda le limitazioni alla conversione per vincoli di rete in sicurezza N e N-1: ciò poiché, mentre i vincoli tecnici degli impianti (rampe, assetti, ecc.) sono noti all’operatore, i vincoli di sicurezza rappresentano un’incognita che agisce sulla conversione finale dell’offerta;
- sia pertanto opportuno richiedere a Terna un approfondimento in merito alle migliori modalità per garantire la trasparenza del processo di conversione delle offerte, soprattutto per quanto riguarda i vincoli di rete in sicurezza N e N-1;
- benché la Piattaforma RR possa apportare potenziali benefici in termini di possibile riduzione del costo di bilanciamento grazie ad un bacino di risorse più ampio e ad una maggior concorrenza, potrebbero manifestarsi inefficienze dovute al fatto che la Piattaforma RR introduce, nel processo co-ottimizzato su scala nodale di MSD, un segmento di mercato per lo scambio di energia di bilanciamento su base zonale, che si interpone tra la fase di MSD ex-ante e la fase del MB. Ciò può portare a soluzioni sub-ottime e a potenziali costi maggiori (si pensi, ad esempio, a un’offerta accettata sulla Piattaforma RR al solo scopo di bilanciamento e successivamente revocata in MB, a favore di un’altra offerta in grado di soddisfare contestualmente il bilanciamento e un vincolo di sistema quale una congestione);
- sia pertanto opportuno prevedere che Terna, al fine di preservare l’efficienza del modello di MSD integrato e co-ottimizzato con i vincoli di sistema, sfruttando nel contempo i benefici potenziali di un mercato di bilanciamento transfrontaliero e armonizzato, proponga all’Autorità soluzioni di monitoraggio per l’efficienza del processo di MSD e misure operative sull’utilizzo della Piattaforma RR che minimizzino il rischio di inefficienza dovuto alla segmentazione del mercato di bilanciamento;

- accogliendo la proposta formulata dagli operatori stessi, sia opportuno che Terna istituisca uno *stakeholder group* nazionale con gli operatori, per garantire un adeguato livello di coinvolgimento di tutti gli attori del mercato elettrico, tenuto conto anche dell'attuale contesto di implementazione dei regolamenti europei e in particolare il Regolamento Balancing

DELIBERA

1. di approvare la proposta di termini e condizioni per il bilanciamento, allegato al presente provvedimento (*Allegato A*);
2. di verificare positivamente le modifiche proposte al Codice di Rete, predisposte da Terna e trasmesse contestualmente alla proposta di termini e condizioni per il bilanciamento, ad eccezione di quelle relative al coordinamento tra MI e MSD;
3. di dare mandato al Direttore della Direzione Mercati Energia all'ingrosso e sostenibilità Ambientale affinché le tematiche afferenti al coordinamento tra MI e MSD siano trattate in modo organico nell'ambito della più generale riforma del servizio di dispacciamento;
4. di prevedere che Terna, entro il 30 giugno 2019, invii all'Autorità una relazione in merito alle migliori modalità per garantire la trasparenza del processo di conversione delle offerte, soprattutto per quanto riguarda i vincoli di rete in sicurezza N e N-1;
5. di prevedere che Terna, entro il 30 giugno 2019, invii all'Autorità una proposta di soluzioni di monitoraggio per l'efficienza del processo di MSD e misure operative sull'utilizzo della Piattaforma RR, che minimizzino il rischio di inefficienza dovuto alla segmentazione del mercato di bilanciamento, nel rispetto dei principi del Regolamento *Balancing* e delle metodologie di implementazione dello stesso;
6. di prevedere che Terna istituisca uno *stakeholder group* nazionale con gli operatori, per garantire un adeguato livello di coinvolgimento di tutti gli attori del mercato elettrico in merito alle future evoluzioni degli adempimenti previsti dai Regolamenti europei;
7. di trasmettere copia del presente provvedimento a Terna;
8. di trasmettere copia del presente provvedimento al Ministro dello Sviluppo Economico, del Lavoro e delle Politiche Sociali e ad ACER;
9. di pubblicare il presente provvedimento sul sito internet dell'Autorità www.arera.it.

23 ottobre 2018

IL PRESIDENTE
Stefano Besseghini