

DELIBERAZIONE 11 APRILE 2018
252/2018/E/EEL

**CONFERMA DEL PROVVEDIMENTO PRESCRITTIVO NEI CONFRONTI DI UN UTENTE DEL
DISPACCIAMENTO IN PRELIEVO E IMMISSIONE (DELIBERAZIONE 458/2017/E/EEL)
RISPETTO A STRATEGIE DI PROGRAMMAZIONE NON DILIGENTI NELL'AMBITO DEL
SERVIZIO DI DISPACCIAMENTO (PROCEDIMENTO AVVIATO CON DELIBERAZIONE
DELL'AUTORITÀ 342/2016/E/EEL) E REVISIONE DEL RELATIVO ALLEGATO B**

**L'AUTORITÀ DI REGOLAZIONE PER ENERGIA
RETI E AMBIENTE**

Nella 1014^a riunione del 11 aprile 2018

- Premesso che l'Autorità di Regolazione per Energia Reti e Ambiente (di seguito: Autorità), ai sensi della deliberazione 8 febbraio 2018, 64/2018/A, opera, a far data dal 12 febbraio 2018, in regime di specifica *prorogatio* e visto il decreto-legge 10 aprile 2018, n. 30;
- ritenuto il presente provvedimento atto di ordinaria amministrazione.

VISTI:

- la direttiva 2009/72/CE del Parlamento europeo e del Consiglio, del 13 luglio 2009;
- la legge 14 novembre 1995, n. 481 (di seguito: legge 481/95) ed, in particolare, l'articolo 2, comma 20, lettera d);
- il decreto legislativo 16 marzo 1999, n. 79/99;
- il decreto legislativo 1 giugno 2011, n. 93 (di seguito: decreto legislativo 93/11);
- il decreto legge 24 giugno 2014, n. 91, come convertito dalla legge 11 agosto 2014, n. 116;
- il decreto del Presidente della Repubblica 9 maggio 2001, n. 244;
- l'Allegato A alla deliberazione dell'Autorità di Regolazione per Energia Reti e Ambiente (di seguito: Autorità) 9 giugno 2006, 111/06, come successivamente integrato e modificato (di seguito: deliberazione 111);
- il vigente Testo Integrato in ordine alla regolazione delle partite fisiche ed economiche del servizio di dispacciamento - *Settlement* (di seguito: TIS);
- la deliberazione dell'Autorità 24 giugno 2016, 342/2016/E/EEL (di seguito: deliberazione 342/2016/E/EEL);
- la deliberazione dell'Autorità 28 luglio 2016, 444/2016/R/EEL (di seguito: deliberazione 444/2016/R/EEL);
- la deliberazione dell'Autorità 23 marzo 2017, 177/2017/E/EEL;

- la deliberazione dell’Autorità 8 giugno 2017, 419/2017/R/EEL (di seguito: 419/2017/R/EEL);
- la deliberazione dell’Autorità 22 giugno 2017, 458/2017/E/EEL (di seguito: 458/2017/E/EEL);
- la deliberazione dell’Autorità 13 luglio 2017, 526/2017/E/EEL;
- la deliberazione dell’Autorità 9 aprile 2018, 228/2018/A;
- il documento per la consultazione dell’Autorità 16 giugno 2016, 316/2016/R/EEL (di seguito: documento per la consultazione 316/2016/R/EEL).

CONSIDERATO CHE:

- con la deliberazione 342/2016/E/EEL, l’Autorità ha avviato una serie di procedimenti, di natura individuale, per l’adozione di provvedimenti prescrittivi e/o di misure di regolazione asimmetrica, rispettivamente ai sensi dell’articolo 2, comma 20, lettera d) della legge 481/95 e dell’articolo 43, comma 5, del decreto legislativo 93/11, volti a promuovere la concorrenza e garantire il buon funzionamento dei mercati mediante un efficace e proporzionato contrasto di condotte sui mercati all’ingrosso dell’energia e del servizio di dispacciamento, suscettibili di compromettere la corretta interazione tra domanda e offerta, con effetti negativi sull’andamento di tali mercati (di seguito: procedimenti 342/2016/E/EEL);
- nell’ambito dei procedimenti 342/2016/E/EEL, l’Autorità ha adottato, nei confronti della società individuata nell’Allegato A al presente provvedimento individuale (di seguito: Società), il provvedimento prescrittivo 458/2017/E/EEL, riconoscendo alla medesima, al punto 3 del deliberato, la facoltà di trasmettere, entro il termine decadenziale di 30 giorni dalla notifica del suddetto provvedimento, ulteriori elementi utili a rivedere quanto definito nell’Allegato B al provvedimento, ivi incluse informazioni puntuali sulla composizione del proprio portafoglio di unità di produzione non rilevanti alimentate da fonti rinnovabili non programmabili;
- la Società si è avvalsa di tale facoltà sia in occasione dell’audizione innanzi al responsabile del procedimento in data 26 luglio 2017 sia trasmettendo una relazione tecnica in data 3 agosto 2017 (prot. Autorità 26450 del 7 agosto 2017), successivamente integrata in data 31 gennaio 2018 (prot. Autorità 3139 del 2 febbraio 2018); con la comunicazione del 3 agosto 2017 (prot. Autorità 26379 del 4 agosto 2017) sono stati acquisiti, inoltre, i dati puntuali relativi al suo portafoglio commerciale.

CONSIDERATO, INOLTRE, CHE:

- con le modalità sopra descritte, la Società ha evidenziato, con riferimento alle unità di consumo incluse nel proprio portafoglio nel periodo di indagine, la presenza di clienti industriali connessi in media tensione e caratterizzati da prelievi significativamente discontinui, da cui deriverebbero difficoltà di

programmazione del tutto simili a quelle già prese in considerazione dal provvedimento prescrittivo 458/2017/E/EEL relativamente alla clientela connessa in alta tensione;

- con riferimento alle unità di produzione incluse nel proprio portafoglio commerciale, la Società ha illustrato le difficoltà di programmazione delle immissioni degli impianti di produzione cogenerativi asserviti a cicli industriali inseriti in contesti SSPC (Sistemi Semplici di Produzione e Consumo); il valore soglia del 30% individuato nella deliberazione 458/2017/E/EEL per valutare gli sbilanciamenti di tali impianti non consentirebbe di riflettere la discontinuità e l'assenza di periodicità delle loro immissioni;
- relativamente alle unità di produzione non rilevanti alimentate da fonti rinnovabili non programmabili, la Società ha infine elencato una serie di fattori specifici che dovrebbero essere considerati in sede di valutazione della diligenza:
 - a) i ritardi con cui eventuali malfunzionamenti sono segnalati all'utente del dispacciamento dal titolare dell'impianto produttivo;
 - b) gli effetti delle brezze marine sulla produzione degli impianti eolici ubicati nelle zone costiere che sono normalmente trascurati dai *provider* di previsioni meteorologiche;
 - c) l'assenza di informazioni precise sulle caratteristiche degli impianti che sono necessarie per impostare correttamente i modelli previsivi a causa della scarsa collaborazione di alcuni produttori nel trasmettere tali informazioni alla Società;
 - d) la mancata trasmissione di dati di misura da parte di Terna con riferimento a due impianti nonché i ritardi nell'aggiornamento delle anagrafiche degli impianti nel portale Gaudì;
 - e) l'elevato tasso di rotazione del proprio portafoglio, sia in termini di numerosità degli impianti sia in termini di potenza installata, con le relative difficoltà di programmazione dovute all'assenza di dati storici sulle immissioni degli impianti di recente acquisizione;
- la Società ha anche descritto la strategia di programmazione dei prelievi delle unità di consumo adottata nel periodo gennaio-giugno 2016, consistente al più nello spostamento degli acquisti zionali all'interno della macrozona Sud allo scopo di limitare la propria esposizione al rischio: gli sbilanciamenti tendenzialmente positivi registrati nella zona Sud risulterebbero, infatti, simmetrici alla somma degli sbilanciamenti di segno opposto registrati nelle altre zone della stessa macrozona; all'interno della macrozona gli sbilanciamenti effettivi risulterebbero, pertanto, neutri;
- la Società ha anche fornito una quantificazione dell'ipotetico beneficio conseguito tramite la suddetta strategia, applicando retroattivamente agli sbilanciamenti della macrozona Sud il corrispettivo di non arbitraggio macrozonale, introdotto con la deliberazione 419/2017/R/EEL proprio al fine di sterilizzare i potenziali guadagni derivanti dai differenziali dei prezzi zionali all'interno della stessa macrozona; le modalità di calcolo della prescrizione di

cui all'Allegato B alla deliberazione 458/2017/E/EEL, viceversa, essendo basate sugli sbilanciamenti delle singole zone, non risulterebbero idonee a catturare gli effetti economici complessivi degli sbilanciamenti all'interno della stessa macrozona;

- la Società ha altresì fornito una valutazione di eventuali ulteriori sbilanciamenti finalizzati ad opporsi al segno di sbilanciamento aggregato zonale a livello macrozonale, avanzando alcune possibili ipotesi di calcolo.

CONSIDERATO, ALTRESÌ, CHE:

- la Società ha fornito elementi puntuali in merito alle difficoltà di programmazione legate alla presenza nel proprio portafoglio di punti di dispacciamento associati a clienti industriali connessi in media tensione;
- è stato pertanto possibile applicare anche alle curve orarie dei suddetti punti la metodologia statistica, già utilizzata per i punti di prelievo connessi in alta tensione presenti all'interno del portafoglio della Società, personalizzando in tal modo la soglia di riferimento di cui all'Allegato B alla deliberazione 458/2017/E/EEL;
- per quanto attiene agli impianti di produzione inseriti in un contesto SSPC, l'Autorità, in sede di adozione dei provvedimenti prescrittivi, ha ritenuto opportuno valutare la diligenza della programmazione delle immissioni effettive in rete sulla base del livello medio di prestazione per la programmazione della produzione e del consumo e del grado di correlazione esistente fra produzione e consumo stesso; in particolare, la correlazione fra produzione e consumo è stata supposta trascurabile per gli impianti di produzione alimentati da fonti rinnovabili, mentre un certo grado di correlazione è stato ipotizzato per gli impianti di cogenerazione; il calcolo statistico, inoltre, è stato condotto assumendo per il consumo un livello medio di prestazione analogo a quello relativo alla programmazione dei prelievi (si è assunto il livello medio standard, tipico dei punti di prelievo non inseriti in contesti SSPC per i quali il consumo e il prelievo coincidono) e per la produzione un livello medio di prestazione dipendente dalla fonte primaria;
- a seguito di ulteriori valutazioni compiute sulla base degli elementi forniti dalla Società e di quelli acquisiti in procedimenti analoghi a carico di altri utenti del dispacciamento in immissione, l'Autorità intende, tuttavia, rivedere le proprie posizioni in merito alle valutazioni della diligenza per gli impianti di cogenerazione inseriti in un contesto SSPC, prevedendo per essi una soglia di tolleranza determinata in funzione dell'effettiva variabilità delle curve di immissione, secondo una metodologia statistica concettualmente analoga a quella applicata per i punti di prelievo; la suddetta metodologia statistica è applicata anche alle curve di immissione degli impianti alimentati a fonti rinnovabili programmabili, anch'essi caratterizzati da una particolare aleatorietà delle immissioni;

- gli effetti delle brezze marine sulle unità di produzione alimentate da fonte eolica ubicate in zone costiere, la dinamica del portafoglio e l'assenza di informazioni precise per impostare i modelli previsivi sono situazioni peculiari per tutti gli operatori del settore e, pertanto, esse si riflettono nel determinare il livello medio di prestazione associato a ciascuna fonte primaria, indicato dalla corrispondente soglia di tolleranza, sulla base del quale valutare le condotte tenute dalla Società;
- una comunicazione efficace fra produttore e utente del dispacciamento con riferimento all'effettiva producibilità degli impianti e a eventuali indisponibilità per guasti o fuori servizio programmati è una attività che compete ad un operatore diligente: l'inefficacia di tale comunicazione non ha, quindi, alcun rilievo ai fini del presente procedimento;
- rileva, invece, la mancata trasmissione delle misure da parte di Terna con riferimento a due specifici impianti: la messa a disposizione delle misure, ancorché con ritardo, rappresenta per l'utente del dispacciamento un utile strumento di riscontro rispetto alle informazioni scambiate con il produttore; in assenza di tali misure l'utente del dispacciamento potrebbe dedurre il completo non funzionamento dell'impianto e tarare la propria programmazione di conseguenza; tale aspetto comporta, quindi, una personalizzazione della soglia di tolleranza per quelle unità di produzione non rilevanti al cui interno rientrano gli impianti sopraccitati; per ulteriori dettagli in merito si rinvia all'Allegato B al presente provvedimento.

CONSIDERATO, INOLTRE, CHE:

- come evidenziato nel documento per la consultazione 316/2016/R/EEL, le strategie di programmazione non diligente possono essere ricondotte a due distinte tipologie:
 - a) strategie finalizzate a trarre un vantaggio economico dalla prevedibilità del segno dello sbilanciamento aggregato zonale, riferito a ciascuna macrozona (di seguito: strategie sul segno);
 - b) strategie finalizzate a trarre un vantaggio economico dal differenziale fra i prezzi zionali all'interno della macrozona Sud (di seguito: strategie sul differenziale di prezzo);
- in sede di adozione dei provvedimenti prescrittivi, l'Autorità ha ritenuto opportuno adottare una metodologia di calcolo semplificata, basata sulla valorizzazione a prezzo zonale orario degli sbilanciamenti effettivi eccedentari la specifica soglia di tolleranza applicabile a ciascuna tipologia di unità non abilitata in ciascun mese e in ciascuna zona: in questo modo l'Autorità ha voluto riconoscere all'utente del dispacciamento la presenza di errori fisiologici nella programmazione, legati sia alle prestazioni medie degli operatori del settore sia agli eventuali elementi specifici adottati dall'utente stesso con riferimento al proprio portafoglio commerciale;

- in particolare, il calcolo alla base della metodologia semplificata è effettuato separatamente per ciascuna zona e ciascun mese, consentendo di compensare fra loro su base mensile e su base zonale i benefici maturati da ciascun utente del dispacciamento in esito a comportamenti non diligenti (maggiori ricavi per sbilanciamenti positivi o minori costi per sbilanciamenti negativi) con le eventuali perdite sofferte dal medesimo sempre in esito a comportamenti non diligenti (minori ricavi per sbilanciamenti positivi o maggiori costi per sbilanciamenti negativi); l'utente del dispacciamento è, pertanto, chiamato a restituire la sola posizione netta, ossia l'effettivo beneficio che ha tratto in quel dato mese e in quella data zona da una programmazione contraria ai principi di diligenza, perizia, prudenza e previdenza;
- la metodologia sopra descritta prevede altresì un tetto massimo alla restituzione, pari al beneficio in eccesso rispetto alla valorizzazione a prezzo zonale orario dell'intero sbilanciamento effettivo: in tale modo l'Autorità ha inteso garantire che la restituzione richiesta all'utente del dispacciamento, calcolata sulla base dei soli sbilanciamenti effettivi eccedentari rispetto alla specifica soglia di tolleranza, non possa eccedere, su base mensile e zonale, l'effettivo beneficio maturato in quel mese e in quella zona e associato all'intero volume di sbilanciamento;
- la metodologia di calcolo prevista dall'Autorità, tuttavia, non tiene conto della posizione complessiva nella macrozona Sud, ma solamente della posizione associata a ciascuna zona: come evidenziato dalla Società nella propria memoria, essa può, pertanto, dare luogo a prescrizioni superiori agli effettivi vantaggi conseguiti in presenza di strategie sul differenziale di prezzo, quali quelle descritte nella documentazione inviata dalla Società con riferimento alle unità di consumo.

CONSIDERATO, INFINE, CHE:

- alcuni degli elementi fattuali evidenziati dalla Società, pur non assumendo rilievo quanto ai presupposti che hanno determinato il provvedimento prescrittivo adottato con la deliberazione 458/2017/E/EEL che, sotto questo profilo, non può che essere confermato, rilevano però al fine di una revisione delle determinazioni contenute nell'*Allegato B* alla citata deliberazione, con particolare attenzione alle valutazioni sulla diligenza in determinate zone.

RITENUTO CHE:

- sia opportuno prevedere, ai fini della quantificazione degli importi sottesi alla misura prescrittiva lato prelievo, una metodologia di calcolo alternativa finalizzata a valutare la posizione complessiva della Società all'interno della macrozona Sud, come risultante dalla somma di due distinti contributi:
 - a) vantaggi economici associati all'adozione di strategie sul differenziale di prezzo;

- b) vantaggi economici associati all'adozione di strategie sul segno, riferite alla posizione netta oraria associata a ciascuna macrozona;
- sia opportuno, nell'ambito della metodologia alternativa di cui al punto precedente:
 - a) riconoscere alla Società solamente il beneficio associato agli errori di programmazione legati agli elementi specifici adottati dalla medesima con riferimento al proprio portafoglio; la soglia di sbilanciamento standard, riferita al livello medio di programmazione degli utenti del dispacciamento, è, infatti, rilevante per considerare sbilanciamenti strutturali derivanti dalla programmazione dei prelievi a livello zonale, ma non risulta applicabile a sbilanciamenti frutto di una strategia specifica quale quella adottata nella macrozona Sud;
 - b) prevedere che la Società sia comunque chiamata a restituire il minor importo fra quello risultante dall'applicazione della metodologia di calcolo originaria di cui alla deliberazione 458/2017/E/EEL e quello risultante dall'applicazione della metodologia di calcolo alternativa;
- sia, pertanto, opportuno confermare il provvedimento prescrittivo adottato con la deliberazione 458/2017/E/EEL, modificando, come specificato in motivazione, il contenuto dell'Allegato B ai sensi del punto 4 della medesima deliberazione sia per tenere conto delle valutazioni sulla diligenza derivanti da alcuni degli elementi fattuali adottati dalla Società sia con riferimento ai criteri di calcolo degli importi sottesi al provvedimento prescrittivo, come motivato *supra*;
- sia necessario individuare le tempistiche con cui Terna procede alla regolazione delle partite economiche sottese al provvedimento 458/2017/E/EEL, determinate sulla base dei criteri di cui all'Allegato B al presente provvedimento

DELIBERA

1. di confermare il provvedimento prescrittivo adottato con la deliberazione 458/2017/E/EEL, modificando il contenuto del relativo Allegato B, che viene pertanto sostituito dall'Allegato B al presente provvedimento, ai sensi del punto 4 della medesima deliberazione, al fine di tenere conto degli elementi fattuali trasmessi dalla Società, come specificato in motivazione, nonché dell'applicazione della metodologia di calcolo alternativa;
2. di prevedere che Terna proceda alla determinazione delle partite economiche sottese al provvedimento 458/2017/E/EEL, determinate sulla base dei criteri di cui all'Allegato B al presente provvedimento, entro l'ultimo giorno di aprile 2018 (con liquidazione delle partite economiche con valuta il sedicesimo giorno lavorativo di maggio 2018);
3. di notificare il presente provvedimento, comprensivo di tutti i suoi allegati, alla Società e a Terna;

4. di pubblicare il presente provvedimento sul sito internet dell'Autorità www.arera.it ad eccezione dell'Allegato B; la pubblicazione dell'Allegato A è differita al momento in cui saranno stati adottati i provvedimenti di chiusura di tutti i procedimenti sanzionatori conseguenti ai procedimenti individuali prescrittivi di cui alla deliberazione 342/2016/E/EEL.

11 aprile 2018

IL PRESIDENTE
Guido Bortoni