

DELIBERAZIONE 10 OTTOBRE 2023

462/2023/R/EEL

APPROVAZIONE DELLE PROPOSTE DI MODIFICA AL CODICE DI TRASMISSIONE, DISPACCIAMENTO, SVILUPPO E SICUREZZA DELLA RETE, IN ATTUAZIONE DELLA RIFORMA DELLA DISCIPLINA DEGLI SBILANCIAMENTI

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

Nella 1267^a riunione del 10 ottobre 2023

VISTI:

- la direttiva 2019/944/CE del Parlamento europeo e del Consiglio del 5 giugno 2019;
- il regolamento (UE) 942/2019 del Parlamento europeo e del Consiglio del 5 giugno 2019 che istituisce un'Agenzia dell'Unione europea per la cooperazione fra i regolatori nazionali dell'energia (di seguito: ACER);
- il regolamento (UE) 943/2019 del Parlamento europeo e del Consiglio del 5 giugno 2019 (di seguito: Regolamento Elettrico);
- il regolamento (UE) 2195/2017 della Commissione del 23 novembre 2017 (di seguito: Regolamento *Balancing*);
- la legge 14 novembre 1995, n. 481;
- il decreto legislativo 16 marzo 1999, n. 79;
- il decreto del Presidente del Consiglio dei Ministri 11 maggio 2004 (di seguito: DPCM 11 maggio 2004);
- la legge 11 agosto 2014, n. 116 (di seguito: legge 116/14);
- l'allegato A alla deliberazione dell'Autorità di Regolazione per Energia, Reti e Ambiente (di seguito: Autorità) 9 giugno 2006, n. 111/06 (di seguito: deliberazione 111/06);
- la deliberazione dell'Autorità 17 novembre 2020, 474/2020/R/eel (di seguito: deliberazione 474/2020/R/eel);
- il documento per la consultazione dell'Autorità 6 luglio 2021, 292/2021/R/eel (di seguito: documento per la consultazione 292/2021/R/eel);
- la deliberazione dell'Autorità 23 novembre 2021, 523/2021/R/eel (di seguito: deliberazione 523/2021/R/eel);
- la deliberazione dell'Autorità 8 febbraio 2022, 46/2022/R/eel (di seguito: deliberazione 46/2022/R/eel);
- la deliberazione dell'Autorità 22 marzo 2022, 123/2022/R/eel (di seguito: deliberazione 123/2022/R/eel);

- la deliberazione dell’Autorità 25 luglio 2023, 345/2023/R/eel (di seguito: deliberazione 345/2023/R/eel);
- la decisione ACER 18/2020 del 15 luglio 2020;
- 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);
- la comunicazione della società Terna S.p.A. (di seguito anche: Terna) del 19 luglio 2023, prot. Autorità 48046 del 20 luglio 2023 (di seguito: comunicazione 19 luglio 2023);

CONSIDERATO CHE:

- il Regolamento *Balancing* e il Regolamento Elettrico stabiliscono principi comuni per l’armonizzazione delle regole di valorizzazione degli sbilanciamenti, che i singoli TSO sono tenuti ad implementare a livello nazionale;
- la metodologia approvata con la decisione ACER 18/2020 del 15 luglio 2020 include gli ambiti di armonizzazione richiesti dall’articolo 52(2) del Regolamento *Balancing*, nonché le disposizioni generali sul tema della valorizzazione degli sbilanciamenti, stabilite dal Regolamento *Balancing* e dal Regolamento Elettrico;
- attraverso il documento per la consultazione 292/2021/R/eel l’Autorità ha consultato i criteri per adeguare la disciplina degli sbilanciamenti al quadro normativo europeo;
- la deliberazione 523/2021/R/eel ha formalizzato i nuovi criteri per la valorizzazione degli sbilanciamenti, apportando le opportune modifiche alla disciplina del dispacciamento di cui alla deliberazione 111/06 e stabilendone l’avvio al 1 aprile 2022;
- gli elementi principali della riforma introdotta con la deliberazione 523/2021/R/eel includono:
 - l’applicazione di un meccanismo *single pricing* a tutte le risorse del sistema;
 - la definizione dell’area di prezzo di sbilanciamento pari alla zona di mercato;
 - un prezzo basato sulla media pesata dei prezzi delle attivazioni di bilanciamento, calcolato su un perimetro che può includere un’aggregazione di più aree di prezzo di sbilanciamento, per tenere conto degli aggregati di zone libere da congestione;
 - l’estensione dei corrispettivi di non arbitraggio macrozonale alle unità abilitate e l’aggiornamento dei corrispettivi di mancato rispetto degli ordini di dispacciamento;
 - il mantenimento temporaneo di un’aggregazione statica delle aree di prezzo di sbilanciamento (macrozone) e un mandato a Terna per definire un piano di lavoro per lo sviluppo di una metodologia per ridefinire i perimetri geografici rispetto ai quali è calcolato il prezzo di sbilanciamento (cosiddette “macrozone dinamiche”);
- con la deliberazione 123/2022/R/eel l’Autorità ha approvato le modifiche al Codice di Rete proposte da Terna, in attuazione della riforma della disciplina degli sbilanciamenti.

CONSIDERATO, INOLTRE, CHE:

- nel documento per la consultazione 292/2021/R/eel l’Autorità ha identificato delle criticità nel meccanismo macrozonale statico attualmente in vigore che possono portare ad una errata valorizzazione dell’energia nel tempo reale. Infatti, l’approccio di calcolo attuale non consente di tenere in considerazione, ai fini del calcolo del prezzo di sbilanciamento, le attivazioni effettive di energia di bilanciamento in ciascuna macrozona, dato che non sono conteggiati gli scambi tra le macrozone o eventuali congestioni all’interno di esse;
- come possibile soluzione al problema di cui al precedente punto, l’Autorità ha ipotizzato di introdurre un meccanismo di aggregazione delle zone di mercato che consenta di individuare in maniera dinamica e per ciascun periodo rilevante gli aggregati zonalmente liberi da congestione; in assenza di un mercato zonale del tempo reale, ciò può avvenire tramite l’osservazione dei flussi fisici che si verificano tra zone di mercato confinanti nel tempo reale e il confronto con il relativo limite di transito massimo;
- la deliberazione 523/2021/R/eel ha dato mandato a Terna di definire una metodologia per identificare gli aggregati di aree di prezzo di sbilanciamento liberi da congestione, tenendo in considerazione i principi del documento per la consultazione 292/2021/R/eel, analizzando anche la possibilità di non procedere con alcuna aggregazione;
- con la comunicazione 19 luglio 2023 Terna ha inviato all’Autorità una proposta di modifica del Codice di Rete per implementare e attuare una metodologia per l’identificazione delle macrozone dinamiche, ai fini della determinazione del segno di sbilanciamento macrozonale e del relativo prezzo di sbilanciamento, nonché gli esiti della consultazione pubblica con le risposte dei soggetti interessati e le eventuali controargomentazioni sull’accettabilità o meno degli spunti pervenuti;
- la metodologia proposta da Terna prevede l’aggregazione dinamica delle zone di mercato in macrozone libere da congestioni secondo un confronto ricorsivo tra i transiti commerciali di energia elettrica in esito ai processi di bilanciamento (ivi inclusi MB e le piattaforme di bilanciamento europee) tra zone di mercato confinanti e i relativi limiti ammissibili residui a valle del mercato del giorno prima (MGP) e del mercato infragiornaliero (MI). Tale proposta è emersa a valle del confronto di simulazioni quantitative con altre due possibili opzioni: la prima basata sul confronto tra i flussi fisici effettivi del tempo reale e i relativi limiti per i transiti zonalmente (in linea con i suggerimenti dell’Autorità indicati nel documento per la consultazione 292/2021/R/eel) e la seconda basata sul mantenimento delle singole zone isolate, rinunciando a qualsiasi aggregazione dinamica;
- in particolare, la proposta formulata da Terna prevede di calcolare i transiti commerciali di energia in esito al bilanciamento per ciascun periodo rilevante come differenza tra le quantità accettate su MSD ex ante, MB ed in esito alle piattaforme di bilanciamento europee e il fabbisogno di energia da bilanciare di un dato aggregato progressivo zonale, determinato con la formula per il calcolo dello sbilanciamento

aggregato zonale di cui all'articolo 39 della deliberazione 111/06. Tale valore è poi confrontato con i limiti di transito zonali residui in esito ai mercati dell'energia. Partendo dalla zona Sicilia, si valuta la presenza o meno di una congestione sull'interconnessione zonale con la zona Calabria; in assenza di congestione, le due zone si considerano appartenenti alla medesima macrozona e si procede a valutare la presenza di congestione con la zona Sud. In caso contrario, la zona Sicilia costituirà una macrozona a sé e la procedura ricomincia a partire dalla zona Calabria;

- la presenza di una maglia tra le zone Sardegna, Centro Nord e Centro Sud ha richiesto a Terna lo sviluppo di una metodologia dedicata per ripartire i flussi commerciali sui rami della maglia, basata su un'ottimizzazione che massimizzi uno di questi flussi, calcolando per differenza i restanti due. Al contrario, se la conformazione zonale del sistema italiano fosse puramente radiale, la procedura ricorsiva consentirebbe di identificare in maniera univoca le sezioni congestionate e le relative macrozone.

CONSIDERATO, INFINE, CHE:

- le proposte di modifica al Codice di Rete inviate con la comunicazione 19 luglio 2023 tengono conto delle risposte inviate dai soggetti interessati alla consultazione pubblica svolta da Terna;
- in particolare, per quanto riguarda la metodologia per l'identificazione delle macrozone libere da congestione, alcuni operatori si sono espressi a favore della proposta di Terna; altri operatori hanno manifestato preferenza per la terza opzione, ovvero quella di non procedere con alcuna aggregazione dinamica e determinare il prezzo di sbilanciamento considerando il solo perimetro della zona di mercato, ritenendola superiore in termini di segnali di prezzo, allocazione dei costi e ridotta aleatorietà nei processi previsionali degli operatori. Tuttavia, la maggior parte dei soggetti non ha espresso preferenza per alcuna delle opzioni, richiedendo una base di dati più ampia e un insieme di simulazioni più esteso, con la pubblicazione dei prezzi e dei segni di sbilanciamento che si formerebbero con le tre diverse ipotesi;
- i soggetti favorevoli alla proposta di Terna hanno suggerito di includere nel calcolo del prezzo di sbilanciamento, nel caso di congestione tra macrozone, il contributo dell'energia di bilanciamento proveniente dalle macrozone adiacenti, per un quantitativo pari alla capacità saturata. Terna non ha accolto tale spunto perché fuori dal contesto della consultazione;
- Terna non ha accolto la richiesta di estendere le simulazioni su ulteriori periodi temporali e di pubblicare i relativi prezzi e segni di sbilanciamento in quanto le simulazioni sono funzionali solamente a mostrare i principi di funzionamento tra le opzioni;
- la quasi totalità degli operatori ha manifestato esigenze di trasparenza, chiedendo di pubblicare i fabbisogni di bilanciamento degli aggregati progressivi di zone di mercato, le quantità accettate in MSD e MB e i limiti di transito residui a valle dei mercati dell'energia; Terna non ha accolto gli spunti ritenendo sufficienti i dati già disponibili attraverso i canali di trasparenza in essere, come il sito del gestore di rete e la *transparency platform* di ENTSOE;

- la quasi totalità degli operatori ha richiesto lo svolgimento di un adeguato periodo di prove in bianco (variabile dai 6 ai 12 mesi), che consenta, tra l'altro, di valutare gli impatti della nuova disciplina sui prezzi di sbilanciamento della Sardegna. Molti operatori hanno suggerito di far coincidere l'avvio della nuova metodologia con l'inizio dell'anno solare e possibilmente con il primo gennaio 2025, data di entrata in vigore del Testo Integrato del Dispacciamento Elettrico, di cui alla deliberazione 345/2023/R/eel. Terna ha accolto le richieste di svolgere un adeguato periodo di prove in bianco e di approfondire gli impatti sui prezzi di sbilanciamento, con particolare riferimento alla zona Sardegna, rimandando alla decisione dell'Autorità in merito alla data di entrata in vigore della metodologia in oggetto.

RITENUTO CHE:

- le proposte di modifica al Codice di Rete inviate da Terna con la comunicazione 19 luglio rispettino i principi stabiliti dalla deliberazione 523/2021/R/eel e che quindi l'approccio metodologico adottato da Terna sia condivisibile;
- rispetto a quanto suggerito dall'Autorità nel documento per la consultazione 292/2021/R/eel, la proposta di metodologia per l'identificazione dinamica delle macrozone elaborata da Terna consenta di definire le congestioni sui transiti zionali direttamente dagli esiti dei mercati, superando la necessità di definire una soglia arbitraria per stabilire se la somma dei flussi fisici effettivi, che per loro natura sono variabili nel tempo anche all'interno di un medesimo periodo rilevante, superi o meno il limite di transito, fornendo quindi una comparazione più oggettiva;
- il miglior segnale di prezzo per gli utenti del dispacciamento e di conseguenza la migliore allocazione dei costi si ottenga determinando un prezzo di sbilanciamento che rispecchi le effettive congestioni verificatesi in tempo reale e che quindi non sia opportuno né corretto considerare le singole zone di mercato in maniera indipendente, poiché questo approccio non risolve e anzi enfatizza le problematiche odierne relative all'identificazione delle aree libere da congestione al cui interno il bilanciamento avviene senza limitazioni di rete. Come già riportato nel documento per la consultazione 292/2021/R/eel, la metodologia è funzionale a ricostruire ex-post gli esiti di un ipotetico mercato zonale del tempo reale e i relativi aggregati zionali liberi da congestione;
- sebbene le simulazioni presentate durante la consultazione da Terna siano funzionali solamente a mostrare i principi di funzionamento delle diverse opzioni metodologiche, sia opportuno accogliere le richieste di maggior trasparenza avanzata da molti operatori, prevedendo la pubblicazione dei dati relativi alla futura applicazione della metodologia e un opportuno periodo di prove in bianco non inferiore ai 6 mesi. A tal proposito si ritiene opportuno che durante tale periodo siano pubblicati tempestivamente gli esiti dell'applicazione della metodologia e che sia organizzato almeno un seminario divulgativo con gli operatori per condividere e discutere le evidenze del periodo di test;
- sia opportuno approfondire la proposta avanzata da alcuni operatori di includere nel calcolo del prezzo di sbilanciamento, nel caso di congestione tra macrozone, il

contributo dell'energia di bilanciamento proveniente dalle macrozone adiacenti, per un quantitativo pari alla capacità saturata, ma che tale approfondimento sia relativo ad eventuali aggiustamenti della disciplina degli sbilanciamenti e pertanto fuori dallo scopo del presente provvedimento;

- sia inoltre opportuno accogliere le richieste degli operatori di far corrispondere l'avvio della nuova metodologia con l'entrata in vigore del TIDE, con l'armonizzazione del periodo rilevante di sbilanciamento a 15 minuti e possibilmente con l'inizio dell'anno solare;
- sia opportuno, durante il periodo di prove in bianco, prendere in considerazione come ulteriore elemento di confronto gli esiti della piattaforma di bilanciamento MARI, di cui all'articolo 20 del Regolamento *Balancing*, alla quale Terna dovrebbe connettersi entro luglio 2024, ai sensi della deliberazione 46/2022/R/eel. Infatti, MARI costituirà il mercato di bilanciamento zonale più vicino al tempo reale, i cui esiti potrebbero pertanto fornire direttamente una buona rappresentazione delle congestioni zonali del tempo reale, senza ricorrere alle metodologie di calcolo prospettate nel documento per la consultazione 292/2021/R/eel, nelle more dell'implementazione della piattaforma stessa.

RITENUTO, INFINE, CHE:

- il testo del Codice di Rete che introduce le modifiche sia migliorabile nella descrizione della metodologia:
 - per quanto riguarda il processo iterativo, dovrebbe chiarire che, quando si identifica una congestione e il processo iterativo riparte dalla zona di mercato successiva, nel computo dell'energia complessiva in importazione o esportazione rientra anche la quantità scambiata sul confine congestionato;
 - nel processo esplicativo della risoluzione della maglia, dovrebbe esplicitare il collegamento sul quale si massimizza il transito di energia, in modo da rendere univocamente determinabile l'esito della procedura;
- le modifiche di cui al precedente alinea possano essere implementate direttamente da Terna, senza ulteriori processi di verifica;
- sia quindi opportuno approvare le modifiche al codice di rete, previa attuazione da parte di Terna delle modifiche di cui ai precedenti alinea, subordinando tuttavia l'effettiva entrata in vigore alla verifica, da parte dell'Autorità, degli esiti delle prove in bianco

DELIBERA

1. di approvare la proposta di modifica del Codice di Rete inviata dalla società Terna S.p.A. con la comunicazione 19 luglio 2023, previa attuazione da parte di Terna delle integrazioni presentate nella parte motiva del presente provvedimento;
2. di prevedere che Terna predisponga un piano di lavoro che includa un periodo temporale di almeno 6 mesi per le prove in bianco, un seminario divulgativo per gli

operatori e l'invio all'Autorità di una relazione conclusiva sul periodo di test, il tutto con un congruo anticipo affinché le modifiche al Codice di rete di cui al punto 1 possano trovare applicazione dal primo gennaio 2025, ferme restando diverse disposizioni derivanti dalla verifica, da parte dell'Autorità, degli esiti delle prove in bianco;

3. di prevedere che Terna, durante il periodo di prove in bianco, pubblichi tempestivamente gli esiti dell'applicazione della metodologia, in termini di perimetro delle macrozone e prezzi di sbilanciamento, includendo come elemento comparativo anche le configurazioni zonali risultanti dalla piattaforma MARI;
4. di trasmettere copia del presente provvedimento alla società Terna S.p.A. e al Ministero dell'Ambiente e della Sicurezza energetica;
5. di pubblicare il presente provvedimento sul sito internet dell'Autorità www.arera.it.

10 ottobre 2023

IL PRESIDENTE
Stefano Besseghini