

# **Konzept Primärkapazitätsplattform 6.0**

## **Stand 15.11.2012**

**bayernets GmbH**

**Fluxys TENP GmbH**

**GASCADE Gastransport GmbH**

**Gastransport Nord GmbH**

**Gasunie Deutschland Transport Services GmbH**

**Gasunie Ostseeanbindungsleitung GmbH**

**GRTGaz Deutschland GmbH**

**jordgasTransport GmbH**

**Nowega GmbH**

**ONTRAS – VNG Gastransport GmbH**

**OPAL NEL TRANSPORT GmbH**

**Open Grid Europe GmbH**

**Terranets bw GmbH**

**Thyssengas GmbH**

# Inhaltsverzeichnis

Inhaltsverzeichnis .....	2
1. Einleitung .....	3
2. Ausgestaltung der gemeinsamen Kapazitätsplattform .....	5
3. Wichtige Rahmenbedingungen der gemeinsamen Kapazitätsplattform .....	6
4. Anforderungen an einen auktionenbasierten Vergabemechanismus .....	9
5. Produktgestaltung und Auktionsprozess .....	11
5.1. Standardprodukte .....	11
5.2. Auktionskalender .....	13
5.3. Auktionsprozess .....	14
5.3.1. Mehrstufiges Auktionsverfahren .....	14
5.3.1.1. Ausgestaltung der Gebotsfenster .....	15
5.3.1.2. Ausgestaltung der Preisschritte .....	17
5.3.1.3. Abfolge der Gebotsfenster .....	18
5.3.1.4. Ausgestaltung der Gebotsfenster im Falle eines Undersells .....	19
5.3.2. Einstufiges Auktionsverfahren .....	22
5.3.3. Markträumungspreis .....	25
5.4. Umwandlung von unterbrechbaren Kapazitäten .....	26
6. Vergabe von nicht auktionenpflichtigen Primärkapazitäten .....	28

# 1. Einleitung

Mit der Novelle der Gasnetzzugangsverordnung (GasNZV) im Jahr 2010 sind die deutschen Fernleitungsnetzbetreiber gemäß § 12 Abs. 1 verpflichtet worden, für die Vergabe von Ein- und Ausspeisekapazitäten zum 01.08.2011 eine gemeinsame Plattform zur Vergabe von Primärkapazitäten einzurichten und ab diesem Zeitpunkt zu betreiben. An Grenz- und Marktgebietsübergangspunkten werden seitdem feste Primärkapazitäten über die Plattform TRAC-X primary versteigert.

Die GasNZV legt in diesem Zusammenhang Rahmenbedingungen für die Gestaltung und Laufzeit von Kapazitätsprodukten sowie für deren Vergabe im Rahmen eines Auktions- oder Buchungsverfahrens fest. In ihrer Festlegung in Sachen Kapazitätsregelungen und Auktionsverfahren im Gassektor (Az.: BK7-10-001; KARLA) beschreibt die Beschlusskammer 7 der Bundesnetzagentur zudem verschiedene Anforderungen an die Auktion von Primärkapazitäten. Gemäß dieser Festlegung galt das „Konzept Primärkapazitätsplattform“ in der Version 4.0 als abgestimmt, jedoch mit einigen Maßgaben, die in eine im Juni 2011 veröffentlichte Version 5.0 eingearbeitet wurden.

Hintergrund der nun vorgelegten Version 6.0 des Plattformkonzeptes ist, dass sich die Gesellschafter der TRAC-X primary entschieden haben, ihre Erfahrungen im Bereich der Kapazitätsplattformen mit denen vierer benachbarter Fernleitungsnetzbetreiber (Fluxys SA aus Belgien, Gas Transport Services B.V. aus den Niederlanden, GRTgaz aus Frankreich und Energinet.dk aus Dänemark) und mithin das umfangreiche Know-how aus dem Betrieb von drei bestehenden Plattformen in Europa – Capsquare, Link4Hubs und TRAC-X primary – zu bündeln und eine gemeinsame Plattform zu entwickeln.

Ziel ist es, ab April 2013 so weit wie möglich neue Funktionalitäten auf der neuen Plattform anzubieten, die den Regeln des *Network Code on Capacity Allocation Mechanisms* (NC CAM)<sup>1</sup> entsprechen, welcher in absehbarer Zeit neue Rahmenbedingungen für die Kapazitätsvergabe darstellen wird. Die beteiligten Fernleitungsnetzbetreiber gehen damit einen ersten wesentlichen Schritt hin zu einer Harmonisierung der Primärkapazitätsvermarktung in Europa. Da die deutschen Fernleitungsnetzbetreiber gleichzeitig weiterhin die Anforderungen der Gasnetzzugangsverordnung sowie von KARLA erfüllen, erfolgt mit der neuen Plattform

---

<sup>1</sup> Zur Information: Der erste Entwurf des finalen *Network Code on Capacity Allocation Mechanisms* (NC CAM) wurde der *Agency for the Cooperation of Energy Regulators* (ACER) am 6. März 2012 durch den Europäischen Verband der Fernleitungsnetzbetreiber (ENTSOG) vorgelegt. Sofern in diesem Konzeptpapier auf den NC CAM verwiesen wird, handelt es sich dabei – wenn nicht ausdrücklich angemerkt – um diese erste Entwurfsfassung des NC CAM, der unter dem folgenden Link auf den Internetseiten von ENTSOG zum Download bereitsteht: <http://goo.gl/50txB>.

keine vollständige Umsetzung des NC CAM, da dies erst erfolgen kann, wenn der NC CAM rechtlich verbindliches Europäisches Recht darstellt.

Die derzeit gemeinschaftlich von allen beteiligten Fernleitungsnetzbetreibern betriebene Realisierung der neuen Primärkapazitätsplattform setzt auf bestehende Funktionalitäten der deutschen Kapazitätsplattform TRAC-X primary auf. Die europäische Ausrichtung der Plattform bringt aber auch teilweise neue Regeln und veränderte Prozesse für die Plattformnutzer mit sich. Die deutschen Fernleitungsnetzbetreiber möchten daher in Abstimmung mit der Bundesnetzagentur dieses Konzeptpapier nutzen, um auf Basis der bereits beschriebenen und bekannten Prozesse und Regeln möglichst transparent über Anpassungen und Veränderungen zu informieren.

Im Folgenden werden wichtige konzeptionelle Inhalte zu den Themenkomplexen Produktgestaltung, Auktionsprozess und zur Ausgestaltung der Primärkapazitätsplattform dargestellt. Wesentliche Änderungen im Vergleich zur Version 5.0 dieses Konzeptpapiers sind dabei in den folgenden Bereichen vorgenommen worden:

- Gestaltung der Standardprodukte (Anpassung an Vermarktungslogik des NC CAM)
- Gestaltung des Auktionskalenders (Anpassung an den im NC CAM vorgesehenen Kalender)
- Ausgestaltung der Preisschritte (Anpassung der Preisgestaltung an Vorgaben des NC CAM)
- Ausgestaltung von Day-Ahead-Auktionen (Anpassung des gesamten Auktionsalgorithmus an Vorgaben des NC CAM)

Zu Gunsten einer verbesserten Lesbarkeit wurde zudem die Struktur des Dokuments marginal angepasst.

## **2. Ausgestaltung der gemeinsamen Kapazitätsplattform**

Die Vermarktung von allen festen Primärkapazitäten an Grenz- und Marktgebietsübergangspunkten (GÜPs und MÜPs) in Auktionsverfahren wird – wie bisher über die TRAC-X primary – für alle deutschen Fernleitungsnetzbetreiber über die neue Plattform erfolgen. Der Fernleitungsnetzbetreiber bleibt dabei der Vertragspartner der Transportkunden. Die Vergabe von nach GasNZV nicht auktionspflichtigen Primärkapazitäten (u.a. unterbrechbare Kapazitäten an GÜP und MÜP, Ein- und Ausspeisekapazitäten zu Letztverbrauchern und Speichern, ...) wird grundsätzlich ebenfalls über die neue Plattform abgewickelt.

### **3. Wichtige Rahmenbedingungen der gemeinsamen Kapazitätsplattform**

In diesem Kapitel sollen Fragen hinsichtlich der Ausgestaltung der neuen Plattform beantwortet werden.

#### **Wie wird die Anonymität auf der Plattform sichergestellt?**

Um die Anonymität des Handelsvorgangs, der abgeschlossen ist, wenn der Auktionsprozess mit Zuteilung der Kapazitäten erfolgt ist, gegenüber Dritten zu gewährleisten, berücksichtigt die neue Plattform die bereits bei der Entwicklung der TRAC-X primary zugrunde gelegten Vorgaben:

Die Plattform hält die einzelnen Gebote der Transportkunden solange anonym, bis das Auktionsverfahren abgeschlossen ist. Allein die Summe der Gebote der Vorrunde wird zu Beginn eines neuen Gebotsfensters bekannt gegeben. Die Einsichtnahme in den laufenden Auktionsprozess, z.B. das Anzeigen von Anbietern, Mengen und Preisen, ist auch für die Fernleitungsnetzbetreiber nicht möglich. Die Bieter bleiben überdies untereinander dauerhaft anonym. Damit ist gewährleistet, dass lediglich der jeweilige Bieter die Kenntnis hat, an welcher Auktion er selbst teilnimmt. Allerdings ist bei jeder Auktion im Vorhinein ersichtlich, mit welchem Netzbetreiber nach einem erfolgreichen Zuschlag ein Vertrag zustande kommen würde.

Erst die erfolgreichen Gebote, der entsprechende Markträumungspreis sowie die erfolgreichen Bieter werden dem Fernleitungsnetzbetreiber, mit dem insoweit ein wirksamer Kapazitätsvertrag zustande kommen soll, mitgeteilt. Zudem erhält der Fernleitungsnetzbetreiber die nicht erfolgreichen Gebote, da diese eine Verweigerung des Netzzugangs im Sinne des § 20 Abs. 2 Energiewirtschaftsgesetz darstellen können, die der BNetzA mitzuteilen sind. Darüber hinaus sind diese Informationen auch über nicht erfolgreiche Gebote notwendig, damit die Fernleitungsnetzbetreiber diese u.a. auch in der nach § 17 GasNZV vorgeschriebenen jährlichen Ermittlung des langfristigen Kapazitätsbedarfs berücksichtigen können.

#### **Wie ist der Betrieb der Plattform geplant?**

Der technische Betrieb wird durch einen unabhängigen Dienstleister sichergestellt. Dieser Dienstleister ist zudem für die Erstellung des Pflichtenheftes und dessen Implementierung verantwortlich. Zur Realisierung des Auktionsmechanismus und der Buchungsfunktionalität kommen dabei weiterhin Module der Deutschen Börse Systems zum Einsatz.

## **In welcher Art erfolgt die technische Umsetzung der neuen Plattform?**

Die technische Umsetzung der Plattform basiert auf derer der TRAC-X primary, d.h. sie erfolgt in einer dedizierten Systemarchitektur, bestehend u.a. aus Application Server, Webservice Cluster und Kommunikationsplattform. Die funktionalen Anforderungen, die aus den Prozessen resultieren (z.B.: Transportkunden-Userregistrierung, Auktionierung von Primärkapazitäten und Buchung von nicht-auktionspflichtigen Kapazitäten) werden auf der Plattform realisiert. Dazu ist weiterhin eine hohe Integration zwischen den Backend-Systemen der Fernleitungsnetzbetreiber und der Plattform erforderlich.

Die Daten- und Zugriffssicherheit des Handelsvorgangs auf der Plattform wird durch mehrere Maßnahmen gewährleistet. So haben nur benannte und berechtigte Teilnehmer Zugang zu Geschäftsvorgängen auf der Plattform. Dies wird durch einen eindeutigen Prozess zur Kundenregistrierung erreicht, den Transportkunden durchlaufen müssen, bevor sie an Auktionen teilnehmen oder Buchungen durchführen können. Die Registrierung erfolgt für die Plattform und für jeden Fernleitungsnetzbetreiber separat, aber durch einen koordinierten Vorgang über die Plattform (nur ein „Klick“ des Transportkunden für die Registrierungen erforderlich).

Sicherheitsanforderungen (Logging, Monitoring und Audits) regeln den Zugriff auf die Plattform, den Zugriff auf die Backend-Systeme der Fernleitungsnetzbetreiber sowie die Dokumentation dieser Zugriffe. Der Zugang registrierter User erfolgt über Login mit Hilfe eines Tokens als Authentifizierungsmethode (Benutzername + Token-Code). Der Zugriff auf Funktionen und Bereiche erfolgt rollenbasiert, d.h. jeder Nutzer kann nur diejenigen Informationen aufrufen, die für ihn bzw. seine Rolle relevant sind. Die Kommunikation zwischen Plattform und den Systemen der Fernleitungsnetzbetreiber erfolgt immer über einen gesicherten und verschlüsselten Kanal. Das gilt auch für die Kommunikation von Informationen zwischen den Transportkunden und der Plattform, die einen Login erfordert. Ein sog. Logging stellt sicher, dass alle Aktionen der Plattform revisionssicher vom Plattformbetreiber dokumentiert werden.

## **Muss sich ein bereits auf der TRAC-X primary registrierter Transportkunde für die neue Plattform erneut registrieren?**

Nutzer, die den Registrierungsprozess über die TRAC-X primary bereits erfolgreich durchlaufen haben, müssen sich für die neue Plattform nicht erneut registrieren. Im Zeitraum vom 1. Januar 2013 bis 15. Februar 2013 wird die neue Plattform allerdings von einem erfolgreich eingeloggteten Transportkunden gegebenenfalls zusätzliche Informationen abfragen, die er sonst im regulären Registrierungsprozess hätte angeben müssen. Dabei handelt es sich im Wesentlichen um folgende Daten:

- EIC (komplett neu und zwingende Voraussetzung für den Erwerb von Kapazitäten)
- VAT-Nummer (sofern noch nicht angegeben)
- IBAN (sofern noch nicht angegeben)
- BIC (sofern noch nicht angegeben)

Der Grund hierfür liegt darin, dass die neue Plattform europäischen Normen für Shipper-Identifikation, Steuernummern und Bankverbindungen benutzen wird. Der DVWG-Code wird zukünftig nicht mehr als Shipper-Identifizier benutzt, aber bleibt als Zusatzinformation für in Deutschland aktive Shipper erhalten.



## 4. Anforderungen an einen auktionsbasierten Vergabemechanismus

Die GasNZV legt in § 11 fest, dass als Kapazitätsprodukte mindestens Jahres-, Quartals-, Monats- und Tagesprodukte anzubieten sind. Besonderer Fokus liegt dabei auf den Grenz- und Marktgebietsübergangspunkten, an denen für alle Produkte mit festen Kapazitätsrechten ein Auktionsverfahren angewendet werden muss. Zusätzlich dazu wird durch die Festlegung der Bundesnetzagentur (Az.: BK7-10-001) in § 2 des Standardkapazitätsvertrags Gas definiert, dass feste und unterbrechbare Kapazitätsprodukte an Grenz- und Marktgebietsübergangspunkten gebündelt zu vermarkten sind. Unter Berücksichtigung bestehender Altverträge und eventuell abweichender Vereinbarungen mit ausländischen Netzbetreibern kann es außerdem auch zur ungebündelten Vermarktung von Kapazitäten an diesen Punkten kommen. Vorgenannten Anforderungen werden die Fernleitungsnetzbetreiber – trotz teilweiser Anpassung an Vorgaben des NC CAM – auch bei der Vermarktung der Primärkapazitäten über die neue Plattform gerecht. Dabei gilt für die Entwicklung der neuen Plattform weiterhin die wichtige Prämisse der Beibehaltung von einfachen, transparenten und für alle Teilnehmer verständlichen Prozessen und Produkten. Die Vermarktung der Primärkapazitäten wird für Transportkunden und Fernleitungsnetzbetreiber weiterhin effizient und transparent durchführbar sein.

Aufgrund der Anforderungen an Transparenz und Diskriminierungsfreiheit der GasNZV an die Primärkapazitätsplattform hinsichtlich des Auktionsverfahrens orientiert sich der für die Plattform TRAC-X primary entwickelte Auktionsalgorithmus an folgenden Vorbedingungen:

- Alle parallelen Auktionen eines Kapazitätsproduktes sollen gleichzeitig zu einem vorher bekannten Zeitpunkt beginnen. Dadurch wird das Bieterverhalten in einer Auktion das Ergebnis einer anderen Auktion möglichst wenig beeinflussen. Ferner sind manche Produkte, beispielsweise konkurrierende Kapazitäten, zwingend in parallelen bzw. synchronen Auktionen zu vergeben.
- Auch wenn das genaue zeitliche Ende einer Auktion nicht im Vorhinein feststeht (bei mehrstufigen Auktionsverfahren), muss das Auktionsverfahren gewährleisten, dass die Gebotsschritte eine zügige Konvergenz zum markträumenden Preis erzielen.
- Da Transportkunden an vielen parallelen Auktionen teilnehmen können sollen, darf kein Anreiz bestehen ‚in letzter Sekunde‘ ein Gebot abzugeben, so dass auch Transportkunden mit einer geringen Personalausstattung an allen gewünschten Auktionen gleichzeitig und mit gleichen Erfolgchancen teilnehmen können.
- Transportkunden sollen bewusst entscheiden können, ob sie zu einem bestimmten Preis eine Kapazität erwerben wollen oder aus dem Auktionsprozess aussteigen.
- Der markträumende Preis soll sich aufgrund möglichst weniger Vorgaben des Aukti-

onsverfahrens ausschließlich aus den Geboten der Auktionsteilnehmer ergeben und damit die potentielle Knappheit des Kapazitätsproduktes widerspiegeln.

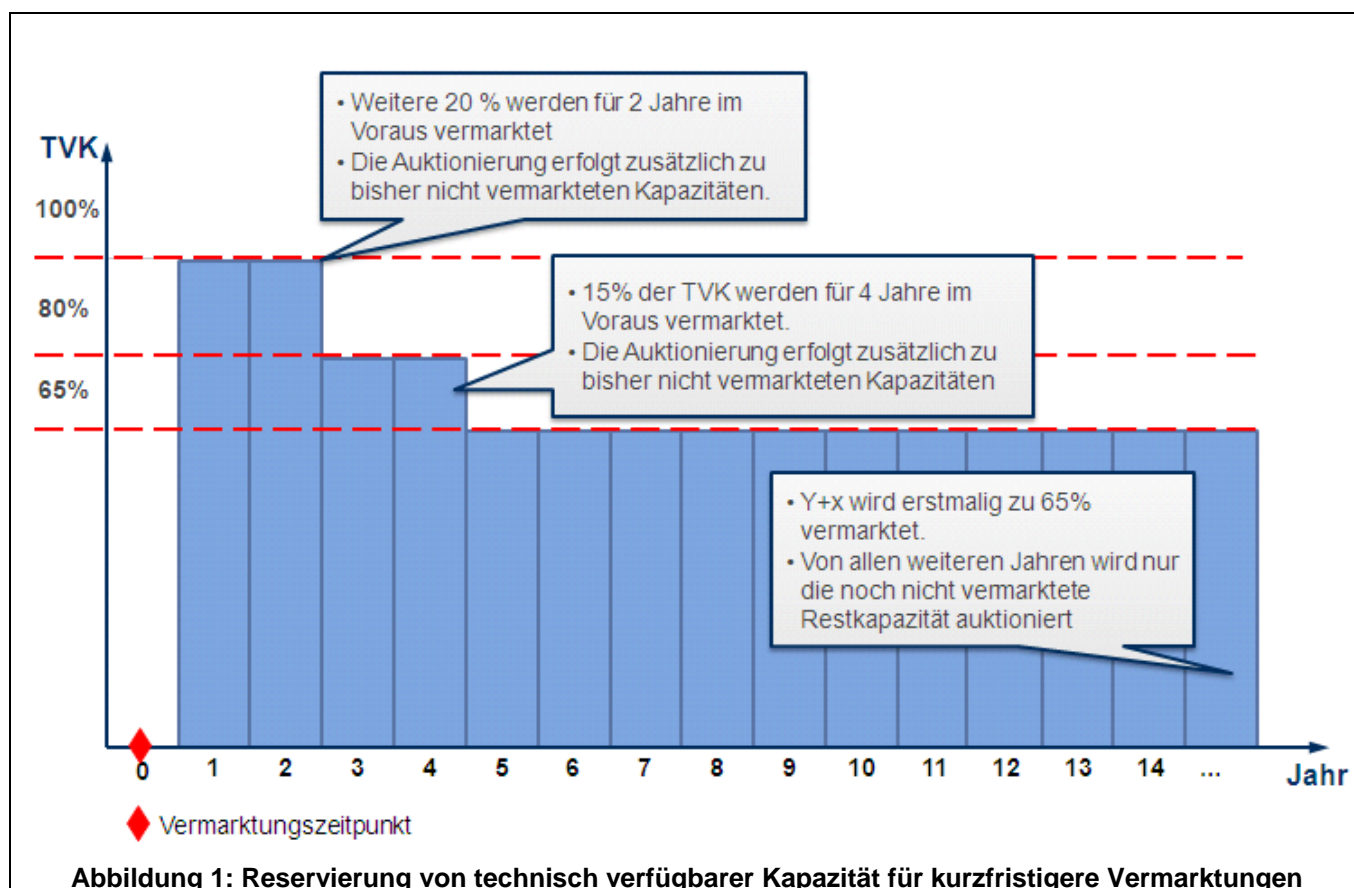
- Die Anonymität der Auktionsteilnehmer untereinander muss ständig und gegenüber dem Netzbetreiber bis zum Ende der Auktion gewahrt sein. Es sollen keine Rückschlüsse durch das Beobachten der Anpassung der Gebote anderer Teilnehmer auf deren Identität möglich sein. Außerdem sollen die Fernleitungsnetzbetreiber Informationen über einzelne Gebote erst nach Ende der Auktion erhalten, um potentielle Diskriminierung in jedem Fall zu verhindern.
- Die Kosten einer zukünftigen Anpassung der Plattform oder Auktionssysteme an Vorgaben durch sich verändernde oder weitere europäische Regulierungsvorschriften sollen möglichst gering gehalten werden.

## 5. Produktgestaltung und Auktionsprozess

Im Folgenden werden die Konzepte zur Ausgestaltung der Standardkapazitätsprodukte und des Auktionsprozesses beschrieben. Die hier vorgestellten Konzepte beschränken sich zunächst auf die Vergabe von festen, frei zuordenbaren Kapazitäten (FZK). Die Auktionsprozesse für weitere Kapazitätsarten bauen auf diesen Prinzipien auf.

### 5.1. Standardprodukte

§ 14 Abs. 1 GasNZV schreibt vor, dass an den Punkten, deren Kapazitäten in Auktionen vergeben werden, 20% beziehungsweise 35% der technisch verfügbaren Kapazität (TVK) nur für maximal zwei beziehungsweise vier Jahre im Voraus vergeben werden können. Abbildung 1 zeigt diesen Zusammenhang. Mit Y wird hierbei das laufende Gasjahr definiert.



§ 11 Abs. 1 GasNZV legt fest, dass als Kapazitätsprodukte mindestens Jahres-, Quartals-, Monats- und Tagesprodukte anzubieten sind. Bei diesen Kapazitätsprodukten handelt es sich um Kapazitätsrechte mit einer Vertragslaufzeit von einem Jahr, einem Quartal, einem Monat bzw. einem Tag. Jahresprodukte beginnen jeweils zum Gaswirtschaftsjahr am 1.10. eines Jahres.

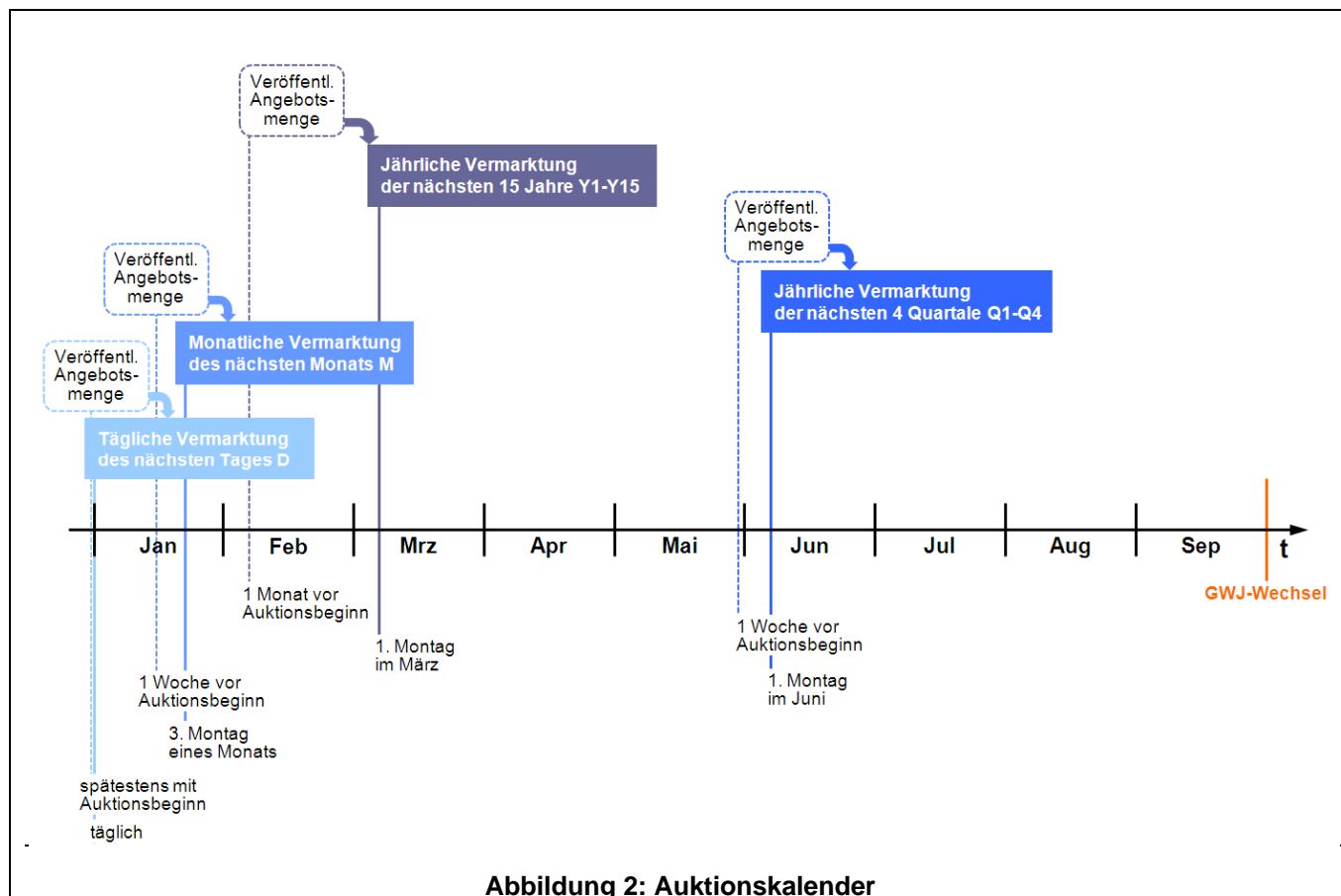
Um einfache und transparente Auktionen zu gewährleisten, soll sichergestellt werden, dass verfügbare Kapazitäten zu einem Vermarktungszeitpunkt nur in einem Produkt und einer Auktion vermarktet werden. Dies bedeutet beispielsweise, dass die komplette verfügbare und vermarktbar Kapazität für das Jahr 2018 (65% Regel) bei einer Auktion im Jahr 2014 nur in Jahresprodukten versteigert wird. Zu diesem Vermarktungszeitpunkt sollen keine weiteren Produkte für dieses Jahr angeboten werden. Verbleibende Restkapazitäten oder neu hinzugekommene, vermarktbar Kapazitäten werden erst zu einem späteren Vermarktungszeitpunkt (z.B. 2016) erneut angeboten. Eine Vorstrukturierung und gleichzeitige Vermarktung von Jahres-, Quartals- und Monatsprodukten für das Jahr 2018 halten die Fernleitungsnetzbetreiber für nicht zielführend und ist gemäß NC CAM auch nicht vorgesehen. Die Fernleitungsnetzbetreiber müssten hierzu die verfügbare Kapazität zunächst nach einer willkürlich zu treffenden Quotierung vorstrukturieren. Je nach angewandter Quotierung kann es hierbei zu einer unerwünschten Diskriminierung von Marktteilnehmern kommen.

Unter Berücksichtigung des NC CAM haben sich die Fernleitungsnetzbetreiber auf folgende Produktstrukturierung verständigt:

- Standardprodukt Jahr: jährliche Auktionen der Produkte Y1-Y15
- Standardprodukt Quartal: jährliche Auktionen der Produkte Q1-Q4
- Standardprodukt Monat: monatliche Auktion des Produktes M
- Standardprodukt Tag: tägliche Auktion des Produktes D

## 5.2. Auktionskalender

Unter Berücksichtigung des NC CAM gilt ab dem 01.04.2013 der folgende, neu konzipierte Auktionskalender:



Die genauen Starttermine werden immer frühzeitig auf der Plattform bekannt gegeben und können jederzeit eingesehen werden:

- Jahreskapazitäten Y1 bis Y15: Start der Auktion jeweils am 1. Montag im März (erstmalig im März 2014)
- Bekanntgabe der Angebotsmenge eine Monat vor Auktionsbeginn

Quartalskapazitäten Q1 bis Q4:

- Start der Auktion jeweils am 1. Montag im Juni (erstmalig im Juni 2013)
- Bekanntgabe der Angebotsmenge eine Woche vor Auktionsbeginn

Monatskapazitäten M:

- Start der Auktion jeweils am 3. Montag eines Monats M-1 (erstmalig im April 2013)
- Bekanntgabe der Angebotsmenge eine Woche vor Auktionsbeginn

Tageskapazitäten D:

- Start der Auktion jeweils an D-1 um 16:30 Uhr<sup>2</sup>
- Bekanntgabe der Angebotsmenge spätestens mit Auktionsbeginn

Jahres-, Quartals-, und Monatskapazitäten werden in zeitlichen Sequenzen, sogenannten „Auktionsslots“, durchgeführt. Dabei können in einem Slot Produkte unterschiedlicher Kapazitätsarten gleichzeitig mit dem gleichen Mechanismus versteigert werden. Das bedeutet beispielsweise, dass an einem Punkt in einer Jahresauktion gleichzeitig FZK- und BZK-Produkte versteigert werden. Für den Fall, dass die Höhe eines Kapazitätsprodukts nur in Abhängigkeit der Versteigerung eines anderen ermittelt werden kann, startet für Auktionen von Jahres-, Quartals- und Monatsprodukten am darauffolgenden Tag ggf. ein weiterer Auktionsslot und nach diesem ggf. noch weitere. Die Angebotsmenge sowie die Kapazitätsart werden dann mindestens 2 Stunden vor dem Start der Auktion bekannt gegeben.

Aufgrund einheitlicher Auktionstermine in Europa gemäß NC CAM wird keine Rücksicht auf Sonn- und Feiertage genommen.

### 5.3. Auktionsprozess

Für Kapazitätsprodukte mit einer Laufzeit länger als einem Tag wird ein mehrstufiges Auktionsverfahren implementiert (siehe Abschnitt 5.3.1). Für Kapazitätsprodukte mit einer Laufzeit von einem Tag wird ein einstufiges Auktionsverfahren implementiert (siehe Abschnitt 5.3.2).

#### 5.3.1. Mehrstufiges Auktionsverfahren

Das mehrstufige Auktionsverfahren folgt folgenden Prinzipien:

- Ausgehend vom regulierten Entgelt werden Preise in aufsteigender Folge in jeweils zeitlich begrenzten Gebotsfenstern so lange aufgerufen, bis die Summe der Mengengebote kleiner oder gleich der angebotenen Kapazitätsmenge ist. Der Preis wird also von der Plattform vorgegeben, die Transportkunden geben lediglich die Menge an, die sie zum aufgerufenen Preis buchen wollen.
- Der aufgerufene Preis steigt in vorher festgelegten Schritten an.
- Mit „großen Preisschritten“ wird eine zügige Konvergenz zum markträumenden Preis erreicht und ein Preiskorridor ermittelt, innerhalb dessen der markträumende Preis liegt.
- Mit anschließenden „kleinen Preisschritten“ (nach einem sogenannten Undersell) wird der markträumende Preis innerhalb des zuvor festgestellten Preiskorridors ermittelt.

*Begründung:*

<sup>2</sup> Sämtliche Uhrzeiten in diesem Dokument entsprechen Mitteleuropäischer (Sommer-)Zeit (ME(S)Z).

### Ausgestaltung des Auktionsverfahrens:

Das hier beschriebene Auktionsverfahren findet den markträumenden Preis durch mehrere Preiserhöhungen um große Preisschritte, ggf. einem einzigen Rückschritt und einer begrenzten Anzahl weiterer Preiserhöhungen um kleine Preisschritte. Dieses Modell erscheint den Fernleitungsnetzbetreibern im Gegensatz zu einem denkbaren alternativen Verfahren, bei dem der markträumende Preis mittels mehrfachem Ab- und Ansteigen des Auktionspreises ermittelt wird, als wesentlich einfacher, gradliniger und transparenter.

### Wahl der Anwendung von „großen“ sowie „kleinen“ Preisschritten:

Während durchgängig (d.h. vom ersten Gebotsfenster an) kleine Schritte zwar sicherstellen, dass der markträumende Preis nicht verfehlt wird, kann ein solches Vorgehen sehr viele Schritte erfordern. In Gesprächen mit Transportkunden wurde für einzelne Punkte ein Preiszuschlag von 100 Cent/(kWh/h/a) oder gar mehr auf das regulierte Entgelt als nicht unrealistisch eingestuft. Bei Schritten von z.B. durchgängig 2 Cent würden sich so 50 (!) notwendige Gebotsschritte ergeben, was insbesondere dann nicht praktikabel erscheint, wenn für jedes Gebotsfenster einschließlich Auswertungsphase ein Zeitraum von 2 Stunden zur Verfügung steht. Durch das oben skizzierte Modell wird systematisch das gleiche Ergebnis in deutlich weniger Schritten erreicht. Eine Detaillierung der Ausgestaltung der Preisschritte finden Sie unten unter 5.3.1.2.

#### 5.3.1.1. Ausgestaltung der Gebotsfenster

Für die Abgabe von Geboten stehen fest vorgegebene, zeitlich begrenzte Gebotsfenster zur Verfügung. Ein Gebotsfenster definiert sich durch einen Anfangs-, einen Endzeitpunkt und einen aufgerufenen Preis.

Innerhalb eines jeden Gebotsfensters können die Transportkunden Mengengebote in Vielfachen von kWh/h abgeben. Mengengebote geben an, wie viel Kapazität ein Transportkunde zu dem jeweils aufgerufenen Preis buchen möchte. Die Mindestgröße eines Gebots beträgt 1 kWh/h und entspricht damit der kleinsten zu nominierenden Einheit. Transportkunden sind berechtigt, mehrere Gebote pro aufgerufenen Preis abzugeben. Die Maximalgröße der Summe der Gebote eines Transportkunden ist allerdings auf die verfügbare Kapazität der Auktion begrenzt. Hat ein Bieter erfolgreich an einer Auktion teilgenommen, erhält er eine E-Mail mit der Buchungsbestätigung.

Um an Auktionen teilzunehmen, ist eine Gebotsabgabe bereits im ersten Gebotsfenster obligatorisch. Eine Teilnahme an einer bereits laufenden Auktion ist zu einem späteren Zeitpunkt nicht möglich.

Bieter wird zunächst ein Zeitraum von 9 bis 12 Uhr zur Verfügung gestellt, um ihr Erstgebot einstellen zu können. Anschließend ggf. folgende Gebotsfenster laufen jeweils über eine Stunde, wobei zwischen zwei Gebotsfenstern ebenfalls eine Stunde liegt.

Tag 1:

09.00 – 12.00 Uhr	1. Gebotsfenster
12.00 – 13.00 Uhr	Auswertung, Veröffentlichung
13.00 – 14.00 Uhr	2. Gebotsfenster
14.00 – 15.00 Uhr	Auswertung, Veröffentlichung
15.00 – 16.00 Uhr	3. Gebotsfenster
16.00 – 17.00 Uhr	Auswertung, Veröffentlichung
17.00 – 18.00 Uhr	4. Gebotsfenster
anschließend	Auswertung, Veröffentlichung

Tag 2:

09.00 – 10.00 Uhr	5. Gebotsfenster
10.00 – 11.00 Uhr	Auswertung, Veröffentlichung

usw.

Dieser Zeitplan gilt sowohl für den ersten Auktionsslot als auch für alle nachgelagerten Auktionsslots.

*Begründung:*

*Begrenzung der Maximalgröße der Summe der Gebote eines Transportkunden:*

*Diese Beschränkung ist erforderlich, um ein missbräuchliches, strategisches Blockieren der Kapazitätsvergabe durch einen einzelnen Bieter zu verhindern: Ein Bieter könnte mit einem Mengengebot, das die zu vergebende Kapazität überschreitet, risikolos so hohe Preisstufen erzwingen, dass alle anderen Bieter aussteigen. Bei der nächsten Preisstufe könnte er dann sein Gebot auf Null reduzieren.*

*Bekanntgabe der angebotenen Kapazität vor Auktionsbeginn:*

*Die explizite Bekanntgabe vor Auktionsbeginn dient zum einen dazu, die jeweiligen Kapazitäten der Fernleitungsnetzbetreiber zu fixieren, d.h. dass ab diesem Zeitpunkt die zu vermarktende Menge feststeht und bis zum Ende der Auktion nicht mehr reduziert werden darf. Zum anderen wird dadurch den Transportkunden ausreichend Zeit zur Vorbereitung auf Grundlage dieser fixierten Basis eingeräumt. Selbstverständlich können sich die Transportkunden auch bereits vorher auf den jeweiligen Seiten der Fernleitungsnetzbetreiber über deren Kapazitäten informieren.*



Unmöglichkeit der späteren Teilnahme an bereits laufenden Auktionen:

*Diese Regelung ist erforderlich um sicherzustellen, dass die Summe aller Gebote bei Preiserhöhungen geringer oder gleich hoch der Summe der Gebote in der niedrigeren Preisstufe ist. Nur so kann das Auktionsverfahren garantieren, dass ein eindeutiger Markträumungspreis in einem transparenten und für alle Bieter klaren Verfahren erzielt wird.*

### 5.3.1.2. Ausgestaltung der Preisschritte

Für jedes Auktionsprodukt (Jahr, Quartal, Monat) werden zwei feste Preisschritte definiert, die jeweils Aufschläge auf das regulierte Entgelt angeben:

Nach NC CAM bildet ein großer Preisschritt immer ein Vielfaches vom kleinen Preisschritt. Mit dieser Vorgabe kompatibel ist die derzeitige Festlegung der Preisschritte, die auch vorerst von den deutschen Fernleitungsnetzbetreibern beibehalten wird.

- Große Preisschritte betragen bei Auktionen für Jahres-, Quartals- bzw. Monats-Produkte 10, 2,5 bzw. 1 in Cent je kWh/h sowie
- Kleine Preisschritte betragen bei Auktionen für Jahres-, Quartals- bzw. Monats-Produkte 2, 0,5 und 0,2 in Cent je kWh/h.

Für gebündelte Kapazitätsprodukte an Grenz- und Marktgebietsübergangspunkten werden zukünftig die Summen der jeweils auf beiden Seiten definierten Preisschritte als Preisschritte angewendet.

Begründung:

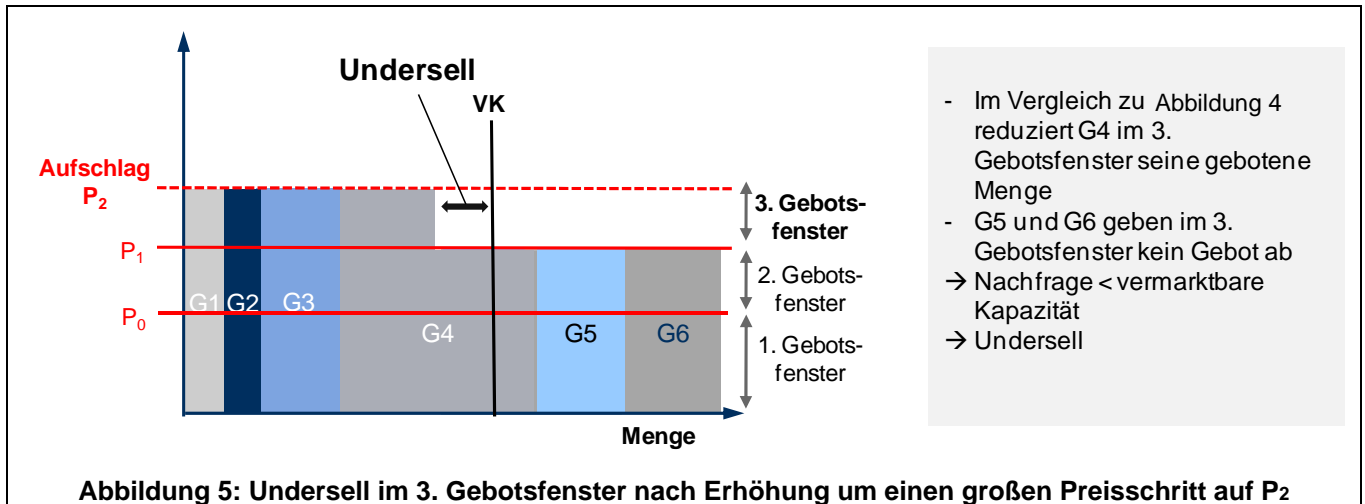
Höhe der Preisschritte:

*Die hier vorgestellten Höhen der Preisschritte gelten gemäß Festlegung BK7-10-001 der Bundesnetzagentur als abgestimmt. Dennoch soll eine regelmäßige Prüfung und ggf. eine Anpassung der Preisschritte erfolgen, v.a. wenn dies aufgrund von Erfahrungen mit Auktionsergebnissen (Höhe des Undersells, Anzahl der Stufen, Zeitfenster etc.) erforderlich ist. Die Preisschritte für die unterjährigen Kapazitätsprodukte wurden von denen der Jahresprodukte abgeleitet (z.B. für Quartale ein Viertel der Jahrespreisschritte). Der Faktor fünf zwischen kleinem und großem Preisschritt stellt sicher, dass einerseits der Preiskorridor relativ schnell ermittelt werden kann und andererseits anschließend nach dem Rückschritt nur noch wenige weitere, nämlich maximal vier, Preisschritte erforderlich sind.*



oder

- b) die Summe der Gebote kleiner ist als die vermarktbare Kapazität (sog. „Undersell“ bei  $P_2$ , siehe Abbildung 5).



*Begründung:*

Abfolge der Gebotsfenster:

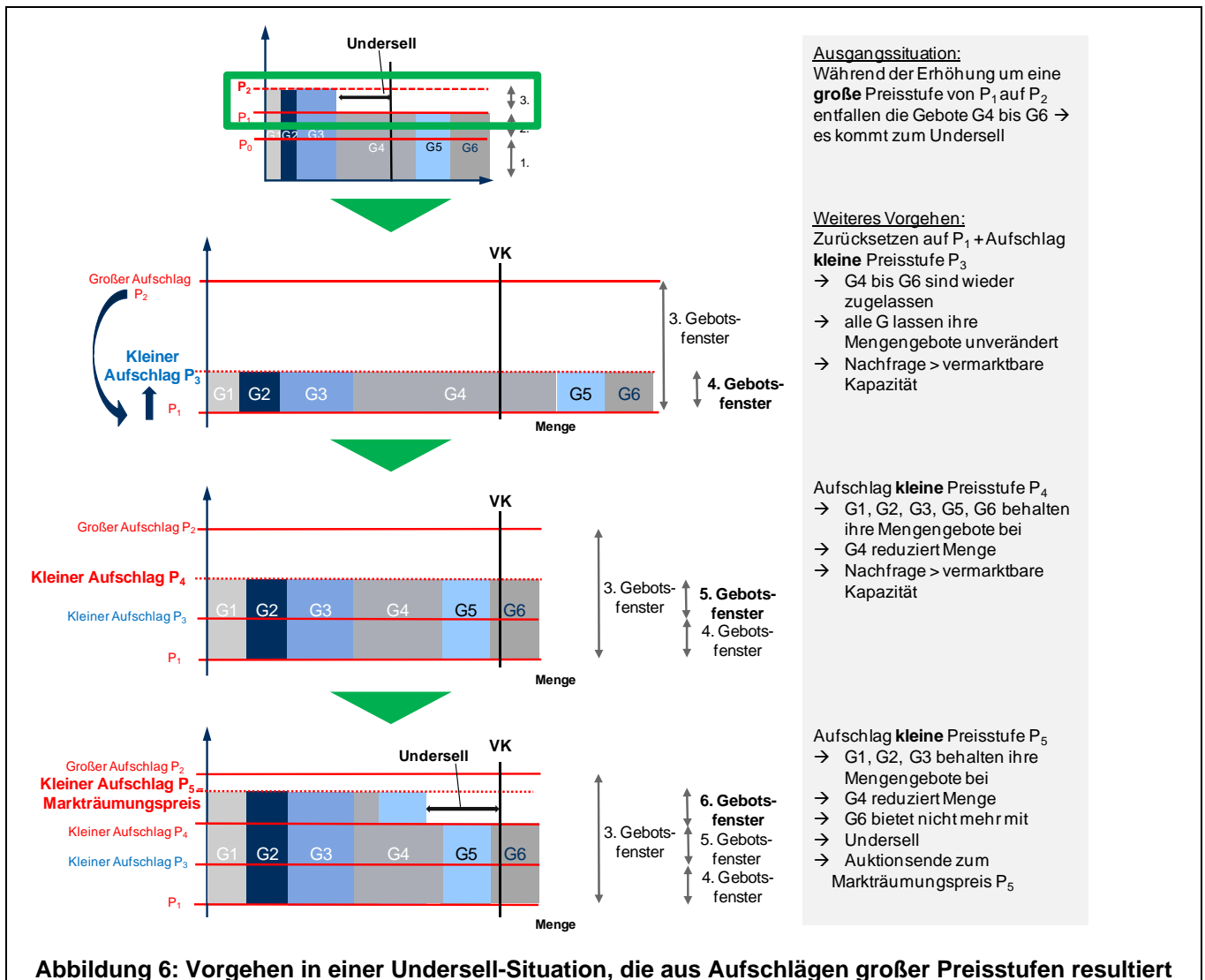
Ziel von Kapazitätsauktionen ist es, den die Knappheit der angebotenen Kapazität signalisierenden Markträumungspreis zu finden. Dieser kann an einigen Punkten bereits dem regulierten Entgelt entsprechen. An anderen Punkten kann es notwendig sein, den Preis über das regulierte Entgelt hinaus zu erhöhen, um den markträumenden Preis zu ermitteln.

#### 5.3.1.4. Ausgestaltung der Gebotsfenster im Falle eines Undersells

Durch das Auftreten eines Undersells im 3. Gebotsfenster (bei  $P_2$ , siehe Abbildung 5) haben die Bieter den vorangehenden großen Preisschritt (von  $P_1$  auf  $P_2$ , siehe Abbildung 5) als Preiskorridor definiert, innerhalb dessen der markträumende Preis liegen muss. Zur Vermeidung/Reduzierung des Undersells bzw. zur Findung des Marktpreises innerhalb dieses Preiskorridors wird ein neues Gebotsfenster (4. Gebotsfenster, siehe Abbildung 6) eröffnet, in dem sich der auszurufende Preis  $P_3$  (siehe Abbildung 6) aus dem aufgerufenen Preis des vorigen Gebotsfensters ( $P_1$ ) zuzüglich einer kleinen Preisstufe (vgl. 5.3.1.2) ergibt. Es gilt somit  $P_1 < P_3 < P_2$  (siehe Abbildung 6).

Der auszurufende Preis wird fortan so lange um kleine Preisschritte erhöht, bis die Summe der Kapazitätsmenge der abgegebenen Gebote erneut entweder kleiner oder gleich der vermarktbaren Kapazität ist (bei  $P_5$ , siehe Abbildung 6). In beiden Fällen ist nun – aufgrund der Annäherung in kleinen Preisschritten – die Auktion beendet und es erfolgt eine Zuteilung der gesamten nachgefragten Kapazität zum Markträumungspreis  $P_5$  (siehe Abbildung 6).

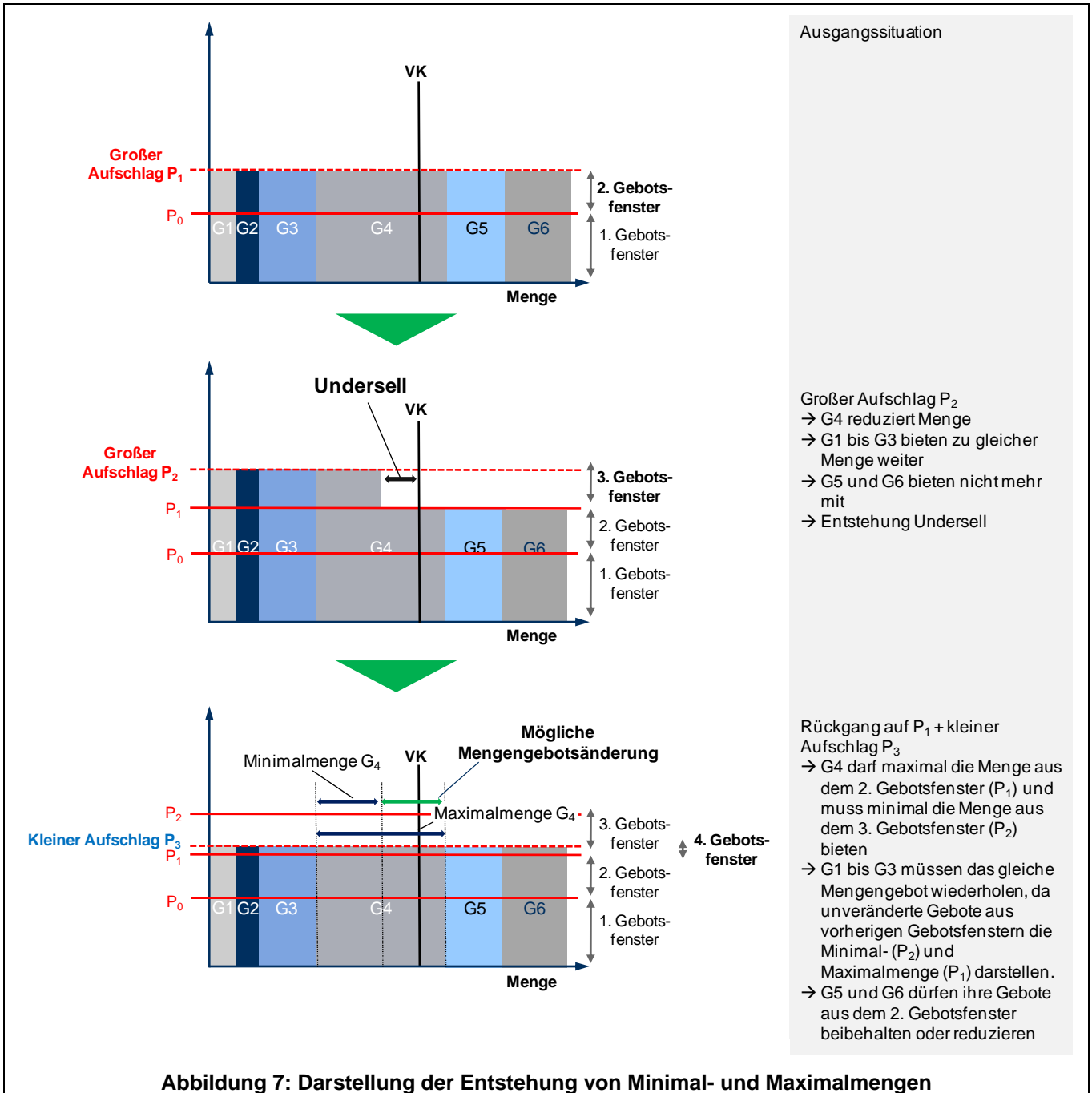
Nicht zugeteilte Kapazität wird in späteren Auktionen von Kapazitätsprodukten mit ggf. kürzerer Laufzeit vermarktet. Den erfolgreichen Bietern wird der Erwerb von Kapazität per E-Mail mitgeteilt. Informationen über andere Bieter erhalten sie nicht.



Die nachgefragten Mengen der Gebote, die den Undersell ausgelöst haben (bei  $P_2$ , siehe Abbildung 7), bilden für jedes weitere Gebot in Gebotsfenstern mit kleinen Preisschritten die Mindestmenge (beispielhaft dargestellt durch die „Minimalmenge  $G_4$ “ in Abbildung 7). Gebote dürfen in den weiteren Gebotsfenstern somit nicht unter diese Mindestmenge reduziert werden.

Die nachgefragten Mengen der Gebote des Gebotsfensters, das dem Undersell vorausging (bei  $P_1$ , siehe Abbildung 7), bilden für jedes Gebot die Maximalmenge (beispielhaft dargestellt durch die „Maximalmenge  $G_4$ “ in Abbildung 7). Gebote dürfen in den weiteren Gebotsfenstern nur bei dieser Menge belassen oder reduziert werden. In Abbildung 7 ist das Mengengebote für den Bieter im 4. Gebotsfenster somit durch die „Maximalmenge  $G_4$ “ nach oben begrenzt. Wird ein Gebot reduziert, so ist die nachgefragte Menge dieses Gebots analog der

Vorgehensweise bei den großen Preisschritten die neue Maximalmenge für ggf. folgende Gebotsfenster.



Abhängig von der Wahl der Preisschrittgrößen ist somit nach dem erstmaligen Auftreten eines Undersells ein Auktionsabschluss innerhalb weniger weiterer Gebotsfenster sichergestellt.

*Begründung:*

*Vorgehen nach Auftreten eines Undersells nach einem großen Preisschritt:*

*Wenn aufgrund einer Preiserhöhung um einen großen Schritt die Bieter ihre Gebote in Summe so stark reduziert haben, dass sich die zum vorherigen Preis noch bestehende Situation einer Übernachfrage in eine Situation des Überangebots umgekehrt hat, muss zwischen diesen beiden Preisstufen der markträumende Preis liegen. Ein einmaliger Rückschritt um einen großen Preisschritt und eine sukzessive Preiserhöhung in kleinen Schritten ermöglicht dann eine schnelle Annäherung an den markträumenden Preis und im günstigen Fall eine Verbesserung der Situation für weiterhin teilnehmende Transportkunden, die in jedem Fall ihre erwünschte Kapazität erhalten, ggf. zu einem niedrigeren Preis.*

*Regelung zu Mindest- und Maximalmengen:*

*Diese Regelung bewirkt, dass die Gebote zu den unterschiedlichen Preisschritten konsistent sind, indem durchgehend bei höheren Preisen die nachgefragten Mengen kleiner als oder gleich der nächstniedrigeren Preisstufe sind, unabhängig davon, ob die Preisstufen unmittelbar nacheinander aufgerufen wurden. Zudem wäre es nicht nachvollziehbar, dass ein Transportkunde eine Kapazität, die er zu einem höheren Preis hat buchen wollen, zu einem nun verringerten Preis nicht mehr buchen möchte. Für den Fall der vorgestellten Preisschritte (siehe Abschnitt 0) bedeutet dies, dass es nach dem Auftreten eines Undersells nach einem großen Preisschritt maximal vier kleiner Preisschritte bedarf, um den markträumenden Preis zu ermitteln. Im fünften Preisschritt würde erneut derjenige Preis aufgerufen, der erstmalig einen Undersell verursacht hat und damit die obere Grenze des Preiskorridors definiert. Liegt bei dem vierten kleinen Preisschritt noch immer eine Übernachfrage vor, erfolgt die Zuteilung zu dem Preis, der erstmalig den Undersell bewirkt hat und somit bereits aufgerufen wurde.*

### 5.3.2. Einstufiges Auktionsverfahren

Für Day-Ahead-Auktionen wird abweichend zu den Produkten längerer Laufzeit ein einstufiges Verfahren mit Abbildung einer Gebotskurve angewendet.

Der Ablauf bei Day-Ahead-Auktionen verläuft innerhalb eines einzelnen Gebotsfensters und damit einer Stufe. Jedoch werden gemäß den Vorgaben des NC CAM – hier allerdings in der Fassung vom 17.9.2012<sup>3</sup> – einige Anpassungen vorgenommen.

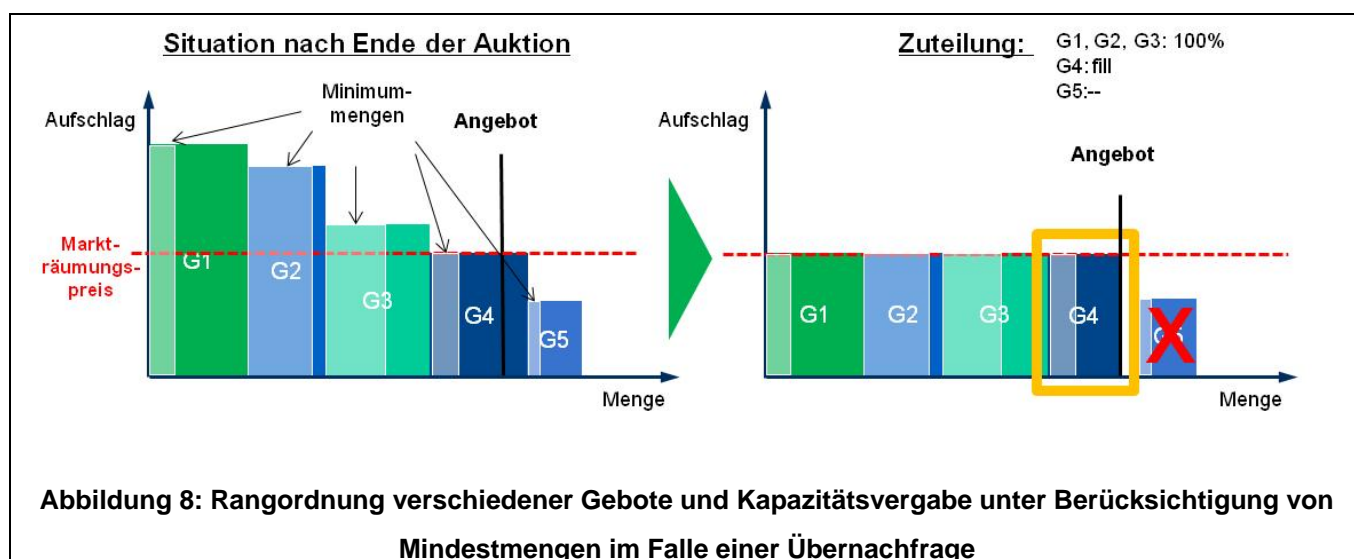
---

<sup>3</sup> Die am 17.9.2012 von ENTSOG an ACER übermittelte Fassung sieht im Vergleich zur Fassung vom 6. März kürzere Gebotsfenster für Day-Ahead-Auktionen vor (30 vs. 90 Minuten). Die beteiligten Netzbetreiber haben sich darauf verständigt, diese aktualisierten Vorgaben anzuwenden, da nur diese eine unproblematische Vermarktung sowie Nominierung von unterbrechbaren Kapazitäten am Vortag ermöglichen.

So werden Day-Ahead-Auktionen künftig nicht mehr um 15.30 Uhr, sondern um 16.30 Uhr gestartet. Die Bieter haben auf der neuen Plattform dann bis 17 Uhr die Möglichkeit, eine Gebotsliste einzustellen, in der sie für ihr Unternehmen bis zu 10 Preis-Mengenkombinationen mit jeweils einer Mindestmenge abgeben. Eine Mindestmenge ist vorgesehen, da eine nach Gegenüberstellung von Angebots- und Gebotskurve ggf. auftretende Undersellmenge auf die Bieter verteilt wird, sofern die Mindestmenge dies nicht verhindert. Preise sowie Mengen können dabei innerhalb der Restriktion, dass sich Preise als Vielfache von € 0,00001 (d.h. €ct 0,001) und Mengen als Vielfache einer kWh/h darstellen müssen, frei gewählt werden. Es steht den Bietern allerdings frei, auch nur zu einem Preis ein Mengenangebot mit einer Mindestmenge einzustellen.

Wie bisher gilt auf der neuen Plattform, dass in Day-Ahead-Auktionen erworbene Kapazitäten unverzüglich in einen gültigen (inkl. bestandenen Kommunikationstest) und für den Transportkunden zulässigen Bilanzkreis oder Subbilanzkonto eingebracht werden. Hierfür ist es notwendig, dass die Angabe dieses Bilanzkreises oder Subbilanzkontos bereits bei Gebotsabgabe erfolgt.

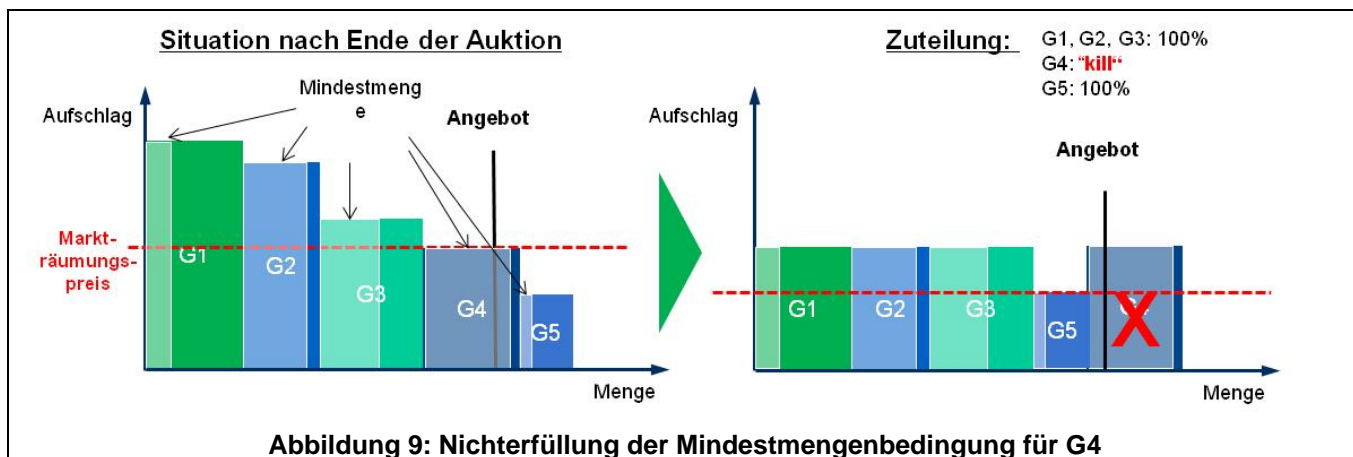
Nach dem Schließen des Gebotsfensters wertet die Plattform die Gebote aus und ermittelt den Markträumungspreis.



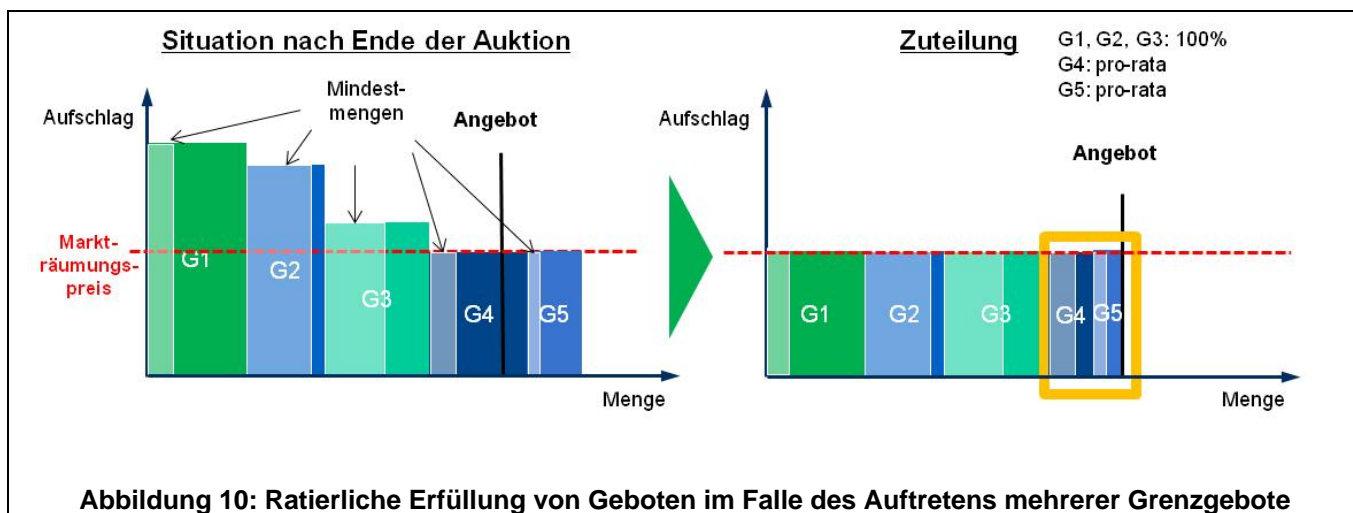
Die neue Plattform ordnet hierfür eingegangene Gebote aller Bieter absteigend nach der jeweiligen Preiskomponente (in Abbildung 8 genießt das Gebot G1 aufgrund der größeren Preiskomponente einen höheren Rang als alle anderen Gebote). In Gänze und unabhängig von der je Gebot angebbaren Mindestmenge werden bei der endgültigen Zuteilung solche Gebote berücksichtigt, die vollständig innerhalb der Angebotsmenge liegen (in Abbildung 8 gilt dies für die Gebote G1, G2 und G3). Lediglich teilweise werden Grenzgebote (in Abbildung 8 das Gebot G4) erfüllt, wenn die mit diesem Gebot angegebene Mindestmenge kleiner

oder gleich der sich aus der teilweisen Erfüllung dieses Gebotes ergebende Menge ist (in Abbildung 8 gilt dies für das Gebot G4).

Ist die zuvor mit diesem Gebot angegebene Mindestmenge größer als die zuzuteilende Menge, erfolgt gar keine Erfüllung dieses Gebots. Nicht erfüllte Gebote werden in der Rangordnung aller Gebote dann nicht weiter berücksichtigt (in Abbildung 9 gilt dies für das Gebot G4). An ihre Stelle rücken nachrangige Gebote, auf die die Mindestmengenprüfung erneut angewendet wird (in Abbildung 9 gilt dies für das Gebot G5).

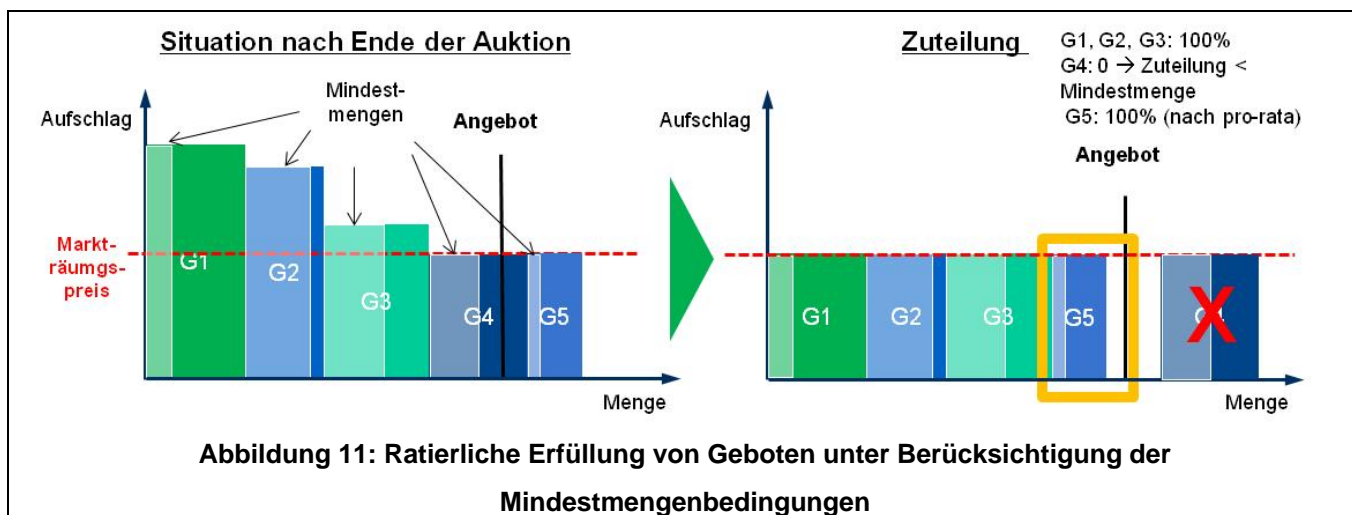


Wie bereits oben erwähnt, kann der Fall mehrerer Grenzgebote auftreten (in Abbildung 10 gilt dies für die Gebote G4 und G5). In diesem Fall sieht der neue Day-Ahead-Algorithmus – ebenfalls unter Berücksichtigung der Mindestmengenbedingung – eine rätierliche Erfüllung der betreffenden Gebote vor. Eine Erfüllung aller gleichrangigen Gebote erfolgt demnach nur dann, wenn die zuzuteilenden Mengen jeweils größer als die jeweiligen Mindestmengen ausfallen. In Abbildung 10 werden bspw. die Gebote G4 und G5 rätierlich erfüllt, da die jeweiligen Mindestmengen kleiner als die endgültig zuzuteilenden Mengen sind.



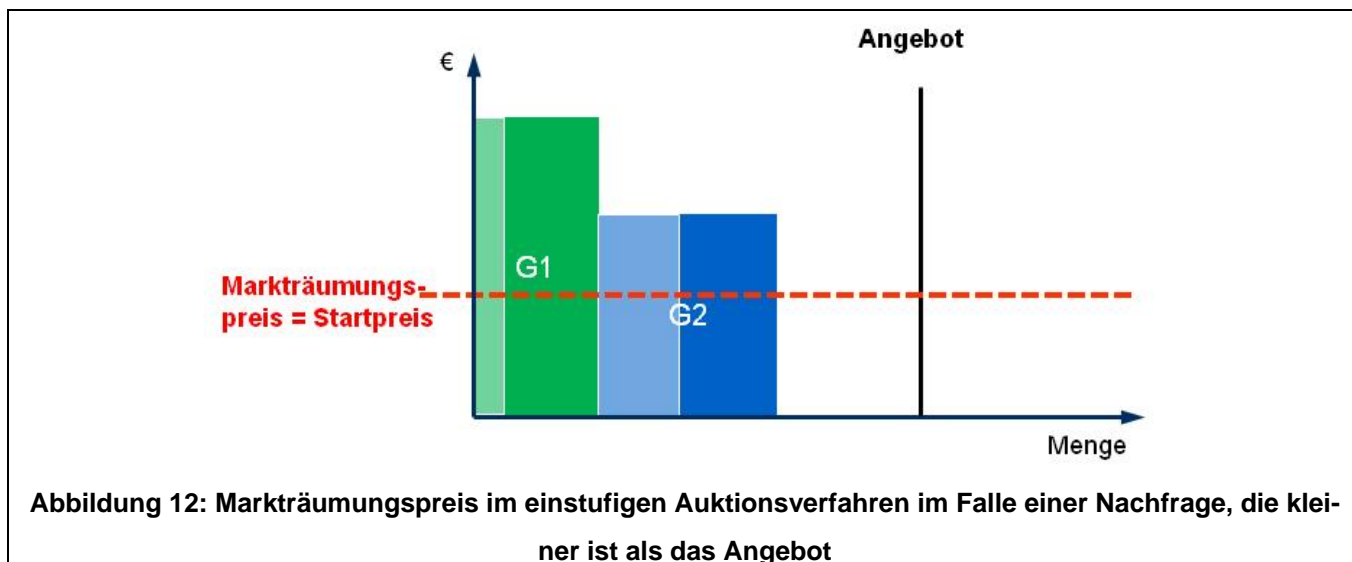


Ist die Mindestmengenbedingung für eines oder mehrere der gleichrangigen Grenzgebote nicht erfüllt, fallen diese Gebote aus der Betrachtung und es erfolgt eine erneute ratierliche Vergabe zwischen den verbliebenen Geboten (in Abbildung 11 ist die Mindestmengenbedingung für das Gebot G4 nach der ratierlichen Zuteilung nicht erfüllt, so dass lediglich das Gebot G5 – und zwar in größerem Maße als unter Berücksichtigung von Gebot G4 – erfüllt wird).



### 5.3.3. Markträumungspreis

Der Markträumungspreis im mehrstufigen und einstufigen Auktionsverfahren stellt den Preis dar, bei dem das letzte erfolgreiche Gebot die Angebotskurve schneidet. Sollte dieser Schnittpunkt aufgrund einer geringen Nachfrage (Nachfrage kleiner als Angebotsmenge) nicht existieren, entspricht der Markträumungspreis dem Startpreis in der Auktion (siehe Abbildung 12). Äquivalent zur derzeitigen Ausgestaltung auf der TRAC-X primary gilt für alle erfolgreichen Teilnehmer der Auktion der gleiche Preis je zugeteilter Kapazitätseinheit.



*Begründung:*

*Anwendung eines einstufigen Verfahrens:*

*Für Day-Ahead-Auktionen ist es aufgrund der Kurzfristigkeit notwendig, ein vereinfachtes Verfahren vorzusehen. Um auch für Day-Ahead-Kapazitäten den potentiellen Undersell so gering wie möglich zu halten, sehen die Fernleitungsnetzbetreiber das beschriebene Day-Ahead-Verfahren als einstufiges Verfahren mit Abbildung einer Gebotskurve vor. Dieses Verfahren verkürzt damit das sonst mehrtägig verlaufende, zuvor beschriebene Verfahren implizit ab und sorgt so dafür, dass ein für alle Laufzeiten weitgehend konsistentes Verfahren angewendet werden kann. Des Weiteren wird mit diesem Verfahren den Bietern die Flexibilität eingeräumt, selbst zu entscheiden, ob sie nur ein Gebot oder eine Gebotsliste abgeben.*

*Vorabangabe eines Bilanzkreises bzw. Subbilanzkontos: unverzügliche Einbringung in einen Bilanzkreis bzw. Subbilanzkontos:*

*Diese Regelung ist notwendig, um die Abwicklung der zeitkritischen Folgeprozesse nicht zu gefährden.*

*Einführung einer Mindestmenge je anzugebener Preis-Mengen-Kombination*

*Die Mindestmenge kann für jedes Gebot (d.h. für jede anzugebene Preis-Mengen-Kombination) definiert werden. Sie soll Bieter davor schützen, am Ende einer Auktion Kapazitäten in einer Höhe zugeteilt zu bekommen, für die sie keine Verwendung haben. Die Mindestmenge kann im kleinsten Fall Null sein: dann erfolgt, wenn es sich bei dem betroffenen Gebot um ein Grenzgebot handelt, in jedem Fall eine Zuteilung (bspw. auch in Höhe einer kWh/h). Null stellt außerdem die Voreinstellung dar, die zu einem Gebot übermittelt wird, wenn nicht explizit eine von Null abweichende Mindestmenge angegeben wurde. Im größten Fall kann die Mindestmenge der Mengenkomponente des jeweiligen Gebotes entsprechen: so kann sichergestellt werden, dass ein Gebot nur vollständig und eben nicht lediglich teilweise erfüllt wird.*

## **5.4. Umwandlung von unterbrechbaren Kapazitäten**

§ 13 Abs. 2 GasNZV schreibt vor, dass Inhaber unterbrechbarer Kapazitäten bei einer Versteigerung Gebote abgeben können, um die unterbrechbaren Kapazitäten in feste Kapazitäten umzuwandeln. Sind die Inhaber unterbrechbarer Kapazitäten bei der Versteigerung nicht erfolgreich, behalten sie ihre unterbrechbare Kapazität.

Die Umsetzung dieser Vorgaben erfolgt auf der Plattform direkt bei der Gebotsabgabe. Dazu gibt der Bieter die maximal umzuwandelnde, unterbrechbar gebuchte Kapazitätsmenge und

die relevanten Vertragsdaten (z.B. Vertragsnummer, Vertragsabschlussdatum) in seinem Gebot mit an. Diese Informationen werden bei erfolgreicher Ersteigerung dem betreffenden Fernleitungsnetzbetreiber durch die Plattform übermittelt. Dieser nimmt die Umwandlung der Kapazität in seinen Systemen vor und informiert im Anschluss den Transportkunden.

## 6. Vergabe von nicht auktionspflichtigen Primärkapazitäten

Auf der Plattform können “nach der zeitlichen Reihenfolge ihrer jeweiligen Buchung” die folgenden Arten von Kapazitäten vergeben werden:

- Unterbrechbare Kapazitäten
- Ausspeisekapazitäten zu Letztverbrauchern oder Speicheranlagen
- Einspeisekapazitäten von Speicher-, Produktions- oder LNG-Anlagen
- Einspeisekapazitäten von Biogasanlagen

Der Transportkunde wird – sofern vom Fernleitungsnetzbetreiber angeboten – über die Primärkapazitätsplattform seine Buchungen von nicht auktionspflichtigen Primärkapazitäten vornehmen können. Die Verfügbarkeit der angefragten Kapazität wird dabei von der Primärkapazitätsplattform beim jeweiligen Fernleitungsnetzbetreiber angefragt und geprüft. Die Prüfung von freien Kapazitäten erfolgt dabei in den Systemen der jeweiligen Fernleitungsnetzbetreiber. Der Transportkunde kann bei positiver Rückmeldung die angefragte Kapazität auf der Primärkapazitätsplattform buchen.