

# **Evaluierungsbericht der deutschen Fernleitungsnetzbetreiber**

**über das Versteigerungsverfahren gemäß der Festlegung  
in Sachen Kapazitätsregelungen und Auktionsverfahren im  
Gassektor (KARLA Gas, BK7-10-001)**

**Berichtszeitraum 1. Mai 2012 – 31. März 2013**

**26.04.2013**

# **Gliederung**

- 1. Einführung**
- 2. Rechtliche Grundlage und Ziel der Evaluierung**
- 3. Evaluierung**
  - 3.1. Jahresauktionen**
  - 3.2. Quartalsauktionen**
  - 3.3. Monatsauktionen**
  - 3.4. Tagesauktionen**
  - 3.5. Auktionen mit Preisaufschlag**
- 4. Anpassungen auf Basis des letzten Evaluierungsberichts**
- 5. Fazit**
- 6. Ausblick**

# 1. Einführung

Die PRISMA European Capacity Platform GmbH (PRISMA) wurde als TRAC-X Transport Capacity Exchange GmbH 2005 in Leipzig gegründet und mit Beschluss der Gesellschafterversammlung vom 4. Dezember 2012 und Eintragung in das Handelsregister am 28. Dezember 2012 umfirmiert. Sofern im vorliegenden Bericht daher Bezug auf PRISMA genommen wird, ist damit zumindest für den Zeitraum bis zur Umfirmierung auch TRAC-X gemeint.

Gesellschaftsgegenstand ist unter anderem die Entwicklung und der Betrieb einer elektronischen Plattform für die Zuweisung von Kapazitäten (Primärkapazitätsplattform und Sekundärkapazitätsplattform) in Gasfernleitungsnetzen und Dienstleistungen in Bezug auf Kapazitätszuweisungsmechanismen und Engpassmanagementverfahren.

Im Jahre 2010 erhielt PRISMA zunächst von den deutschen Fernleitungsnetzbetreibern<sup>1</sup> den Auftrag, eine Plattform zur Vergabe von Primärkapazitäten in Deutschland aufzubauen und zu betreiben, zu dessen Errichtung und Betrieb die deutschen Fernleitungsnetzbetreiber nach § 12 Abs. 1 S. 1 GasNZV verpflichtet sind. Die TRAC-X primary (jetzt PRISMA primary) startete fristgerecht zum 1. August 2011.

Über PRISMA primary vermarkten die deutschen Fernleitungsnetzbetreiber ihre Transportkapazitäten entsprechend den Anforderungen der Gasnetzzugangsverordnung sowie dem Beschluss zur Festlegung in Sachen Kapazitätsregelungen und Auktionsverfahren im Gassektor vom 24.02.2011 (KARLA Gas).

PRISMA primary selbst dient ausschließlich als Vermarktungsplattform. Die über PRISMA primary geschlossenen Ein- und Ausspeiseverträge kommen zwischen dem jeweils beteiligten Fernleitungsnetzbetreiber und dem Transportkunden zustande und werden außerhalb von PRISMA primary erfüllt und abgewickelt. PRISMA primary bietet somit selbst keine Kapazitätsrechte an und wird nicht Vertragspartner der abgeschlossenen Ein- und Ausspeiseverträge. Auch für das Angebot und die Ausgestaltung der jeweiligen Kapazitätsprodukte sind die Fernleitungsnetzbetreiber verantwortlich. PRISMA primary bietet Transportkunden dabei folgende Dienstleistungen an:

- Möglichkeit der zentralen Registrierung bei allen Fernleitungsnetzbetreibern
- Übersicht aller buchbaren Netzpunkte der Fernleitungsnetzbetreiber
- Durchführung von Auktionen für feste Jahres-, Quartals-, Monats- und Tagesprodukte an Grenz- und Marktgebietsübergangspunkten

---

<sup>1</sup> bayernets GmbH, Fluxys TENP GmbH, GASCADE Gastransport GmbH, Gastransport Nord GmbH, Gasunie Deutschland Transport Services GmbH, GRTgaz Deutschland GmbH, jorgasTransport GmbH, Nowega GmbH, ONTRAS - VNG Gastransport GmbH, Open Grid Europe GmbH, terranets bw GmbH und Thyssengas GmbH

- Buchung von nicht auktionspflichtigen Kapazitäten nach dem First-Committed-First-Served-Verfahren (FCFS-Verfahren), d.h. Kapazitätsvergabe nach der zeitlichen Reihenfolge ihrer jeweiligen Buchung
- Umwandlung unterbrechbarer Kapazitäten in feste Kapazitäten
- Rückgabe fester Kapazitäten (seit 1. April 2012)

Den Gesellschaftern bayernets GmbH, European Energy Exchange (EEX), Fluxys TENP GmbH, GASCADE Gastransport GmbH, Gastransport Nord GmbH, Gasunie Deutschland Transport Services GmbH, GRTgaz Deutschland GmbH, Nowega GmbH, ONTRAS - VNG Gastransport GmbH, Open Grid Europe GmbH, terranets bw GmbH und Thyssengas GmbH sind mit Wirkung zum 1. Januar 2013 die Fernleitungsnetzbetreiber Energinet.dk, Fluxys Belgium N.V./S.A., GRTgaz S.A., Gasunie Transport Services B.V., Snam Rete Gas S.p.A., Baumgarten-Oberkappel Gasleitungsgesellschaft mbH, Gas Connect Austria GmbH und die Trans Austria Gasleitung GmbH als weitere Gesellschafter der PRISMA beigetreten.

## 2. Rechtliche Grundlage und Ziel der Evaluierung

Die rechtliche Grundlage für den Evaluierungsbericht bildet Ziffer 5 lit. b) KARLA Gas. Danach sind Fernleitungsnetzbetreiber verpflichtet, das Versteigerungsverfahren unter Beteiligung der tatsächlichen und potenziellen Versteigerungsteilnehmer regelmäßig zu evaluieren und der Bundesnetzagentur (BNetzA) mindestens ein Mal jährlich spätestens zum 1. Mai über die Ergebnisse der Evaluierung zu berichten.

Die BNetzA begründet in Abschnitt 4.5.5.2 von KARLA Gas die Evaluierungspflicht mit einer nur geringen Erfahrung mit Kapazitätsversteigerungen auf dem Gasmarkt. Die jährliche Evaluierung für alle Produkte solle die Grundlage für eine eventuell erforderliche Anpassung der Versteigerungsverfahren sein und würde insbesondere die frühzeitige Anpassung des Auktionsdesigns ermöglichen. Durch die jährliche Evaluierung sollen die Marktteilnehmer an Planungssicherheit gewinnen und steigende Transaktionskosten des Kapazitätsmanagements, sowohl für Fernleitungsnetzbetreiber als auch für Transportkunden, vermieden werden.

Ziel des vorliegenden Evaluierungsberichts ist es deshalb auch, neben statistischen Auswertungen der Auktionen des Zeitraums 1. Mai 2012 bis 31. März 2013, den Versteigerungsmechanismus sowie die Größe der angewendeten Preisschritte zu überprüfen. Allerdings sind – unabhängig von den Ergebnissen der Evaluierung – aus Sicht der Fernleitungsnetzbetreiber die Anpassungsmöglichkeiten, insbesondere des Versteigerungsmechanismus, stark begrenzt, da entsprechende Regeln für die Vergabeverfahren in Zukunft durch den Network Code on Capacity Allocation Mechanisms (NC CAM)<sup>2</sup> und nach dessen Verrechtlichung mithin durch eine dem nationalen Recht übergeordnete Europäische Verordnung, vorgegeben werden.

Im Zeitraum 10. bis 24. April 2013 haben die Fernleitungsnetzbetreiber einen Entwurf des Evaluierungsberichts über den Downloadbereich der PRISMA European Capacity Platform GmbH zur Konsultation gestellt. Stellungnahmen konnten schriftlich an [jeremias.pressl@fnb-gas.de](mailto:jeremias.pressl@fnb-gas.de) gerichtet werden. Es sind keine Stellungnahmen eingegangen.

---

<sup>2</sup> 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 Bericht 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>.

### 3. Evaluierung

Ein- und Ausspeisekapazitäten können auf PRISMA primary durch FCFS-Buchungen sowie durch Auktionen erworben werden.

Im Folgenden wird auf alle Auktionen, die zwischen dem 1. Mai 2012 und dem 31. März 2013 (Handelszeitraum) auf PRISMA primary stattgefunden haben, weiter eingegangen. Die FCFS-Vergabe ist kein Bestandteil dieser Evaluierung.

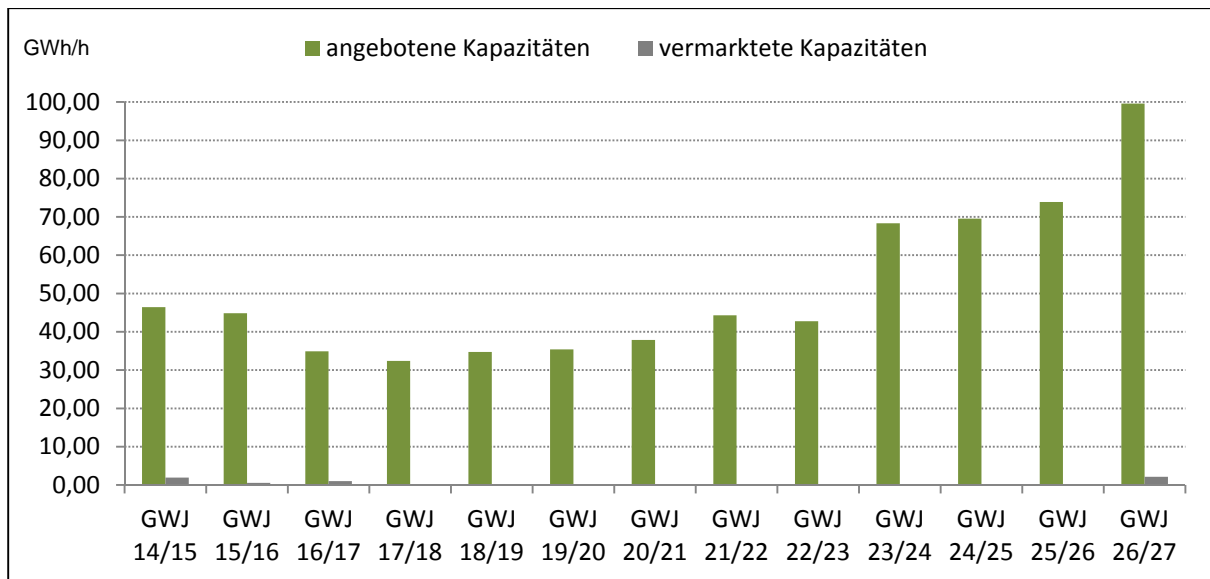
Die Kapazitätsprodukte Jahr, Quartal und Monat werden mittels eines mehrstufigen Auktionsverfahrens vergeben, Tageskapazitäten (Day-Ahead-Kapazitäten) werden über ein einstufiges Auktionsverfahren versteigert. Für jedes Produkt gibt es definierte Handelstage, welche im Auktionskalender auf PRISMA primary veröffentlicht sind.

#### 3.1. Jahresauktionen

Am 2. Oktober 2012 fanden die jährlichen Auktionen für die Jahreskapazitäten statt. Je nach Fernleitungsnetzbetreiber wurden bis zu 13 Gaswirtschaftsjahre (GWJ) angeboten, vom GWJ 2014/2015 bis zum GWJ 2026/2027. Von den insgesamt über alle Gaswirtschaftsjahre angebotenen 665 GWh/h konnten 5,6 GWh/h vermarktet werden, dies entspricht ca. 0,8%.

Die folgende Tabelle sowie das Diagramm zeigen die angebotenen und vermarkteten Kapazitäten der Jahresauktionen.

in GWh/h	GWJ 14/15	GWJ 15/16	GWJ 16/17	GWJ 17/18	GWJ 18/19	GWJ 19/20	GWJ 20/21	GWJ 21/22	GWJ 22/23	GWJ 23/24	GWJ 24/25	GWJ 25/26	GWJ 26/27
angeboten	46,5	44,9	34,9	32,4	34,7	35,4	37,9	44,3	42,8	68,3	69,6	73,9	99,6
vermarktet	1,9	0,6	1,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	2,1



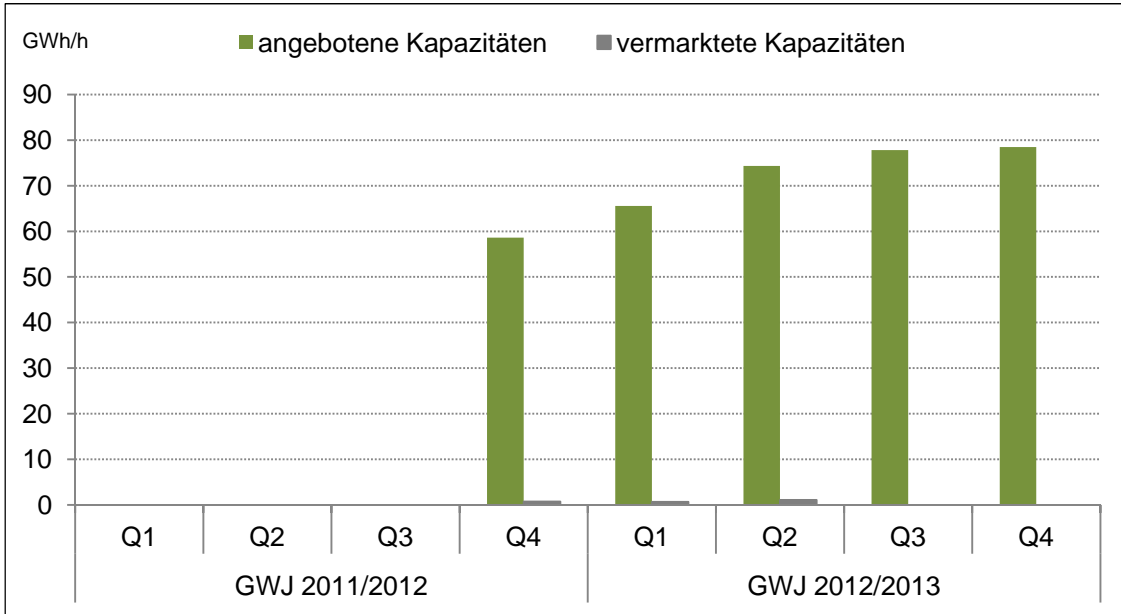
### 3.2. Quartalsauktionen

Bis Ende März 2013 fanden vier separate Quartalsauktionen statt. Die Nachfrage für die angebotenen Quartalskapazitätsprodukte war bei allen Auktionsterminen gering. Durchschnittlich wurden ca. 3% der in den vier Quartalsauktionen angebotenen Kapazitäten vermarktet. Die Vermarktungsspanne lag dabei zwischen 0% und 8%. In den folgenden Tabellen und Grafiken sind sowohl die Zeiträume der Quartalsauktionen als auch Angebot-Nachfrage-Details erfasst.

		Quartalsauktionen				
		15./16.05.2012	14./16.08.2012	13./14.11.2012	12./13.02.2013	
GWJ 2011/2012	Q1	01.10.11 - 01.01.11				
	Q2	01.01.11 - 01.04.11				
	Q3	01.04.11 - 01.07.11				
	Q4	01.07.12 - 01.10.12	X			
GWJ 2012/2013	Q1	01.10.12 - 01.01.13	X	X		
	Q2	01.01.13 - 01.04.13	X	X	X	
	Q3	01.04.13 - 01.07.13	X	X	X	X
	Q4	01.07.13 - 01.10.13	X	X	X	X
GWJ 2013/2014	Q1	01.10.13 - 01.01.14		X	X	X
	Q2	01.01.14 - 01.04.14		X	X	X
	Q3	01.04.14 - 01.07.14		X	X	X
	Q4	01.07.14 - 01.10.14		X	X	X

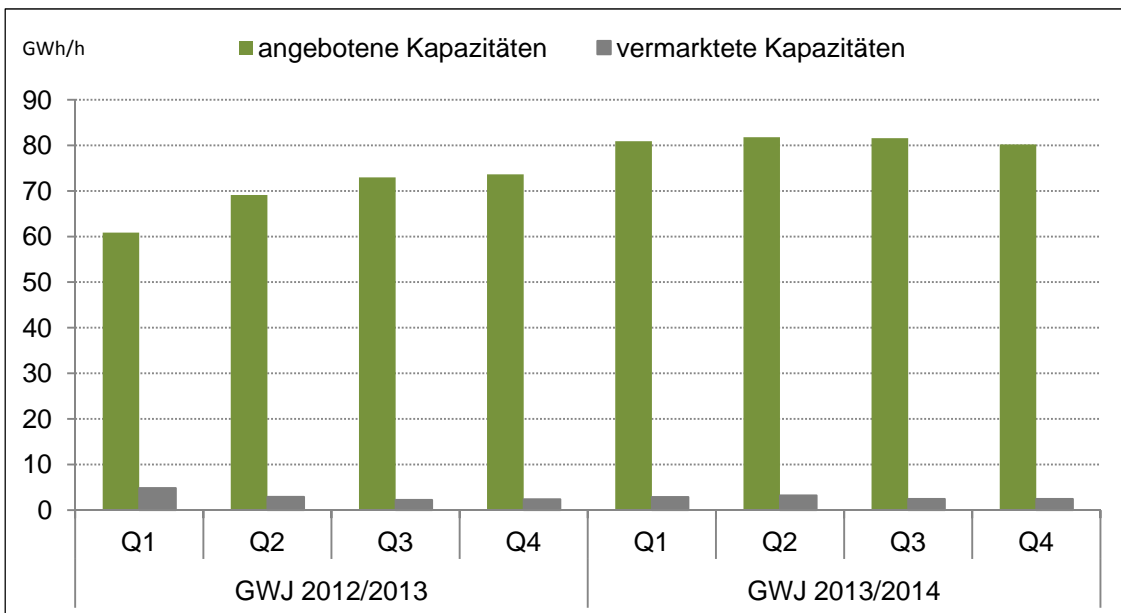
### Quartalsauktionen 15./16.05.2012

in GWh/h	GWJ 2011/2012				GWJ 2012/2013				Summe
	Q1	Q2	Q3	Q4	Q1	Q2	Q3	Q4	
angeboten				58,60	65,56	74,33	77,82	78,49	354,80
vermarktet				0,76	0,66	1,10	0,00	0,00	2,52



### Quartalsauktionen 14./16.08.2012

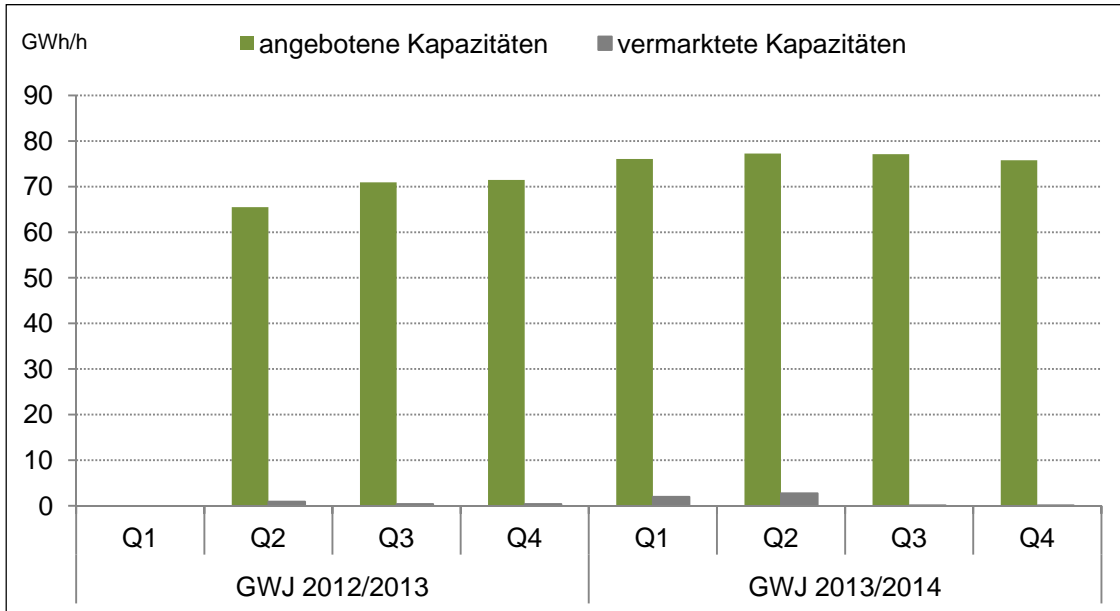
in GWh/h	GWJ 2012/2013				GWJ 2013/2014				Summe
	Q1	Q2	Q3	Q4	Q1	Q2	Q3	Q4	
angeboten	60,86	69,11	72,95	73,63	80,88	81,78	81,55	80,19	600,96
vermarktet	4,83	2,92	2,26	2,40	2,89	3,22	2,45	2,45	23,42





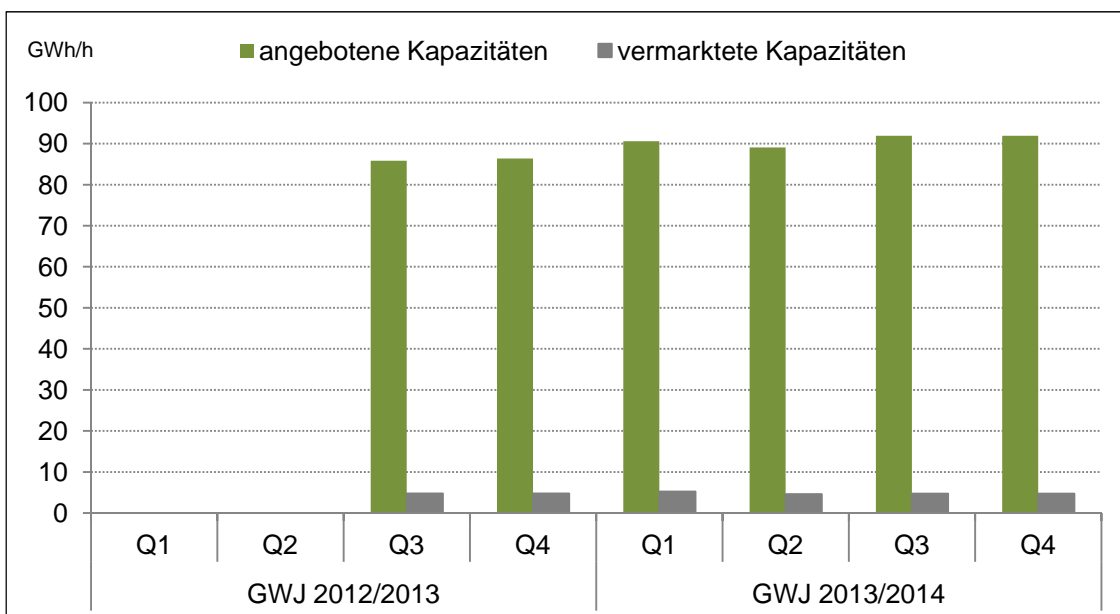
### Quartalsauktionen 13./14.11.2012

in GWh/h	GWJ 2012/2013				GWJ 2013/2014				Summe
	Q1	Q2	Q3	Q4	Q1	Q2	Q3	Q4	
angeboten		65,49	70,93	71,46	76,06	77,24	77,12	75,77	514,08
vermarktet		0,92	0,38	0,38	1,96	2,74	0,07	0,07	6,52



### Quartalsauktionen 12./13.02.2013

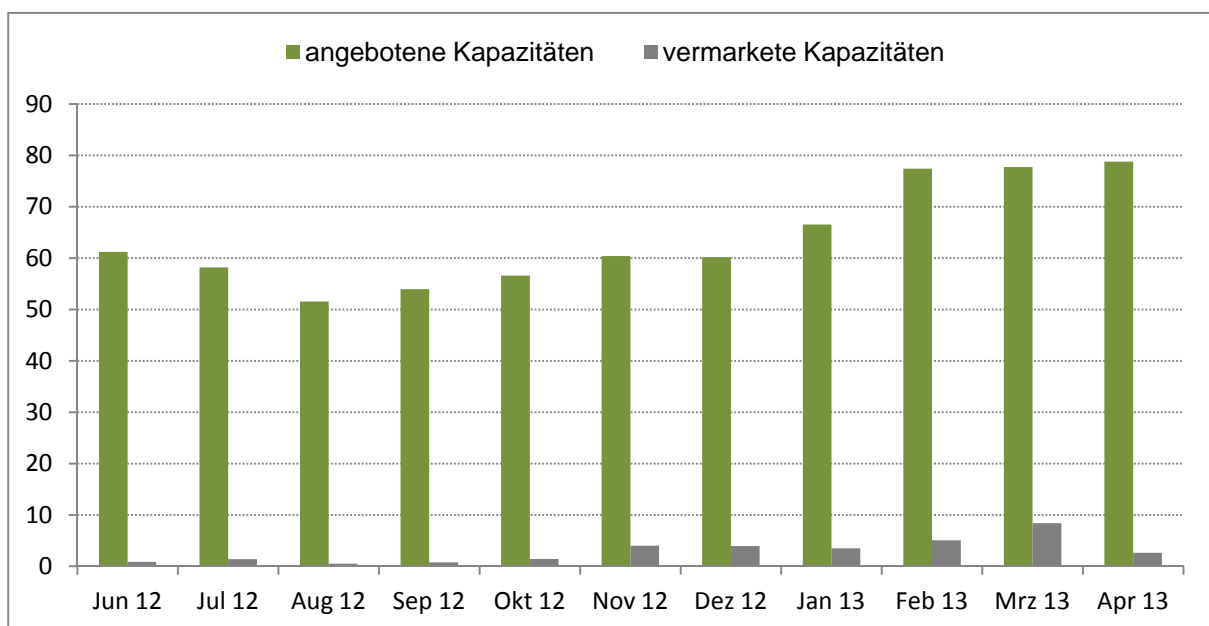
in GWh/h	GWJ 2012/2013				GWJ 2013/2014				Summe
	Q1	Q2	Q3	Q4	Q1	Q2	Q3	Q4	
angeboten			85,83	86,37	90,60	89,08	91,92	91,92	535,72
vermarktet			4,75	4,75	5,24	4,62	4,73	4,73	28,82



### 3.3. Monatsauktionen

Regelmäßig etwa zwei Wochen vor Monatsbeginn werden Monatsprodukte angeboten. Die Vermarktungsquote für die 11 untersuchten Monatsprodukte vom Juni 2012 bis April 2013 (Nutzungszeiträume) lag durchschnittlich bei ca. 4,6%, wobei in den Wintermonaten im Vergleich zu den Sommermonaten sowohl ein höheres Angebot als auch eine höhere Vermarktung festzustellen ist. Mit 1,0% war die Vermarktungsquote für August 2012 am niedrigsten, mit 10,8% für März 2013 am höchsten.

in GWh/h	Jun 2012	Jul 2012	Aug 2012	Sep 2012	Okt 2012	Nov 2012	Dez 2012	Jan 2013	Feb 2013	Mrz 2013	Apr 2013	Summe
angeboten	61,23	58,21	51,57	53,95	56,59	60,42	60,18	66,54	77,41	77,72	78,81	702,63
vermarktet	0,84	1,37	0,51	0,76	1,40	4,01	3,94	3,51	5,05	8,41	2,64	32,44

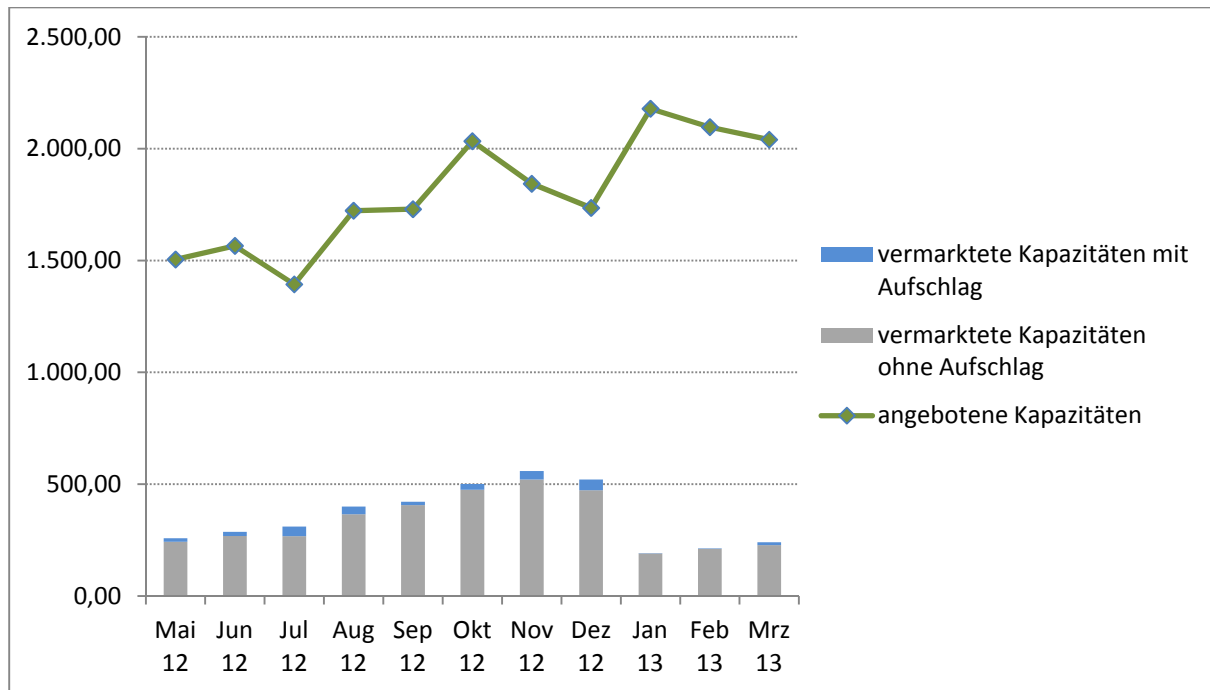


### 3.4 Tagesauktionen

Seit Einführung der Day-Ahead-Auktionen im April 2012 sind bis zum Jahresende 2012 sowohl das Angebot der Day-Ahead-Kapazitäten als auch die Nachfrage tendenziell gestiegen. In Einklang mit den Auktionsergebnissen für die Kapazitätsprodukte Jahr, Quartal und Monat lässt sich ein verändertes Buchungsverhalten der Transportkunden von langfristigen hin zu kurzfristigen Kapazitätsprodukten beobachten. Durch das erneute Angebot nicht vermarkteter Kapazitäten in Auktionen für das nächst kleinere Kapazitätsprodukt kann ein Anstieg der angebotenen Day-Ahead-Kapazitäten begründet sein.

Insgesamt konnten von den zwischen Mai und Dezember 2012 angebotenen Day-Ahead-Kapazitäten 24% vermarktet werden, dies entspricht einer durchschnittlichen täglichen

Vermarktung von 13,3 GWh/h. Der Anteil an Kapazitäten ohne Auktionsaufschlag (und damit bis zum 31. Dezember 2012 zu einem Gesamtpreis von 0 Euro) lag bei 22%, der Anteil für Kapazitäten mit Auktionsaufschlag bei 2%. Knapp ein Viertel der Kapazitäten, die ohne Auktionsaufschlag vergeben wurden, sind auf die Umwandlung entgeltpflichtiger unterbrechbarer Kapazitäten zurückzuführen.



Am 31. Oktober 2012 veröffentlichte die BNetzA den Beschluss BK7-12-201 zur Änderung der Festlegung in Sachen Kapazitätsregelungen und Auktionsverfahren im Gassektor (KARLA Gas). Der Beschluss sieht vor, dass ab dem 1. Januar 2013 Day-Ahead-Kapazitäten nicht mehr mit dem „Startpreis 0 Euro“ angeboten werden, sondern dass dieser dem regulierten Entgelt entspricht und somit Tagesprodukte wie auch Jahres-, Quartals- und Monatsprodukte in Aufpreisauktionen zu vergeben sind, in denen der in den Versteigerungen erzielte Preis lediglich den Aufschlag auf das regulierte Basisentgelt darstellt.

Begründet wurde die Änderung durch die Tatsache, dass – wie oben ersichtlich – der Großteil der Day-Ahead-Kapazitäten zu einem Gesamtpreis von 0 Euro versteigert wurde und sich diese Kapazitäten in hohem Maße aus nicht vermarkteten Jahres-, Quartals- und Monatsprodukten ergaben und nicht, wie es einen Startpreis in Höhe von 0 Euro rechtfertigen würde, aus Renominierungsbeschränkungen oder anderen Engpassmanagementmaßnahmen.

Mit dem Wechsel der Preissystematik zum Jahreswechsel hat sich die Nachfrage nach Day-Ahead-Kapazitäten drastisch reduziert. Hierbei verminderte sich auch der mit Auktionsaufschlägen vermarktete Kapazitätsanteil. In Q4 2012 wurden täglich durchschnittlich ca. 17,2 GWh/h versteigert, in Q1 2013 sank der Wert auf ca. 7,2 GWh/h,

ein Minus von 58%. Insgesamt wurden von den seit Jahresbeginn 2013 angebotenen Kapazitäten 10% vermarktet. Intentionsgemäß ergeben sich nur noch 0,2% der vermarkteten Kapazitäten aufgrund von Kapazitätsumwandlungen unterbrechbarer Kapazitäten.

durchschnittliche Tageswerte in GWh/h	01.05.2012 - 31.12.2012	01.01.2013 - 31.03.2013	Gesamt
angebotene Kapazitäten	55,2	107,0	65,3
vermarktete Kapazitäten	13,3	10,9	12,8
Vermarktungsanteil	24%	10%	20%
vermarktete Kapazitäten ohne Aufschlag	12,3	10,7	12,0

### 3.5 Auktionen mit Preisaufschlag

Um Aussagen über die Güte des Auktionsalgorithmus im Allgemeinen und eine Evaluierung der in den Auktionen Anwendung findenden Preisschritte im Speziellen machen zu können, soll – entsprechend der Analysen im Evaluierungsbericht des vergangenen Jahres – im Folgenden die Auswertung der Auktionen erfolgen, die im Zeitraum 1. Mai 2012 bis 31. März 2013 zu einem Nachfrageüberhang geführt haben. In genau diesen Fällen zeigt sich nach Ansicht der Fernleitungsnetzbetreiber, ob der nach Konsultation mit den Marktteilnehmern und in Abstimmung mit der BNetzA auf PRISMA primary implementierte Auktionsalgorithmus und die Höhe der Preisschritte richtig gewählt wurden oder ob hier Anpassungsbedarf besteht.

Bewertungskriterien für eine derartige Analyse sollen dabei erneut die Anzahl der Preisschritte bis zur Findung des Marktpreises sowie die Höhe des sog. Undersells (also der Anteil der zuvor angebotenen Kapazität, die aufgrund der Versteigerungslogik trotz einer beim Startpreis bestehenden Übernachfrage bei Auktionsende nicht zugeteilt werden konnte) sein.<sup>3</sup> Beim mehrstufigen Auktionsverfahren galt es jedoch zu beachten, einen Mechanismus zu implementieren, der es den Transportkunden ermöglicht, sich einerseits über mehrere Auktionsrunden hinweg dem markträumenden Preis anzunähern, andererseits aber zu einem Auktionsergebnis innerhalb eines angemessenen Zeitraums führt.

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

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

<sup>3</sup> Die Untersuchung und Bewertung der Engpasssituation selbst sowie aus Engpässen abzuleitende Schlussfolgerungen sollen nicht Teil dieses Evaluierungsberichts sein, sondern erfolgen im Rahmen des Netzentwicklungsplans der Fernleitungsnetzbetreiber.

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

In Day-Ahead-Auktionen konnten Bieter für beliebige Preise, die sich aus Aufschlägen in Preisschritten von 0,005 Cent je kWh/h auf den Startpreis ergeben, ihre Mengengebote abgeben.

In 6.893 von insgesamt 25.483 Auktionen (Jahres-, Quartals-, Monats- sowie Tageskapazitätsauktionen), die im Zeitraum 1. Mai 2012 bis 31. März 2013 durchgeführt wurden, konnte eine Nachfrage verzeichnet werden. Von diesen 6.893 Auktionen endeten 873 Auktionen (12,73%) mit Preisauflägen auf den jeweiligen Startpreis:

- 0 von 356 Jahreskapazitätsauktionen,
- 12 von 1.311 Quartalskapazitätsauktionen,
- 2 von 482 Monatskapazitätsauktionen
- 859 von 23.334 Day-Ahead-Auktionen.

In 161 der insgesamt 873 Auktionen mit einem Preisauflag (d. h. 18,4%), konnte die angebotene Kapazität vollständig, d. h. ohne das Auftreten eines Undersells, vermarktet werden. Durchschnittlich weist der Undersell in diesen 873 Auktionen einen Wert von 133.743 kWh/h (Standardabweichung 220.894 kWh/h) auf, bei einem durchschnittlichen Kapazitätsangebot von 431.089 kWh/h.

Die jeweiligen Häufigkeiten des Auftretens von Undersells können der folgenden Gesamtübersicht entnommen werden:

<b>Undersell = X</b>	<b>Anzahl des Auftretens</b>	<b>Anteil an Gesamtzahl</b>
0%	161	18,4%
0 < X < 10%	195	22,3%
10 < X < 20%	107	12,3%
20 < X < 30%	55	6,3%
30 < X < 40%	49	5,6%
40 < X < 50%	65	7,4%
50 < X < 60%	38	4,4%
60 < X < 70%	37	4,2%
70 < X < 80%	36	4,1%
80 < X < 90%	59	6,8%
90 < X < 100%	41	4,7%
100%	30	3,4%
	<b>873</b>	<b>100%</b>

Um Aussagen über die Güte der Auktionsalgorithmen treffen zu können, ist allerdings eine differenzierte Betrachtung des Auftretens des Undersells einerseits in mehrstufig

verlaufenden Jahres-, Quartals- und Monatsauktionen und andererseits in einstufig verlaufenden Day-Ahead-Auktionen notwendig.

Undersells in mehrstufig verlaufenden Jahres-, Quartals- und Monatsauktionen:

<b>Undersell = X</b>	<b>Anzahl des Auftretens</b>	<b>Anteil an Gesamtzahl</b>
0%	11	78,6%
0 < X < 10%	3	21,4%
10 < X < 20%	0	0
20 < X < 30%	0	0
30 < X < 40%	0	0
40 < X < 50%	0	0
50 < X < 60%	0	0
60 < X < 70%	0	0
70 < X < 80%	0	0
80 < X < 90%	0	0
90 < X < 100%	0	0
100%	0	0
	<b>14</b>	<b>100%</b>

Hierbei zeigt sich, dass Undersells in den mehrstufig verlaufenden Auktionsverfahren relativ selten auftreten bzw. relativ gering ausfallen. In knapp 80% der Fälle, in denen es in diesen Auktionen zu einem Preisaufschlag auf das regulierte Entgelt gekommen ist, konnten die Kapazitäten vollständig vermarktet werden. In den Auktionen, bei denen es zu einem Undersell kam, lag dieser bei durchschnittlich 7.984 kWh/h (Standardabweichung 15.289 kWh/h), bei einem durchschnittlichen Angebot von 287.345 kWh/h. Da ein Undersell in einer Jahres-, Quartals- sowie Monatsauktion zudem nicht bedeutet, dass die nicht zugeteilten Kapazitäten dem Markt nicht zur Verfügung stehen, sondern die nicht vermarkteten Kapazitäten im jeweils kürzeren Zeitraum erneut angeboten werden, halten die Fernleitungsnetzbetreiber das Auftreten eines Undersells in mehrstufig verlaufenden Jahres-, Quartals- und Monatsauktionen für vertretbar und sehen derzeit keine Veranlassung dafür, die Preisschritte in diesen Auktionen anzupassen.

Um Aussagen über die Dauer der Auflösung der Engpasssituationen treffen zu können, haben die Fernleitungsnetzbetreiber analysiert, ob und inwiefern das oben beschriebene Rückschrittverfahren den markträumenden Preis schneller findet (d. h. nach weniger Gebotsrunden) als ein Mechanismus, der von Anfang an auf Basis der jeweils kleinen Schritte den aufgerufenen Preis erhöht.<sup>4</sup> Hierbei zeigt sich relativ deutlich, dass das Rückschrittverfahren in 10 von 14 Auktionen (71,4%) der alternativen Ausgestaltung des Aufrufens von Preisen auf Basis des jeweils kleinen Preisschrittes überlegen war.

<sup>4</sup> Konkret wurde hierzu die Anzahl tatsächlich benötigter Schritte mit der Anzahl theoretisch nötiger Schritte bei Anwendung des jeweils kleinen Preisschrittes verglichen (denn nur dann wäre sichergestellt, dass diese beiden Ansätze auch denselben endgültigen Preis finden).

Undersells in einstufig verlaufenden Day-Ahead-Auktionen:

<b>Undersell = X</b>	<b>Anzahl des Auftretens</b>	<b>Anteil an Gesamtzahl</b>
0%	150	17,2%
0 < X < 10%	195	22,3%
10 < X < 20%	104	11,9%
20 < X < 30%	55	6,3%
30 < X < 40%	49	5,6%
40 < X < 50%	65	7,4%
50 < X < 60%	38	4,4%
60 < X < 70%	37	4,2%
70 < X < 80%	36	4,1%
80 < X < 90%	59	6,8%
90 < X < 100%	41	4,7%
100%	30	3,4%
	859	100%

In Day-Ahead-Auktionen treten Undersells – wie auch im letzten Evaluierungsbericht dargestellt – stärker in Erscheinung (Undersells in über 80% der Fälle in denen Kapazitäten nicht zum Startpreis der Auktion vergeben werden). Durchschnittlich beträgt der Undersell in Day-Ahead-Auktionen 135.738 kWh/h (Standardabweichung 222.089 kWh/h), bei einem durchschnittlichen Angebot von 433.431 kWh/h.

Gründe hierfür sehen die Fernleitungsnetzbetreiber auch weiterhin weniger im Auktionsmechanismus bzw. der Größe der in Day-Ahead-Auktionen angewendeten Preisschritte, sondern im wahrscheinlich (spread-gesteuerten) gleichgerichteten Verhalten von Transportkunden, die im einstufigen Day-Ahead-Verfahren versuchen, Kapazitäten bis zu einem bestimmten Preis entweder vollständig oder gar nicht zu erwerben. Zudem gehen die Fernleitungsnetzbetreiber davon aus, dass sich das Undersell-Problem im Day-Ahead-Bereich mit den im Rahmen der frühzeitigen Umsetzung des NC CAM ergebenden Anpassungen am einstufigen Auktionsalgorithmus deutlich abschwächen wird: Sowohl die sog. „Fill-or-kill“-Regelung als auch eine ratierte Zuteilung im Falle von sich nicht durch Preise auflösenden Nachfrageüberhängen wirken einem Undersell entgegen.

## 4. Anpassungen auf Basis des letzten Evaluierungsberichts

Auf Basis der Rückmeldungen, die PRISMA primary von den Plattformnutzern sowie von der BNetzA nach Start der Primärkapazitätsplattform erhielt, wurden bis Ende 2012 diverse Neuerungen auf der Primärkapazitätsplattform vorgenommen.

Konkret wurden folgende Anpassungen auf der Primärkapazitätsplattform umgesetzt:

### 1) Zusätzliche Informationen in den Buchungs- und Auktionsbestätigungen

#### a) Erweiterungen in der Buchungs- und Auktionsbestätigung

- Sofern der Transportkunde bei der Buchung einen (Sub-)Bilanzkreis ausgewählt hat, wird dieser aufgeführt
- Bei einer Umwandlung von unterbrechbarer in feste Kapazität werden die dazugehörigen Angaben aufgeführt

#### b) Erweiterung in der Buchungsbestätigung

- Ergänzung des Netzkpunktnamens

#### c) Erweiterung in der Auktionsbestätigung

- Ergänzung Produkttyp (Jahr, Quartal, Monat, Day-Ahead)
- Ergänzung Startpreis der Auktion
- Ergänzung des Auktionsaufschlag auf den Startpreis
- Ergänzung des Aufteilungsfaktors bei gebündelten Auktionen und Hinweistext zum Aufteilungsfaktor

### 2) Bündelung verschiedener Kapazitätstypen

Um die Flexibilität der angebotenen Kapazitätsprodukte zu erhöhen, wurde im Juli 2012 die Möglichkeit umgesetzt, Bündelprodukte verschiedener Kapazitätstypen (z.B. FZK, bFZK) über die Plattform anzubieten.

### 3) Übersichtlichkeit des Downloadbereiches

Während der Downloadbereich zunächst lediglich eine Auflistung aller Dokumente zuließ, wurden dem Bereich 2012 weitere Unterkategorien hinzugefügt. Durch die Untergliederung des Bereiches sind spezifische Dokumente nun nutzerfreundlicher und einfacher zu finden.

Die folgenden Unterkategorien sind nun im Downloadbereich vorzufinden: TSO<sup>5</sup>-Dokumente, Dokumente für Transportkunden, Allgemeine Informationen sowie Rechtsgrundlagen.

### 4) Verbesserung der Auktionsübersicht/Auktionsfilter

---

<sup>5</sup> Transmission System Operator (Fernleitungsnetzbetreiber)



Zusätzlich zu den bereits verfügbaren Informationen wurden weitere Informationen in die Auktionsübersicht aufgenommen, um Transportkunden das Filtern nach bestimmten Kriterien zu erleichtern. So werden durch die Ergänzungen nun die folgenden Zusatzinformationen angezeigt:

- Höhe der vermarkteten Kapazität
- Auktionsstartdatum

Die Auktionsdetails wurden um folgende Informationen erweitert:

- Startpreis & Startdatum der Auktion
- Nachgefragte Kapazität pro Auktionsfenster
- Auktionsaufschlag pro Auktionsfenster
- Vermarktete Kapazität im letzten Auktionsfenster
- Nachgefragte Kapazität in konkurrierenden Auktionen<sup>6</sup>

Des Weiteren wurde die Suchfunktion um weitere Kategorien ergänzt, um Nutzern das Suchen nach spezifischen Auktionen zu erleichtern.

#### 5) Anpassung der Day-Ahead-Komfortfunktion

Die Day-Ahead-Komfortfunktion, mit deren Hilfe Gebote automatisiert auf der Plattform voreingestellt werden können, wurde wie folgt angepasst:

- Möglichkeit, die Komfortfunktion zu jedem Zeitpunkt zu aktivieren
- Anzeige aller aktiven Komfortgebote
- Möglichkeit voreingestellte Komfortgebote zu löschen

#### 6) Transparenz

Eine weitere Anpassung der PRISMA primary galt dem Datenexport der Kapazitätsauktionen. So sind sämtliche Auktionsdaten seit August 2011 nun im Downloadbereich der Plattform als Excel-Dokumente verfügbar. Die anonymisierten Monatsberichte beinhalten sowohl Informationen zu allen abgeschlossenen Auktionen, als auch Informationen zu getätigten Kapazitätsumwandlungen (unterbrechbar zu fest).

---

<sup>6</sup> Konkurrierende Auktionen werden durchgeführt, wenn die verfügbare Kapazität in einer der betroffenen Auktionen nicht vergeben werden kann, ohne die verfügbare Kapazität in der anderen betroffenen Auktion ganz oder teilweise zu verringern

## 5. Fazit

Nach wie vor lässt sich ein positives Resümee über den Betrieb der Primärkapazitätsplattform ziehen. Zum einen wurden nach der ersten Evaluierung im Mai 2012 weitreichende Anpassungen der Plattformfunktionalitäten vorgenommen. Zum anderen wurde PRISMA primary als Europäische Kapazitätsplattform etabliert.

Hinsichtlich der zwischen dem 1. Mai 2012 und 31. März 2013 durchgeführten Auktionen hat die Evaluierung gezeigt, dass der Kapazitätsbedarf der Transportkunden insgesamt zurückgeht und dass mittlerweile kurzfristige Kapazitätsprodukte gegenüber langfristigen Kapazitätsprodukten bevorzugt werden.

Die Änderung des Startpreises für Day-Ahead-Kapazitäten zum 1. Januar 2013 von 0 Euro auf das regulierte Entgelt hat dazu geführt, dass die Nachfrage nach Tagesprodukten drastisch gesunken ist. Hier wurde deutlich, dass sich ein nicht unbeträchtlicher Teil der Nachfrage nach „kostenlosen“ Day-Ahead-Kapazitäten vor dem 1. Januar 2013 durch die Umwandlung entgeltpflichtiger unterbrechbarer Kapazitäten begründete.

Die Analyse der Auktionsalgorithmen auf Basis der Auktionen, die im Beobachtungszeitraum einen Nachfrageüberhang aufzulösen hatten, hat ergeben, dass insbesondere der mehrstufige Algorithmus (inkl. der Preisschritte) zur Vergabe von Jahres-, Quartals- und Monatskapazitäten aus Sicht der Fernleitungsnetzbetreiber nicht angepasst werden muss. Dies liegt erstens an der ohnehin äußerst geringen Zahl der aufzulösenden Nachfrageüberhänge (14 Mal in 2.149 Jahres-, Quartals- und Monatskapazitätsauktionen) und zweitens an dem innerhalb dieser 14 Fälle geringen Auftreten eines Undersells (3 Fälle). Aus Sicht der Fernleitungsnetzbetreiber sind die Anpassungsmöglichkeiten auf Grundlage einer nationalen Evaluierung in Zukunft ohnehin stark begrenzt., da die Regeln für die Vergabeverfahren in Zukunft durch den NC CAM und nach dessen Verrechtlichung mithin durch eine dem nationalen Recht übergeordnete Europäische Verordnung vorgegeben werden.

Lediglich die Größe der Preisschritte stellen in Zukunft noch Parameter dar, die auch auf rein nationaler Ebene – wenn dies als notwendig erachtet wird – angepasst werden könnten. Zum jetzigen Zeitpunkt sollte aus Sicht der Fernleitungsnetzbetreiber hier allerdings keine Änderung erfolgen und aufgrund der o.g. geringen Anzahl aufzulösender Nachfrageüberhänge sowohl an der absoluten Größe der Preisschritte als auch am Verhältnis „1 zu 5“ zwischen großen und kleinen Preisschritten in Jahres-, Quartals- und Monatsauktionen festgehalten werden. Im überwiegenden Teil der Fälle von aufzulösenden Nachfrageüberhängen führte eine Kombination von großen und kleinen Preisschritten

schneller zum Markträumungspreis, als dies mit von Anfang an anzuwendenden kleinen Preisschritten der Fall gewesen wäre.

Das im Rahmen von Day-Ahead-Auktionen wesentlich häufigere Auftreten eines Undersells wird voraussichtlich in den kommenden Jahren aufgrund der frühzeitigen Umsetzung des NC CAM und den einhergehenden Anpassungen des Day-Ahead-Algorithmus deutlich minimiert werden. Nichtsdestotrotz sind die Fernleitungsnetzbetreiber rückblickend auch weiterhin der Meinung, dass sich Undersells nicht in der Höhe der Preisschritte (0,005 €ct je kWh/h) begründen, sondern sich aus dem häufig gleichgerichteten (spread-gesteuerten) Bietverhalten der Transportkunden ergeben.

Zusammenfassend sehen die deutschen Fernleitungsnetzbetreiber aufgrund der dargelegten Ergebnisse derzeit keinen Bedarf, Anpassungen an der Auktionssystematik (mit Ausnahme der im Rahmen der „early implementation“ vom NC CAM umzusetzenden Änderungen, siehe nächster Abschnitt) vorzunehmen.

## 6. Ausblick

Seit Anfang April 2013 können über PRISMA primary ungebündelte und gebündelte Primärkapazitäten an Ein- und Ausspeisepunkten in Belgien, Dänemark, Deutschland, Frankreich, Italien, den Niederlanden und Österreich vermarktet bzw. erworben werden.

Ziel ist es, so weit wie möglich diejenigen Funktionalitäten auf der neuen Plattform anzubieten, die den Regeln des NC CAM 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.

Die gemeinschaftlich von allen beteiligten Fernleitungsnetzbetreibern realisierte neue Primärkapazitätsplattform PRISMA primary übernahm bestehende Funktionalitäten der Kapazitätsplattform TRAC-X primary, bringt aufgrund der europäischen Ausrichtung aber auch – im Vergleich zum Zeitraum bis Ende März 2013 - teilweise neue Regeln und veränderte Prozesse für die Transportkunden mit sich. Wesentliche Änderungen sind dabei in den folgenden Bereichen vorzufinden:

- 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 Auktionsalgorithmus an Vorgaben des NC CAM)

Detaillierte Ausführungen über die Ausgestaltung finden sich im „Konzept Primärkapazitätsplattform 6.0“, das auf der Internetseite [www.prisma-capacity.eu](http://www.prisma-capacity.eu) zum Download zur Verfügung steht.