

Deliberazione 5 agosto 2008 – ARG/elt 115/08

Testo integrato del monitoraggio del mercato all'ingrosso dell'energia elettrica e del mercato per il servizio di dispacciamento

L'AUTORITÀ PER L'ENERGIA ELETTRICA E IL GAS

Nella riunione del 5 agosto 2008

Visti:

- la direttiva 2003/54/CE del Parlamento europeo e del Consiglio 26 giugno 2003 (di seguito: Direttiva 2003/54/CE) ed, in particolare, l'articolo 23;
- la legge 14 novembre 1995, n. 481 (di seguito: legge n. 481/95) ed, in particolare, l'articolo 1, comma 1, l'articolo 2, comma 12, lettere da g) ad i), e l'articolo 22;
- il decreto legislativo 9 aprile 1991, n. 127 (di seguito: d.lgs. n. 127/91);
- il decreto legislativo 24 febbraio 1998, n. 58, "Testo unico delle disposizioni in materia di intermediazione finanziaria, ai sensi degli articoli 8 e 21 della legge 6 febbraio 1996, n. 52" come modificato dal decreto legislativo n. 164 del 17 settembre 2007, dal decreto legislativo n. 195 del 6 novembre 2007 e dal decreto legislativo n. 229 del 19 novembre 2007 (di seguito: d.lgs. n. 58/98);
- il decreto legislativo 16 marzo 1999, n. 79 e sue modifiche e provvedimenti applicativi (di seguito: decreto legislativo n. 79/99);
- il decreto del Presidente della Repubblica 28 dicembre 2000, n. 445 (di seguito: d.P.R. n. 445/00);
- gli indirizzi formulati in data 31 luglio 2003 dal Ministro delle Attività Produttive per la realizzazione di un sistema organizzato di offerte di vendita e di acquisto di energia elettrica (di seguito: Sistema Italia 2004);
- il decreto del Ministro delle Attività Produttive 19 dicembre 2003 recante approvazione del testo integrato della Disciplina del mercato elettrico e assunzione di responsabilità del Gestore del mercato elettrico S.p.A. relativamente al mercato elettrico (di seguito: decreto ministeriale 19 dicembre 2003) ed, in particolare, l'articolo 5;
- il decreto della Presidenza del Consiglio dei Ministri 11 maggio 2004 recante criteri, modalità e condizioni per l'unificazione della proprietà e della gestione della rete elettrica nazionale di trasmissione, ed in particolare (di seguito: DPCM 11 maggio 2004);
- la direttiva del Ministro delle attività produttive 24 dicembre 2004 (prot. n. 4159), contenente indirizzi alle società Gestore della rete di trasmissione nazionale S.p.A., Gestore del mercato elettrico S.p.A. e Acquirente unico S.p.A., ai fini della

partecipazione attiva della domanda al Sistema Italia 2004 (di seguito: direttiva ministeriale 24 dicembre 2004);

- la deliberazione dell’Autorità per l’energia elettrica e il gas (di seguito: l’Autorità) 9 giugno 2004, n. 84/04 (di seguito: deliberazione n. 84/04);
- la deliberazione dell’Autorità 25 giugno 2004, n. 102/04 (di seguito: deliberazione n. 102/04);
- la deliberazione dell’Autorità 13 gennaio 2005, n. 3/05 (di seguito: deliberazione n. 3/05);
- la deliberazione dell’Autorità 9 febbraio 2005, n. 19/05 (di seguito: deliberazione n. 19/05);
- la deliberazione dell’Autorità 24 marzo 2005, n. 50/05 (di seguito: deliberazione n. 50/05);
- l’Allegato A alla deliberazione dell’Autorità 9 giugno 2006, n. 111/06 (di seguito: deliberazione n. 111/06);
- la deliberazione dell’Autorità 23 luglio 2007, n. 186/07 (di seguito: deliberazione n. 186/06);
- la deliberazione dell’Autorità 23 luglio 2007, n. 187/07;
- la deliberazione dell’Autorità 23 luglio 2007, n. 188/07;
- la deliberazione dell’Autorità 23 luglio 2007, n. 189/07;
- la deliberazione dell’Autorità 23 luglio 2007, n. 190/07;
- la deliberazione dell’Autorità 23 luglio 2007, n. 191/07;
- l’Allegato A alla deliberazione dell’Autorità 29 dicembre 2007, n. 348/07 (di seguito: TIT);
- il documento di consultazione 6 giugno 2008, n. 17/08 (di seguito: documento di consultazione n. 17/08);
- le note della Direzione Mercati dell’Autorità del 16 maggio 2007 indirizzate alla società Gestore del Mercato Elettrico S.p.A. - prot. Autorità n. 2242 in pari data - e alla società Terna S.p.A. - prot. Autorità n. 2243 in pari data - (di seguito: note 16 maggio 2007);
- la nota della Direzione Mercati dell’Autorità del 21 dicembre 2007, prot. Autorità n. 6152 in pari data (di seguito: nota 21 dicembre 2007).

Considerato che:

- ai sensi della legge n. 481/95, l’Autorità è investita di una generale funzione di regolazione e della specifica funzione di promozione della concorrenza e dell’efficienza nell’offerta dei servizi di pubblica utilità nel settore dell’energia elettrica;
- ai sensi del decreto ministeriale 19 dicembre 2003, l’Autorità definisce i criteri per la costruzione di indici di prezzo per il mercato dell’energia elettrica, da parte del Gestore del mercato elettrico S.p.A. (di seguito: GME), e per il mercato del servizio di dispacciamento, da parte del Gestore della rete di trasmissione nazionale Spa - ora, Terna S.p.A. (di seguito: Terna) -, nonché un meccanismo per il controllo dell’esercizio del potere di mercato e le modalità per il monitoraggio dell’andamento dei prezzi sul mercato elettrico;
- ai sensi degli articoli 12, comma 3, e 13, comma 3, della deliberazione n. 50/05, GME e Terna garantiscono all’Autorità l’accesso ai dati utilizzati per il calcolo

degli indici di mercato di rispettiva competenza secondo le disposizioni della medesima delibera;

- Terna svolge, tra l'altro, il servizio di dispacciamento dell'energia elettrica sul territorio nazionale di cui all'articolo 3 del decreto legislativo n. 79/99; e che detto servizio risulta essere di pubblica utilità;
- GME svolge in esclusiva il servizio di pubblica utilità di cui all'articolo 5, comma 1, del decreto legislativo n. 79/99;
- la società Gestore dei servizi elettrici Spa (di seguito: GSE) svolge in esclusiva i servizi di pubblica utilità di cui all'articolo 1, comma 1, lettera a) del DPCM 11 maggio 2004;
- con note 16 maggio 2007, la Direzione Mercati dell'Autorità (di seguito: la Direzione Mercati), alla luce dell'esperienza maturata dall'entrata in vigore della deliberazione n. 50/05 e allo scopo di garantire l'efficiente ed efficace svolgimento delle attività di monitoraggio ha:
 - richiesto a GME e Terna di cooperare alla predisposizione di un sistema integrato di accesso ai dati per il monitoraggio e di un sistema di coordinamento fra la medesima Direzione e gli uffici di GME e Terna deputati all'espletamento delle attività di cui all'articolo 4, commi 1 e 2, della deliberazione n. 50/05;
 - evidenziato l'esigenza che le procedure di archiviazione, estrazione, trasferimento e trattamento dei medesimi dati utilizzate da GME e Terna – essendo funzionali all'esercizio delle competenze dell'Autorità – fossero tali da assicurare l'integrità e la correttezza dei medesimi dati;
 - rilevato che il predetto sistema di coordinamento fra la Direzione Mercati e gli uffici di GME e Terna avrebbe dovuto prevedere un maggiore coinvolgimento di GME e Terna nelle attività di cui all'articolo 4, commi 1 e 2, della deliberazione n. 50/05 sia in termini di risorse umane che in termini di strumenti informatici dedicati allo scopo;
- nei mesi tra maggio e dicembre dell'anno 2007 si sono svolti incontri fra la Direzione Mercati e gli uffici di GME e Terna volti a chiarire gli obiettivi del predetto percorso di riforma dei sistemi di accesso ai dati per il monitoraggio e delle modalità di svolgimento delle attività di cui all'articolo 4, commi 1 e 2, della deliberazione n. 50/05, nonché a identificare le soluzioni tecniche più idonee a conseguire tali obiettivi;
- con nota 21 dicembre 2007, la Direzione Mercati ha sottolineato che i sistemi finora predisposti per l'accesso e la condivisione dei dati e delle informazioni utili all'espletamento della funzione di monitoraggio non risultano pienamente idonei a consentire all'Autorità un efficiente ed efficace svolgimento della medesima funzione, e che la reportistica prevista dalla deliberazione n. 50/05 non è pienamente idonea a far emergere con la dovuta tempestività eventuali anomalie del mercato elettrico e le loro potenziali cause;
- con la stessa nota 21 dicembre 2007, la Direzione Mercati ha esposto a GME, Terna e GSE gli elementi per una possibile riforma della disciplina di cui alla deliberazione n. 50/05 evidenziando le principali esigenze in tal senso e le conseguenti possibili modifiche ed integrazioni, finalizzate a predisporre un sistema per l'accesso e la condivisione dei dati e un sistema di reportistica idonei ad un efficiente ed efficace esercizio della funzione di monitoraggio;

- i predetti elementi sono stati condivisi ed approfonditi nell'ambito di riunioni svoltesi nei mesi fra gennaio e aprile 2008, tra la Direzione Mercati, GME, Terna e GSE, al fine di ottimizzare la realizzazione di appositi data warehouse e di evitare l'adozione di soluzioni tecniche eccessivamente onerose in rapporto agli scopi perseguiti; e che, tali elementi possono essere così sintetizzati:
 - l'archiviazione e la condivisione con l'Autorità dei dati e degli indici di monitoraggio essenziali all'espletamento della funzione di monitoraggio devono essere assicurate tramite la progettazione, realizzazione, manutenzione e aggiornamento periodico (preferibilmente settimanale) di appositi *data warehouse*, la cui funzionalità deve essere oggetto di test nel corso di un congruo periodo di collaudo;
 - l'espletamento di un congruo periodo di collaudo deve essere esclusivamente finalizzato a testare la funzionalità dei *data warehouse* senza, beninteso, compromettere l'integrità, la completezza e l'attendibilità dei dati su base annuale;
 - i dati e gli indici di monitoraggio da archiviarsi e aggiornarsi in ciascun *data warehouse* devono essere chiaramente definiti dall'Autorità;
 - la condivisione dei dati e degli indici di monitoraggio deve essere assicurata consentendo alla Direzione Mercati di accedere a ciascun *data warehouse* tramite connessione Internet sicura, nonché di interrogare i medesimi *data warehouse* tramite uno strumento di *business intelligence* che risponda ai requisiti minimi fissati dall'Autorità;
 - l'interoperabilità dei *data warehouse* deve essere assicurata dall'utilizzo di codifiche e formati anche temporali uniformi definiti dall'Autorità, onde facilitare l'analisi incrociata dei dati e degli indici di monitoraggio archiviati in uno qualsiasi dei *data warehouse* coi dati e gli indici di monitoraggio archiviati in un qualsiasi altro fra i rimanenti *data warehouse*;
 - devono essere conservati in memoria tutti i dati e gli indici di monitoraggio relativi al periodo decorrente dal 1° gennaio 2008 e, ove necessario e fattibile, devono anche essere uniformati alle codifiche e ai formati definiti dall'Autorità i dati relativi al periodo 2004-2007;
 - le codifiche e i formati, anche temporali, utilizzati per la rappresentazione dei dati previsionali e consuntivi devono essere i medesimi e i predetti dati devono essere archiviati nel medesimo database; al riguardo il sistema deve prevedere codifiche identificative definite una sola volta nel sistema elettrico e messe a disposizione di tutti i successivi processi di archiviazione dei dati nel medesimo sistema;
 - la tempestività nel rilevamento di eventuali anomalie nel mercato di rispettiva competenza deve essere assicurata tramite l'elaborazione e trasmissione alla Direzione Mercati, secondo criteri e modalità stabiliti dalla medesima Direzione, di un rapporto settimanale:
 - i) che analizzi la struttura e gli esiti del mercato di rispettiva competenza nonché la condotta dei singoli operatori nel predetto mercato;
 - ii) che la Direzione Mercati possa utilizzare al fine di elaborare, col supporto di GME, Terna e GSE, un rapporto settimanale dell'Autorità in grado di cogliere gli effetti delle interazioni fra i mercati di rispettiva competenza di codeste società;

- l'efficacia del sistema di monitoraggio deve essere assicurata tramite la strutturazione di un opportuno meccanismo incentivante di remunerazione delle attività di cui ai precedenti alinea svolte nel rispetto dei requisiti sopraelencati; tale meccanismo deve essere basato sulla misurazione della performance in termini, per esempio, di tempestività nell'aggiornamento dei *data warehouse* e di invio dei rapporti settimanali, nonché di coerenza e correttezza dei dati e degli indici di monitoraggio archiviati nei medesimi *data warehouse*;
- inoltre, in un ulteriore incontro, svoltosi nel giugno 2008 tra la Direzione Mercati, Terna, GME e GSE, è emersa la necessità di costituire anagrafiche comuni per l'identificazione univoca, tramite codici identificativi uniformi, degli impianti di produzione, dei soggetti firmatari delle convenzioni con GSE per il ritiro dell'energia elettrica ai sensi della deliberazione n. 280/07, degli utenti del dispacciamento e degli operatori di mercato, anche per facilitare l'integrazione dei dati archiviati nei diversi data warehouse; e che il processo di costituzione di anagrafiche comuni può avvenire in concomitanza alla predisposizione da parte di GME, Terna e GSE degli schemi di progetto dei data warehouse al fine di evitare ulteriori ritardi;
- inoltre, gli elementi acquisiti nell'ambito delle istruttorie avviate con deliberazione n. 186/06 hanno evidenziato l'esigenza di introdurre una modalità di acquisizione delle informazioni che un soggetto detiene direttamente o che è in grado di reperire sui rapporti di controllo con altri soggetti caratterizzata, da un lato, dall'unicità del soggetto istituzionale (l'Autorità) destinatario delle predette informazioni e, perciò, deputato a identificare gli aggregati di soggetti rispetto ai quali calcolare gli indici di monitoraggio, e dall'altro lato, dalla chiara indicazione della documentazione da produrre per descrivere e comprovare le medesime informazioni;
- inoltre, nel quadro delle attività volte a creare un mercato elettrico integrato nella Regione del Centro-Sud Europa – che include i mercati elettrici di Italia, Francia, Germania, Austria, Slovenia e Grecia –, è stato avviato un processo per l'armonizzazione della regolazione nazionale in materia di trasparenza del mercato elettrico dei paesi appartenenti alla predetta Regione; e che, in esito a tale processo, dovrebbero emergere i principi e i criteri rispetto ai quali sarebbe opportuno si conformasse la regolazione nazionale in materia di trasparenza del mercato elettrico di ciascuno dei paesi della predetta Regione;
- è necessaria la produzione da parte di Terna di taluni dati previsionali a cadenze regolari onde consentire l'espletamento di analisi prospettiche da parte dell'Autorità;
- è necessario il confronto da parte dell'Autorità fra dati previsionali e dati consuntivi onde meglio valutare l'accuratezza delle previsioni e gli effetti di eventi imprevedibili;
- è indispensabile assicurare l'acquisizione dei dati per il monitoraggio a decorrere dall'1 gennaio 2009 al fine di consentire il computo degli indici di monitoraggio sull'intero anno 2009 e permettere così all'Autorità analisi comparative con gli anni seguenti

Considerato inoltre che:

- sulla base delle esigenze acquisite nei termini sopra descritti, l’Autorità, con il documento di consultazione n. 17/08, ha esposto i propri orientamenti in materia di riforma della disciplina del monitoraggio di cui alla deliberazione n. 50/05, pubblicando, in particolare, uno schema di testo integrato del monitoraggio del mercato all’ingrosso dell’energia elettrica e del mercato per il servizio di dispacciamento (TIMM), con annessi allegati;
- le osservazioni degli operatori di mercato e degli utenti del dispacciamento pervenute in esito al summenzionato processo di consultazione hanno evidenziato:
 - l’esigenza degli utenti del dispacciamento di adottare una cadenza mensile, piuttosto che settimanale, per la comunicazione dei dati relativi ai consumi effettivi di combustibile delle unità di produzione rilevanti, onde minimizzare l’impatto sui processi gestionali delle aziende;
 - l’esigenza degli operatori di mercato di adottare una cadenza mensile per la comunicazione dei dati relativi alle transazioni di strumenti finanziari derivati sull’energia elettrica effettuate dai medesimi operatori, onde minimizzare l’impatto sui processi gestionali delle aziende;
 - l’opportunità di circoscrivere la comunicazione di cui al precedente alinea ai dati relativi alle sole transazioni effettuate su mercati non organizzati o che non siano già nella disponibilità di un soggetto istituzionale, ritenendo preferibile che i dati relativi a transazioni effettuate su mercati organizzati o con un soggetto istituzionale siano acquisiti direttamente dal gestore del mercato organizzato o dal soggetto istituzionale coinvolto;
 - l’inopportunità di comunicare i dati relativi alle quote di capacità produttiva su cui gli operatori di mercato hanno diritto ad offrire nel mercato del giorno prima nonché i dati relativi alla capacità produttiva disponibile per ciascuna unità di produzione rilevante alla chiusura del medesimo mercato in quanto tali dati risulterebbero già disponibili nel sistema sotto forma, rispettivamente, di dichiarazione dell’utente del dispacciamento resa ai fini della registrazione di vendite o acquisti a termine sulla cosiddetta Piattaforma Conti Energia e di comunicazioni rese dal medesimo utente tramite il cosiddetto Registro delle Unità di Produzione dinamico;
- le osservazioni di GME e Terna pervenute in esito al summenzionato processo di consultazione hanno evidenziato che il mantenimento online di 10 anni di dati comporta una maggiore complessità di gestione e un potenziale peggioramento della funzionalità del data warehouse; e che, quindi, sarebbe preferibile mantenere online i dati dell’ultimo anno e off-line i dati di tutti gli anni antecedenti.

Ritenuto opportuno:

- procedere alla revisione della disciplina prevista dalla deliberazione n. 50/05 sulla scorta delle esperienze maturate negli ultimi 3 anni e in conformità con le linee guida di cui alla nota 21 dicembre 2007 condivisa da GME, Terna e GSE;
- elencare e descrivere i dati per il monitoraggio definiti dall’Autorità negli allegati A, B e C alla presente delibera;
- adottare una cadenza mensile sia per la comunicazione da parte degli utenti del dispacciamento dei dati relativi ai consumi effettivi di combustibile delle unità di produzione rilevanti nella loro responsabilità sia per la comunicazione da parte

degli operatori di mercato dei dati relativi alle transazioni di strumenti finanziari derivati sull'energia elettrica effettuate dai medesimi operatori;

- acquisire da ciascun operatore di mercato i dati relativi a tutte le transazioni di strumenti finanziari derivati sull'energia elettrica effettuate dal medesimo, sia su mercati organizzati che over-the-counter, essendo tale soggetto l'unico in grado di ricostruire e certificare la propria posizione netta complessiva su tali strumenti;
- mantenere online almeno i dati per il monitoraggio degli ultimi 5 (cinque) anni e off-line i dati per il monitoraggio di tutti gli anni antecedenti, onde facilitare l'analisi storica sul medio periodo dei dati immagazzinati nei differenti data warehouse;
- disciplinare con successivo provvedimento i processi di ristrutturazione e gestione delle anagrafiche degli impianti di produzione, dei soggetti firmatari delle convenzioni con GSE per il ritiro dell'energia ai sensi della deliberazione n. 280/07, degli utenti del dispacciamento e degli operatori di mercato;
- rivedere in futuro gli obblighi di pubblicazione di dati e informazioni, sentiti i soggetti interessati e tenuto conto degli esiti del processo in atto di armonizzazione della regolazione in materia di trasparenza dei mercati elettrici della Regione del Centro-Sud Europa

DELIBERA

1. di approvare il seguente provvedimento:

Articolo 1 *Definizioni*

- 1.1 Ai fini del presente provvedimento si applicano le definizioni richiamate e riportate all'articolo 1 dell'Allegato A alla deliberazione n. 111/06, come successivamente modificato ed integrato, e all'articolo 1 del TIT, come successivamente modificato ed integrato, nonché le seguenti:

- **capacità disponibile aggregata oraria alla chiusura del mercato** è la somma delle capacità disponibili alla chiusura del mercato considerato per le unità di produzione qualificate ad offrire nel medesimo mercato con riferimento all'ora e alla zona o macrozona considerate;
- **mercato all'ingrosso dell'energia elettrica** è l'insieme delle negoziazioni di energia elettrica che si svolgono sia nel mercato del giorno prima e nel mercato di aggiustamento, che al di fuori dei predetti mercati organizzati;
- **operatore di mercato** è un soggetto abilitato alla registrazione di acquisti e vendite a termine e dei relativi programmi C.E.T. di immissione e di prelievo e/o alla presentazione di offerte nel mercato del giorno prima e nel mercato di aggiustamento;
- **operatore di mercato estero** è un soggetto estero iscritto nell'elenco degli operatori ammessi al mercato elettrico tenuto da GME o nell'elenco degli operatori ammessi a registrare transazioni sulla Piattaforma Conti Energia;
- **offerta aggregata oraria di energia elettrica alla chiusura del mercato** è la somma delle quantità offerte in vendita alla chiusura del mercato considerato

per le unità di produzione qualificate ad offrire nel medesimo mercato con riferimento all'ora e alla zona o macrozona considerate;

- **offerta aggregata oraria di energia elettrica accettata in esito al mercato** è la somma delle quantità accettate in vendita in esito al mercato considerato per le unità di produzione qualificate ad offrire nel medesimo mercato con riferimento all'ora e alla zona o macrozona considerate;
- **offerta aggregata oraria di energia elettrica “a salire” alla chiusura della fase di programmazione del mercato per il servizio di dispacciamento** è la somma delle quantità offerte in vendita alla chiusura della fase considerata per le unità di produzione qualificate ad offrire nel mercato per il servizio di dispacciamento con riferimento all'ora e alla zona o macrozona considerate;
- **offerta aggregata oraria di energia elettrica “a scendere” alla chiusura della fase di programmazione del mercato per il servizio di dispacciamento** è la somma delle quantità offerte in acquisto alla chiusura della fase considerata per le unità di produzione qualificate ad offrire nel mercato per il servizio di dispacciamento con riferimento all'ora e alla zona o macrozona considerate;
- **offerta aggregata oraria di energia elettrica “a salire” accettata in esito alla fase di programmazione del mercato per il servizio di dispacciamento** è la somma delle quantità accettate in vendita in esito alla fase considerata per le unità di produzione qualificate ad offrire nel mercato per il servizio di dispacciamento con riferimento all'ora e alla zona o macrozona considerate;
- **offerta aggregata oraria di energia elettrica “a scendere” accettata in esito alla fase di programmazione del mercato per il servizio di dispacciamento** è la somma delle quantità accettate in acquisto in esito alla fase considerata per le unità di produzione qualificate ad offrire nel mercato per il servizio di dispacciamento con riferimento all'ora e alla zona o macrozona considerate;
- **offerta aggregata oraria di energia elettrica “a salire” accettata in esito alla fase di gestione in tempo reale del mercato per il servizio di dispacciamento** è la somma delle quantità accettate in vendita in esito alla fase considerata per le unità di produzione qualificate ad offrire nel mercato per il servizio di dispacciamento con riferimento all'ora e alla zona o macrozona considerate;
- **offerta aggregata oraria di energia elettrica “a salire” accettata in esito alla fase di gestione in tempo reale del mercato per il servizio di dispacciamento** è la somma delle quantità accettate in acquisto in esito alla fase considerata per le unità di produzione qualificate ad offrire nel mercato per il servizio di dispacciamento con riferimento all'ora e alla zona o macrozona considerate;
- **produttori che si avvalgono del ritiro dedicato** sono i soggetti firmatari delle convenzioni con GSE per il ritiro dell'energia ai sensi della deliberazione n. 280/07;
- **utente del dispacciamento estero** è un soggetto estero che ha sottoscritto un contratto di dispacciamento in immissione o in prelievo con Terna;

Articolo 2 *Oggetto e finalità*

- 2.1 Il presente provvedimento reca le disposizioni aventi ad oggetto le modalità e i criteri per lo svolgimento da parte di Terna, di GME e di GSE delle attività strumentali all'esercizio della funzione di monitoraggio del mercato elettrico da parte dell'Autorità.
- 2.2 Il presente provvedimento persegue la finalità di promuovere la concorrenza e di tutelare gli interessi di utenti e consumatori ai sensi della legge n. 481/95 tramite:
 - a) la previsione di procedure e strumenti di acquisizione, organizzazione, stoccaggio, condivisione, elaborazione e analisi dei dati e delle informazioni volti ad assicurare un efficiente ed efficace esercizio della funzione di monitoraggio del mercato elettrico;
 - b) la previsione di obblighi informativi a carico degli operatori di mercato e degli utenti del dispacciamento volti ad assicurare un efficiente ed efficace esercizio della funzione di monitoraggio del mercato elettrico.

Articolo 3

Principi e criteri generali per lo svolgimento delle attività strumentali all'esercizio delle funzioni di monitoraggio dell'Autorità

- 3.1 GME svolge le attività di acquisizione, organizzazione, stoccaggio dei dati per il monitoraggio di cui all'Allegato A, l'attività di condivisione dei medesimi dati con l'Autorità, nonché le attività di elaborazione e analisi di cui all'Articolo 5, in quanto attività strumentali all'esercizio della funzione di monitoraggio da parte dell'Autorità.
- 3.2 Terna svolge le attività di acquisizione, organizzazione, stoccaggio dei dati per il monitoraggio di cui all'Allegato B, l'attività di condivisione dei medesimi dati con l'Autorità, nonché le attività di elaborazione e analisi di cui all'Articolo 6, in quanto attività strumentali all'esercizio della funzione di monitoraggio da parte dell'Autorità.
- 3.3 GSE svolge le attività di acquisizione, organizzazione, stoccaggio dei dati per il monitoraggio di cui all'Allegato C nonché l'attività di condivisione dei medesimi dati con l'Autorità, in quanto attività strumentali all'esercizio della funzione di monitoraggio da parte dell'Autorità.
- 3.4 Ai fini di quanto previsto al comma 3.1, GME progetta, realizza, manutiene e sviluppa un apposito *data warehouse* in conformità ai criteri di cui al comma 3.7, dotandolo di uno strumento di *business intelligence* che soddisfi i requisiti di cui al comma 3.8. GME assicura la condivisione con l'Autorità dei dati per il monitoraggio di cui all'Allegato A garantendo alla Direzione Mercati l'accessibilità ai dati contenuti nel *data warehouse* di cui al presente comma tramite connessione Internet sicura. La Direzione Mercati interroga il *data warehouse* tramite lo strumento di *business intelligence* di cui al presente comma.

La Direzione Mercati si riserva tuttavia la facoltà di richiedere soluzioni tecniche per l'accesso ai dati diverse ed episodiche ove ritenuto necessario.

- 3.5 Ai fini di quanto previsto al comma 3.2, Terna progetta, realizza, manutiene e sviluppa un apposito *data warehouse* in conformità ai criteri di cui al comma 3.7, dotandolo di uno strumento di *business intelligence* che soddisfi i requisiti di cui al comma 3.8. Terna assicura la condivisione con l'Autorità dei dati per il monitoraggio di cui all'Allegato B garantendo alla Direzione Mercati dell'Autorità l'accessibilità ai dati contenuti nel *data warehouse* di cui al presente comma tramite connessione Internet sicura. La Direzione Mercati interroga il *data warehouse* tramite lo strumento di *business intelligence* di cui al presente comma. La Direzione Mercati si riserva tuttavia la facoltà di richiedere soluzioni tecniche per l'accesso ai dati diverse ed episodiche ove ritenuto necessario.
- 3.6 Ai fini di quanto previsto al comma 3.3, GSE progetta, realizza, manutiene e sviluppa un apposito *data warehouse* in conformità ai criteri di cui al comma 3.7, dotandolo di uno strumento di *business intelligence* che soddisfi i requisiti di cui al comma 3.8. GSE assicura la condivisione con l'Autorità dei dati per il monitoraggio di cui all'Allegato C garantendo alla Direzione Mercati dell'Autorità l'accessibilità ai dati contenuti nel *data warehouse* di cui al presente comma tramite connessione Internet sicura. La Direzione Mercati interroga il *data warehouse* tramite lo strumento di *business intelligence* di cui al presente comma. La Direzione Mercati si riserva tuttavia la facoltà di richiedere soluzioni tecniche per l'accesso ai dati diverse ed episodiche ove ritenuto necessario.
- 3.7 Ciascuno dei *data warehouse* di cui ai commi 3.4, 3.5 e 3.6 deve essere concepito e gestito rispettivamente da GME, Terna e GSE in maniera tale da:
- a) essere esclusivamente adibito allo svolgimento delle attività della Direzione Mercati, del rispettivo ufficio di monitoraggio di cui al comma 3.9, nonché di altri uffici della stessa società che collaborino alle attività istituzionali di quest'ultimo, purché ciò non comprometta le funzionalità del *data warehouse*;
 - b) limitare al solo personale della Direzione Mercati e del rispettivo ufficio di monitoraggio di cui al comma 3.9 l'accesso ai dati acquisiti dalla stessa società ai sensi della presente delibera;
 - c) integrare i rispettivi dati per il monitoraggio usando denominazioni, codifiche, unità di misura e formati uniformi concordati fra GME, Terna e GSE tramite un'apposita convenzione, onde consentire alla Direzione Mercati l'analisi incrociata dei dati immagazzinati nei differenti *data warehouse*;
 - d) conservare *online* i rispettivi dati per il monitoraggio per almeno 5 (cinque) anni di calendario e *off-line* per sempre, a decorrere dalla data di integrazione dei medesimi nel *data warehouse*, onde consentire l'analisi storica dei dati immagazzinati nei differenti *data warehouse*;
 - e) organizzare i dati per il monitoraggio con le modalità più idonee a soddisfare le esigenze di utilizzo dei medesimi dati identificate negli schemi di cui all'Articolo 10, commi 10.4, 10.5 e 10.6 come positivamente verificati dalla Direzione Mercati;

- f) aggiornare i rispettivi dati per il monitoraggio con frequenza settimanale, fatti salvi i dati per cui l'aggiornamento non può che avvenire con una frequenza inferiore a causa dei tempi che la regolazione vigente prevede per l'acquisizione dei medesimi dati dai sistemi sorgenti;
 - g) ampliare la base dati mediante l'aggiunta di dati elaborati o aggregati, al fine di minimizzare i tempi di calcolo degli indici di mercato di cui al presente provvedimento;
 - h) essere corredato da adeguata documentazione che illustri:
 - i) le caratteristiche tecniche del *data warehouse*;
 - ii) il dizionario dati;
 - iii) gli algoritmi utilizzati per il calcolo degli indici di mercato di cui al presente provvedimento a partire dai dati di cui agli Allegati A, B o C;
 - iv) le politiche di sicurezza.
- 3.8 Ciascuno degli strumenti di *business intelligence* di cui ai commi 3.4, 3.5 e 3.6 deve:
- a) offrire adeguate funzionalità di ricerca, estrazione, aggregazione, analisi e presentazione dei dati e delle informazioni immagazzinate nel *data warehouse* ai fini dell'attività di monitoraggio dell'Autorità;
 - b) assicurare la condivisione delle query e delle formule create con lo strumento di *business intelligence* e la riproducibilità dei loro risultati ai fini del calcolo degli indici di mercato di cui al presente provvedimento;
 - c) essere corredato da adeguata documentazione che illustri le funzionalità e le modalità di interfaccia con i dati contenuti nel *data warehouse*.
- 3.9 GME, Terna e GSE identificano ciascuno un apposito ufficio di monitoraggio destinato allo svolgimento del complesso delle attività rispettivamente elencate ai commi 3.1, 3.2 e 3.3 e, nei limiti delle risorse disponibili, delle eventuali attività istituzionali a queste connesse. L'ufficio di monitoraggio può avvalersi dei servizi comuni e della collaborazione forniti da altri uffici. L'ufficio di monitoraggio è dotato di risorse umane e materiali adeguate al corretto svolgimento del medesimo complesso di attività di cui ai commi 3.1, 3.2 e 3.3 ed è il referente dell'Autorità per l'esercizio della sua funzione di monitoraggio.

Articolo 4

Criteria generali per il computo degli indici di mercato

- 4.1 Entro 30 giorni dall'entrata in vigore della presente delibera, la Direzione Mercati notifica a GME, Terna e GSE:
- a) i criteri per la definizione degli aggregati di zone (di seguito: macrozone), degli aggregati di ore (di seguito: fasce orarie) e degli aggregati di operatori di mercato (di seguito: macrooperatore) o utenti del dispacciamento (di seguito: macrourente del dispacciamento);
 - b) i criteri per la definizione dei prezzi-limite di cui al comma 5.3, lettere f) e g);

- c) i criteri per la definizione delle fasce di prezzo di cui al comma 5.4, lettera a);
 - d) i criteri per l'attribuzione a zone e macrozone delle coperture di cui al comma 5.4, lettera b);
 - e) i criteri per la definizione del costo variabile standard per unità di produzione di cui ai commi 5.4, lettere e) ed f), e 6.4, lettera i), nonché l'attribuzione delle competenze a GME e Terna in ordine al calcolo del medesimo costo variabile standard in conformità ai predetti criteri.
- 4.2 La Direzione Mercati può notificare in qualsiasi momento a GME, Terna e GSE modifiche e integrazioni ai criteri di cui al comma 4.1, specificandone i termini di successiva decorrenza.

Articolo 5

Criteri per la definizione degli indici di mercato per il monitoraggio del mercato all'ingrosso dell'energia elettrica elaborati da GME

- 5.1 GME, attenendosi ai criteri di cui al presente articolo:
- a) redige e aggiorna almeno con cadenza annuale un documento metodologico che propone gli indici di mercato afferenti al mercato all'ingrosso dell'energia elettrica e ne descrive analiticamente relative modalità di calcolo;
 - b) redige e trasmette all'Autorità, con cadenza settimanale, un rapporto settimanale sulla struttura e sugli esiti del mercato all'ingrosso dell'energia elettrica nonché sulla condotta degli operatori di mercato rilevanti attivi nel medesimo mercato; nel redigere tale rapporto, GME è tenuto a segnalare con la massima tempestività qualsiasi dato o situazione anomala di cui sia venuto a conoscenza nell'esercizio del servizio di pubblica utilità di cui all'articolo 5, comma 1, del decreto legislativo n. 79/99;
 - c) effettua, su istanza del Direttore della Direzione Mercati, analisi ad hoc a supporto delle attività istruttorie condotte dalla Direzione Mercati nel quadro delle istruttorie conoscitive avviate dall'Autorità.
- 5.2 Gli indici di cui al comma 5.1 devono consentire, con riferimento al mercato all'ingrosso dell'energia elettrica, di monitorare l'evoluzione de:
- a) la struttura e gli esiti del mercato, secondo i criteri di cui al comma 5.3;
 - b) la condotta dei singoli operatori attivi nel mercato, secondo i criteri di cui al comma 5.4.
- 5.3 Gli indici di cui al comma 5.2, lettera a), devono offrire informazioni relative a:
- a) per ciascuna zona e macrozona e per ciascun macrooperatore di mercato, la quota della capacità disponibile aggregata oraria alla chiusura del mercato del giorno prima;
 - b) per ciascuna zona e macrozona, il grado di concentrazione della capacità disponibile oraria alla chiusura del mercato del giorno prima;
 - c) per ciascuna zona e macrozona e per ciascun macrooperatore di mercato, la quota dell'offerta aggregata oraria di energia elettrica alla chiusura dei seguenti mercati:

- i) mercato del giorno prima (la quota è calcolata in base alle offerte di vendita presentate, ivi inclusi i programmi C.E.T di immissione);
 - ii) mercato di aggiustamento (la quota è calcolata in base alle offerte di vendita presentate);
- d) per ciascuna zona e macrozona, il grado di concentrazione dell'offerta aggregata oraria di energia elettrica alla chiusura dei seguenti mercati:
 - i) mercato del giorno prima (la concentrazione è calcolata in base alle offerte di vendita presentate, ivi inclusi i programmi C.E.T di immissione);
 - ii) mercato di aggiustamento (la concentrazione è calcolata in base alle offerte di vendita presentate);
- e) per ciascuna zona e macrozona, per ciascun macrooperatore di mercato e per l'insieme delle unità abilitate di tipo termoelettrico del medesimo macrooperatore, il complemento ad uno del rapporto tra l'offerta oraria di energia elettrica e la capacità disponibile oraria alla chiusura del mercato del giorno prima;
- f) per ciascuna zona e macrozona, per ciascun macrooperatore di mercato, per l'insieme delle unità abilitate di tipo termoelettrico del medesimo macrooperatore e per ciascun prezzo-limite definito dalla Direzione Mercati ai sensi del comma 4.1, il complemento ad uno del rapporto tra l'offerta oraria di energia elettrica con prezzo minore o uguale al prezzo-limite e l'offerta oraria di energia elettrica alla chiusura del mercato del giorno prima;
- g) per ciascuna zona e macrozona, per ciascun macrooperatore di mercato, per l'insieme delle unità abilitate di tipo termoelettrico del medesimo macrooperatore e per ciascun prezzo-limite definito dalla Direzione Mercati ai sensi del comma 4.1, il complemento ad uno del rapporto tra l'offerta oraria di energia elettrica con prezzo minore o uguale al prezzo-limite e la capacità disponibile oraria alla chiusura del mercato del giorno prima ;
- h) per ciascuna zona e macrozona e per ciascun macrooperatore di mercato, la quota dell'offerta aggregata oraria di energia elettrica accettata in esito ai seguenti mercati:
 - i) mercato del giorno prima (la quota è calcolata in base alle offerte di vendita accettate, ivi inclusi i programmi C.E.T post-MGP di immissione);
 - ii) mercato di aggiustamento (la quota è calcolata in base alle offerte di vendita accettate);
- i) per ciascuna zona e macrozona, il grado di concentrazione dell'offerta aggregata oraria di energia elettrica accettata in esito ai seguenti mercati:
 - i) mercato del giorno prima (la concentrazione è calcolata in base alle offerte di vendita accettate, ivi inclusi i programmi C.E.T post-MGP di immissione);
 - ii) mercato di aggiustamento (la concentrazione è calcolata in base alle offerte di vendita accettate);
- j) per ciascuna zona e macrozona, la quota oraria di domanda elastica al prezzo, ossia la quota di domanda di energia elettrica che ha presentato offerte con indicazione di prezzo nel mercato del giorno prima;

- k) per ciascun macrooperatore di mercato, il grado di integrazione verticale che tenga conto della durata e della tipologia delle posizioni di portafoglio degli operatori distinte per orizzonti temporali rilevanti nel mercato del giorno prima e nel mercato di aggiustamento;
- l) per ciascuna zona e macrozona e per ciascuna fascia oraria, la media (aritmetica e ponderata per le quantità) e la volatilità dei prezzi di vendita e di acquisto dell'energia elettrica in esito ai seguenti mercati:
 - i) mercato del giorno prima;
 - ii) mercato di aggiustamento;
- m) per ciascuna zona e macrozona e per ciascuna fascia oraria, la media e la volatilità della differenza tra i prezzi di vendita dell'energia elettrica in esito al mercato del giorno prima e i prezzi di vendita in esito al mercato di aggiustamento;
- n) per ciascuna zona e macrozona e per ciascuna fascia oraria, il grado di correlazione fra i prezzi di vendita dell'energia elettrica in esito al mercato del giorno prima e i prezzi di vendita dell'energia elettrica in esito al mercato di aggiustamento;
- o) per ciascuna interconnessione nazionale ed estera e per ciascuna fascia oraria, la frequenza delle congestioni in esito ai seguenti mercati:
 - i) mercato del giorno prima;
 - ii) mercato di aggiustamento;
- p) per ciascuna fascia oraria, la distribuzione di frequenza delle configurazioni e delle zone di mercato risultanti dalla segmentazione del mercato in zone di mercato per effetto delle congestioni di cui alla precedente lettera o) in esito ai seguenti mercati:
 - i) mercato del giorno prima;
 - ii) mercato di aggiustamento;
- q) per ciascuna zona nazionale e per ciascuna fascia oraria, la media e la volatilità dei corrispettivi unitari per l'assegnazione della capacità di trasporto nazionale in esito ai seguenti mercati:
 - i) mercato del giorno prima;
 - ii) mercato di aggiustamento.
- r) per ciascuna interconnessione con l'estero, il valore orario della differenza fra il prezzo di vendita dell'energia elettrica nella pertinente zona estera in esito al "mercato del giorno prima" del paese confinante con l'Italia (ove tale prezzo sia quotato su un mercato regolamentato) e il prezzo di vendita dell'energia elettrica nella pertinente zona nazionale in esito al mercato del giorno prima;
- s) per ciascuna interconnessione con l'estero, l'importazione/esportazione netta oraria in esito al mercato del giorno prima;
- t) per ciascuna interconnessione con l'estero, la frequenza con cui l'importazione/esportazione netta oraria risulta incoerente con il segno del valore orario della differenza di cui alla precedente lettera r) nonché la frequenza con cui la capacità di trasmissione non risulta pienamente utilizzata in presenza di un valore orario della differenza di cui alla precedente lettera r) non nullo.

5.4 Gli indici di cui al comma 5.2, lettera b) devono offrire informazioni relative a:

- a) per ciascuna zona e macrozona, le curve di offerta orarie di energia elettrica del macrooperatore di mercato alla chiusura del mercato del giorno prima (la curva è costruita in base alle offerte di vendita presentate, ivi inclusi i programmi C.E.T di immissione, aggregando le offerte per le fasce di prezzo definite dalla Direzione Mercati ai sensi del comma 4.1;
- b) per ciascuna zona e macrozona e per ciascun macrooperatore di mercato, la copertura oraria come somma algebrica de:
 - i) le vendite o gli acquisti a termine conclusi dal macrooperatore di mercato e registrati sui Conti Energia a Termine del medesimo macrooperatore, attribuiti a ciascuna zona e macrozona nazionale secondo i criteri definiti dalla Direzione Mercati ai sensi del comma 4.1;
 - ii) le vendite o gli acquisti di strumenti finanziari derivati sull'energia elettrica la cui liquidazione abbia luogo mediante pagamento di differenziali in contanti e il cui prezzo di liquidazione sia funzione dei prezzi di acquisto dell'energia elettrica nel sistema delle offerte, conclusi dal macrooperatore di mercato, anche per il tramite di un intermediario finanziario, attribuiti a ciascuna zona e macrozona nazionale secondo i criteri definiti dalla Direzione Mercati ai sensi del comma 4.1;
 - iii) le vendite o gli acquisti di strumenti finanziari derivati sull'energia elettrica la cui liquidazione abbia luogo mediante pagamento di differenziali in contanti e il cui prezzo di liquidazione sia funzione dei prezzi di vendita dell'energia elettrica nel sistema delle offerte, conclusi dal macrooperatore di mercato, anche per il tramite di un intermediario finanziario, attribuiti a ciascuna zona e macrozona nazionale secondo i criteri definiti dalla Direzione Mercati ai sensi del comma 4.1;

Di ciascuna tipologia di copertura di cui ai punti i), ii) e iii) deve esserne offerta separata evidenza.
- c) per ciascuna zona, zona di mercato e macrozona, e ciascuna fascia oraria, la frequenza e la quota dei volumi per cui il macrooperatore di mercato è macrooperatore di mercato marginale in esito al mercato del giorno prima;
- d) per ciascuna zona, zona di mercato e macrozona, e per ciascuna ora:
 - i) la somma delle offerte di vendita presentate nel mercato del giorno prima, ivi inclusi i programmi C.E.T. di immissione, comprese in un intorno prefissato dell'offerta aggregata oraria di energia elettrica accettata in esito al mercato del giorno prima nella corrispondente zona o macrozona;
 - ii) per ciascun macrooperatore di mercato, la quota delle offerte di vendita di cui al punto i) ;
- e) per ciascun macrooperatore di mercato, il rapporto orario tra:
 - i) le offerte di vendita che sarebbero risultate accettate in esito al mercato del giorno prima per il medesimo macrooperatore qualora, a parità di altre condizioni, questi avesse presentato per ciascuna unità di produzione rilevante di tipo termoelettrico un prezzo pari al costo variabile standard definito dalla Direzione Mercati ai sensi del comma 4.1 e
 - ii) le offerte di vendita accettate in esito al mercato del giorno prima;

- f) per ciascuna zona e macrozona, per ciascuna fascia oraria, per ciascun macrooperatore di mercato e per ciascuna unità di produzione rilevante di tipo termoelettrico la media ponderata per le vendite e la volatilità dello scostamento percentuale tra il prezzo di vendita dell'energia elettrica in esito al mercato del giorno prima nella zona in cui è localizzata l'unità di produzione e il costo variabile standard definito dalla Direzione Mercati ai sensi del comma 4.1.
- 5.5 GME elabora gli indici di cui ai commi 5.3 e 5.4 con cadenza settimanale, fatto salvo quanto previsto al comma 3.7, lettera f).
- 5.6 GME immagazzina i risultati delle elaborazioni di cui al comma 5.5 nel *data warehouse* di cui al comma 3.4 e li condivide con la Direzione Mercati con le medesime modalità previste al predetto comma.
- 5.7 La Direzione Mercati definisce quali fra gli indici di cui al presente articolo possono essere resi pubblici e con quali modalità.

Articolo 6

Criteri per la definizione degli indici di mercato per il monitoraggio del mercato per il servizio di dispacciamento elaborati da Terna

- 6.1 Terna, attenendosi ai criteri di cui al presente articolo:
- a) redige e aggiorna almeno con cadenza annuale un documento metodologico che propone gli indici di mercato afferenti al mercato per il servizio di dispacciamento e ne descrive analiticamente le relative modalità di calcolo;
 - b) redige e trasmette all'Autorità, con cadenza settimanale, un rapporto settimanale sulla struttura e sugli esiti del mercato per il servizio di dispacciamento nonché sulla condotta degli utenti del dispacciamento rilevanti attivi nel medesimo mercato; nel redigere tale rapporto, Terna è tenuta a segnalare con la massima tempestività qualsiasi dato o situazione anomala di cui sia venuta a conoscenza nell'esercizio del servizio di pubblica utilità di cui all'articolo 3 del decreto legislativo n. 79/99;
 - c) effettua, su istanza del Direttore della Direzione Mercati, analisi ad hoc a supporto delle attività istruttorie condotte dalla Direzione Mercati nel quadro delle istruttorie conoscitive avviate dall'Autorità.
- 6.2 Gli indici di cui al comma 6.1 devono consentire, con riferimento al mercato per il servizio di dispacciamento, di monitorare l'evoluzione de:
- a) la struttura e gli esiti del mercato, secondo i criteri di cui al comma 6.3;
 - b) la condotta dei singoli operatori attivi nel mercato, secondo i criteri di cui al comma 6.4.
- 6.3 Gli indici di cui al comma 6.2, lettera a), devono offrire informazioni relative a:
- a) per ciascuna zona e macrozona, per l'insieme delle unità abilitate e per ciascun macrourente del dispacciamento, la quota della capacità disponibile aggregata oraria alla chiusura della fase di programmazione del mercato per il servizio di dispacciamento;

- b) per ciascuna zona e macrozona e per l'insieme delle unità abilitate, il grado di concentrazione della capacità disponibile aggregata oraria alla chiusura della fase di programmazione del mercato per il servizio di dispacciamento;
- c) per ciascuna zona e macrozona, per ciascun macrourente del dispacciamento e per ciascuno tipo di unità abilitata, il rapporto tra la capacità disponibile oraria alla chiusura della fase di programmazione del mercato per il servizio di dispacciamento e la capacità produttiva oraria disponibile alla chiusura del mercato del giorno prima;
- d) per ciascuna zona e macrozona e per ciascun macrourente del dispacciamento la quota dell'offerta aggregata oraria di energia elettrica "a salire" alla chiusura della fase di programmazione del mercato per il servizio di dispacciamento (la quota è calcolata in base alle offerte di vendita presentate);
- e) per ciascuna zona e macrozona e per ciascun macrourente del dispacciamento la quota dell'offerta aggregata oraria di energia elettrica "a scendere" alla chiusura della fase di programmazione del mercato per il servizio di dispacciamento (la quota è calcolata in base alle offerte di acquisto presentate);
- f) per ciascuna zona e macrozona, il grado di concentrazione dell'offerta aggregata oraria di energia elettrica "a salire" alla chiusura della fase di programmazione del mercato per il servizio di dispacciamento (la concentrazione è calcolata in base alle offerte di vendita presentate);
- g) per ciascuna zona e macrozona, il grado di concentrazione dell'offerta aggregata oraria di energia elettrica "a scendere" alla chiusura della fase di programmazione del mercato per il servizio di dispacciamento (la concentrazione è calcolata in base alle offerte di acquisto presentate);
- h) per ciascuna zona e macrozona e per ciascun macrourente del dispacciamento, la quota dell'offerta aggregata oraria di energia elettrica "a salire" accettata in esito alla fase di programmazione del mercato per il servizio di dispacciamento (la quota è calcolata in base alle offerte di vendita accettate);
- i) per ciascuna zona e macrozona e per ciascun macrourente del dispacciamento, la quota dell'offerta aggregata oraria di energia elettrica "a scendere" accettata in esito alla fase di programmazione del mercato per il servizio di dispacciamento (la quota è calcolata in base alle offerte di acquisto accettate);
- j) per ciascuna zona e macrozona, il grado di concentrazione dell'offerta aggregata oraria di energia elettrica "a salire" accettata in esito alla fase di programmazione del mercato per il servizio di dispacciamento (la concentrazione è calcolata in base alle offerte di vendita accettate);
- k) per ciascuna zona e macrozona, il grado di concentrazione dell'offerta aggregata oraria di energia elettrica "a scendere" accettata in esito alla fase di programmazione del mercato per il servizio di dispacciamento (la concentrazione è calcolata in base alle offerte di acquisto accettate);
- l) per ciascuna zona e macrozona e per ciascun macrourente del dispacciamento la quota del margine di capacità qualificata alla prestazione di regolazione secondaria di potenza attiva come risultante in esito alla fase di programmazione del mercato per il servizio di dispacciamento;

- m) per ciascuna zona e macrozona e per ciascun macrourente del dispacciamento la quota del margine di capacità qualificata alla prestazione di regolazione terziaria di potenza attiva come risultante in esito alla fase di programmazione del mercato per il servizio di dispacciamento;
- n) per ciascuna zona e macrozona e per ciascun macrourente del dispacciamento, la quota dell'offerta aggregata oraria di energia elettrica "a salire" accettata in esito alla fase di gestione in tempo reale del mercato per il servizio di dispacciamento (la quota è calcolata in base alle offerte di vendita accettate);
- o) per ciascuna zona e macrozona e per ciascun macrourente del dispacciamento, la quota dell'offerta aggregata oraria di energia elettrica "a scendere" accettata in esito alla fase di gestione in tempo reale del mercato per il servizio di dispacciamento (la quota è calcolata in base alle offerte di acquisto accettate);
- p) per ciascuna zona e macrozona, il grado di concentrazione dell'offerta aggregata oraria di energia elettrica "a salire" accettata in esito alla fase di gestione in tempo reale del mercato per il servizio di dispacciamento (la concentrazione è calcolata in base alle offerte di vendita accettate);
- q) per ciascuna zona e macrozona, il grado di concentrazione dell'offerta aggregata oraria di energia elettrica "a scendere" accettata in esito alla fase di gestione in tempo reale del mercato per il servizio di dispacciamento;
- r) per ciascuna ora, l'elenco delle unità abilitate la cui selezione nel mercato per il servizio di dispacciamento sia stata effettuata a prescindere dall'ordine di merito, ossia su un sottoinsieme di unità abilitate, per la risoluzione di vincoli di gestione in sicurezza del sistema elettrico; Terna identifica differenti elenchi per:
 - i) unità selezionate a salire nella fase di programmazione del mercato per il servizio di dispacciamento;
 - ii) unità selezionate a scendere nella fase di programmazione del mercato per il servizio di dispacciamento;
 - iii) unità selezionate a salire nella fase di gestione in tempo reale del mercato per il servizio di dispacciamento;
 - iv) unità selezionate a scendere nella fase di gestione in tempo reale del mercato per il servizio di dispacciamento;
- s) per ciascuna fascia oraria e per ciascuna unità, la frequenza e i volumi medi delle selezioni da sottoinsieme distinguendo fra:
 - i) selezioni a salire nella fase di programmazione del mercato per il servizio di dispacciamento (evidenziando le accensioni);
 - ii) selezioni a scendere nella fase di programmazione del mercato per il servizio di dispacciamento (evidenziando gli spegnimenti);
 - iii) selezioni a salire nella fase di gestione in tempo reale del mercato per il servizio di dispacciamento;
 - iv) selezioni a scendere nella fase di gestione in tempo reale del mercato per il servizio di dispacciamento;
- t) per ciascuna zona e macrozona e per ciascuna ora, il minimo, il massimo, la media (ponderata per le quantità) e la volatilità dei prezzi delle offerte a scendere e delle offerte a salire provvisoriamente accettate in esito alla fase di programmazione del mercato per il servizio di dispacciamento dando

- separata evidenza al valore relativo alle selezioni appartenenti o meno agli elenchi di cui alla precedente lettera r);
- u) la media della volatilità oraria dei prezzi delle offerte a scendere e delle offerte a salire provvisoriamente accettate in esito alla fase di programmazione del mercato per il servizio di dispacciamento dando separata evidenza al valore relativo alle selezioni appartenenti o meno agli elenchi di cui alla precedente lettera r);
 - v) per ciascuna zona e macrozona e per ciascuna ora, il minimo, il massimo, la media (ponderata per le quantità) e la volatilità dei prezzi delle offerte a scendere e delle offerte a salire accettate nonché di quelle a scendere e di quelle a salire revocate in esito alla gestione in tempo reale del mercato per il servizio di dispacciamento dando separata evidenza al valore relativo alle selezioni appartenenti o meno agli elenchi di cui alla precedente lettera r);
 - w) per ciascuna fascia oraria, la media della volatilità oraria dei prezzi delle offerte a scendere e delle offerte a salire accettate o revocate in esito alla gestione in tempo reale del mercato per il servizio di dispacciamento dando separata evidenza al valore relativo alle selezioni appartenenti o meno agli elenchi di cui alla precedente lettera n);
 - x) per ciascuna area, zona e macrozona, per ciascuna ora e per ciascun prodotto a termine approvvigionato mediante procedure concorsuali conformi ai criteri di cui ai commi 60.5 e 60.6 della deliberazione n. 111/06,:
 - i) la domanda definita da Terna;
 - ii) l'offerta aggregata presentata a Terna dall'insieme degli utenti del dispacciamento entro il termine di chiusura delle procedure concorsuali;
 - iii) per ciascun macrourente del dispacciamento, la quota dell'offerta aggregata di cui al precedente punto ii);
 - iv) il minimo, il massimo, la media (ponderata per le quantità) e la volatilità dei prezzi delle offerte presentate entro il termine di chiusura delle procedure concorsuali;
 - v) l'offerta aggregata accettata da Terna in esito alle procedure concorsuali;
 - vi) per ciascun macrourente del dispacciamento, la quota dell'offerta aggregata accettata di cui al precedente punto v);
 - vii) il minimo, il massimo, la media (ponderata per le quantità) e la volatilità dei prezzi delle offerte accettate in esito alle procedure concorsuali;
 - viii) per ciascun macrourente del dispacciamento e per l'insieme delle unità abilitate di tipo termoelettrico del medesimo macrourente, il rapporto tra la capacità produttiva oraria impegnata in esito alle procedure concorsuali e la capacità disponibile oraria alla chiusura del mercato del giorno prima;
 - ix) per ciascun macrourente del dispacciamento e per l'insieme delle unità abilitate di tipo termoelettrico del medesimo macrourente, il rapporto tra la capacità oraria impegnata in esito alle procedure concorsuali e la capacità disponibile oraria alla chiusura della fase di programmazione del mercato per il servizio di dispacciamento;

- y) per ciascuna interconnessione con l'estero e per ciascuna asta annuale, mensile o giornaliera sui diritti di utilizzo della relativa capacità di trasmissione:
 - i) l'offerta di capacità di trasmissione da parte del TSO che bandisce l'asta;
 - ii) la domanda di capacità di trasmissione presentata entro il termine di chiusura delle procedure concorsuali;
 - iii) la capacità di trasmissione accettata in esito alle procedure concorsuali;
 - iv) per ciascun partecipante all'asta, la quota della domanda di cui al precedente punto ii);
 - v) per ciascun partecipante all'asta, la quota della capacità di trasmissione assegnata di cui al precedente punto iii);
 - vi) il prezzo marginale di aggiudicazione della capacità di trasmissione;
 - vii) per ciascun utente del dispacciamento, la capacità di trasmissione nominata entro il termine previsto da ciascuna procedura concorsuale.

6.4 Gli indici di cui al comma 6.2, lettera b), devono offrire informazioni relative a:

- a) per ciascuna unità abilitata la variazione oraria della potenza massima e/o minima tra la chiusura del mercato del giorno prima e la chiusura della fase di programmazione del mercato per il servizio di dispacciamento;
- b) per ciascuna unità abilitata la variazione oraria della potenza massima e/o minima tra chiusura della fase di programmazione del mercato per il servizio di dispacciamento e la chiusura della fase di gestione in tempo reale del mercato per il servizio di dispacciamento;
- c) per ciascun macrourente del dispacciamento e ciascun sottotipo di tecnologia, il prezzo medio orario zonale delle offerte a salire presentate alla chiusura della fase di programmazione del mercato per il servizio di dispacciamento, dando separata evidenza al valore relativo alle selezioni appartenenti o meno agli elenchi di cui al comma 6.3, lettera r);
- d) per ciascun macrourente del dispacciamento e ciascun sottotipo di tecnologia, il prezzo medio orario zonale delle offerte a scendere presentate alla chiusura della fase di programmazione del mercato per il servizio di dispacciamento, dando separata evidenza al valore relativo alle selezioni appartenenti o meno agli elenchi di cui al comma 6.3, la lettera r);
- e) per ciascun macrourente del dispacciamento e ciascun sottotipo di tecnologia, il prezzo medio orario zonale delle offerte a salire accettate in esito alla fase di programmazione del mercato per il servizio di dispacciamento, dando separata evidenza al valore relativo alle selezioni appartenenti o meno agli elenchi di cui al comma 6.3, lettera r);
- f) per ciascun macrourente del dispacciamento e ciascun sottotipo di tecnologia, il prezzo medio orario zonale delle offerte a scendere accettate in esito alla fase di programmazione del mercato per il servizio di dispacciamento, dando separata evidenza al valore relativo alle selezioni appartenenti o meno agli elenchi di cui al comma 6.3, la lettera r);
- g) per ciascun macrourente del dispacciamento e ciascun sottotipo di tecnologia, il prezzo medio orario zonale delle offerte a salire accettate in esito alla fase di gestione in tempo reale del mercato per il servizio di

- dispacciamento, dando separata evidenza al valore relativo alle selezioni appartenenti o meno agli elenchi di cui al comma 6.3, lettera r);
- h) per ciascun macrourente del dispacciamento e ciascun sottotipo di tecnologia, il prezzo medio orario zonale delle offerte a scendere accettate in esito alla fase di gestione in tempo reale del mercato per il servizio di dispacciamento, dando separata evidenza al valore relativo alle selezioni appartenenti o meno agli elenchi di cui al comma 6.3, la lettera r);
 - i) per ciascun macrourente del dispacciamento, il rapporto orario tra:
 - i) le offerte di vendita che sarebbero risultate accettate in esito al mercato per il servizio di dispacciamento per il medesimo macrourente qualora, a parità di altre condizioni, questi avesse presentato per una specifica unità di produzione abilitata di tipo termoelettrico un prezzo pari al costo variabile standard definito dalla Direzione Mercati ai sensi del comma 4.1 e
 - ii) le offerte di vendita accettate in esito al mercato per il servizio di dispacciamento con riferimento alla medesima unità di produzione abilitata di tipo termoelettrico.
- 6.5 Terna elabora gli indici di cui ai commi 6.3 e 6.4 con cadenza settimanale, fatto salvo quanto previsto al comma 3.7, lettera f).
- 6.6 Terna immagazzina i risultati delle elaborazioni di cui al comma 6.5 nel *data warehouse* di cui al comma 3.5 e li condivide con la Direzione Mercati con le medesime modalità previste al predetto comma.
- 6.7 La Direzione Mercati definisce quali fra gli indici di cui al presente articolo possono essere resi pubblici e con quali modalità.

Articolo 7

Dati previsionali

- 7.1 Entro il 20 ottobre di ciascun anno, Terna elabora e archivia nel *data warehouse* di cui al comma 3.5 i seguenti dati previsionali riferiti all'anno successivo:
- a) fabbisogno orario di energia elettrica per zona e macrozona;
 - b) fabbisogno orario di riserva secondaria e terziaria per zona e macrozona;
 - c) capacità disponibile oraria per zona e macrozona, per ciascun macrourente del dispacciamento, dell'insieme delle rispettive unità di produzione rilevanti di tipo termoelettrico come risultante in base al piano di annuale di indisponibilità delle unità rilevanti approvato da Terna;
 - d) produzione oraria di energia elettrica per zona e macrozona, per ciascun macrourente del dispacciamento, dell'insieme delle rispettive unità di produzione, ad eccezione di quelle di cui alla precedente lettera c), distinta per le seguenti classi:
 - i) produzione da unità non rilevanti;
 - ii) produzione da unità rilevanti CIP6 o 280/07;
 - iii) produzione o consumo da unità di pompaggio rilevanti;
 - iv) produzione da unità rilevanti di altro tipo di tecnologia;

- e) importazione o esportazione netta oraria di energia elettrica, per ciascuna interconnessione con l'estero;
- f) limiti orari di transito tra zone e tra macrozone come risultante in base ai piani annuali di indisponibilità delle reti approvati da Terna.

I dati previsionali di cui al presente comma vengono successivamente aggiornati entro il 20 dicembre del medesimo anno.

Articolo 8

Obblighi informativi a carico degli operatori di mercato e degli utenti del dispacciamento

- 8.1 Ai fini di quanto previsto al comma 4.1, lett. a), ciascun operatore di mercato e ciascun utente del dispacciamento fornisce all'Autorità una relazione avente ad oggetto la ricostruzione dei rapporti di controllo, intercorrenti rispettivamente con uno o più operatori di mercato o utenti del dispacciamento o produttori che si avvalgono del ritiro dedicato, ai sensi degli artt. 25 e 26 del d.lgs. n. 127/91, corredata da un organigramma del gruppo che evidenzia i predetti rapporti e da una copia, in formato elettronico, dell'ultimo bilancio consolidato.
- 8.2 Ai fini di quanto previsto al comma 4.1, lett. a), ciascun operatore di mercato estero e ciascun utente del dispacciamento estero fornisce all'Autorità una relazione avente ad oggetto la ricostruzione dei rapporti di controllo, intercorrenti rispettivamente con uno o più operatori di mercato o utenti del dispacciamento o produttori che si avvalgono del ritiro dedicato, sulla base degli stessi criteri di cui agli artt. 25 e 26 del d.lgs. n. 127/91, corredata da un organigramma del gruppo che evidenzia i predetti rapporti e da una copia, in formato elettronico, dell'ultimo bilancio consolidato redatto ai sensi della normativa in vigore nello stato di appartenenza.
- 8.3 Entro 60 giorni dall'entrata in vigore del presente provvedimento, le informazioni e la documentazione di cui ai commi 8.1 e 8.2 devono essere fornite all'Autorità dal legale rappresentante di ciascun operatore di mercato o di ciascun utente del dispacciamento facenti parte del medesimo gruppo con dichiarazione resa ai sensi degli artt. 47 e 76 del d.P.R. n. 445/00 secondo il modulo predisposto dall'Autorità. Ogni successiva variazione dei rapporti di controllo, così come rappresentati ai sensi dei commi 8.1 e 8.2, dovrà essere comunicata con le modalità di cui al presente comma entro 30 giorni dal momento in cui tale variazione si è verificata.
- 8.4 Entro il giorno 15 (quindici) del mese successivo a quello di negoziazione, gli operatori di mercato dichiarano a GME, con le modalità dallo stesso definite, le vendite e gli acquisti di strumenti finanziari derivati sull'energia elettrica negoziata nel mercato elettrico conclusi dai medesimi operatori, anche indirettamente tramite qualsiasi tipo di intermediazione.
- 8.5 Entro il giorno 15 (quindici) del mese successivo a quello di produzione, gli utenti del dispacciamento dichiarano a Terna, con le modalità dalla stessa definite, i consumi di combustibile su base giornaliera per il gas naturale e settimanale per

gli altri combustibili, ove non sia già disponibile una rilevazione con maggiore granularità, di ciascuna unità rilevante nella disponibilità del medesimo utente.

- 8.6 Entro il termine di chiusura del mercato del giorno prima, gli operatori di mercato hanno facoltà di dichiarare a GME, con le modalità dallo stesso definite, le quote della capacità disponibile oraria di ciascuna unità su cui hanno ricevuto delega ad offrire nel mercato del giorno prima dal relativo utente del dispacciamento. In assenza di tale dichiarazione, GME assume valida ai fini del computo degli indici di monitoraggio di cui al presente provvedimento la dichiarazione resa dal medesimo utente del dispacciamento ai sensi dell'articolo 18, comma 18.3, lettera b), della deliberazione n. 111/06.
- 8.7 Entro il termine di chiusura del mercato del giorno prima, gli utenti del dispacciamento hanno facoltà di dichiarare a Terna, con le modalità dalla stessa definite, la capacità disponibile oraria di ciascuna unità rilevante nella propria responsabilità. In assenza di tale dichiarazione, GME assume valida ai fini del computo degli indici di monitoraggio di cui al presente provvedimento l'ultima dichiarazione di capacità disponibile resa dall'utente del dispacciamento sul Registro delle Unità di Produzione dinamico prima della chiusura del mercato del giorno prima.

Articolo 9

Criteria di remunerazione

- 9.1 Entro e non oltre il 31 dicembre di ciascun anno, GME, Terna e GSE inviano all'Autorità una documentata relazione tecnica avente ad oggetto i costi sostenuti per lo svolgimento delle attività di cui all'articolo 3, commi 3.1, 3.2 e 3.3.
- 9.2 Ai fini del riconoscimento dei costi sostenuti per lo svolgimento delle attività di cui all'articolo 3, commi 3.1, 3.2 e 3.3, GME, Terna e GSE hanno l'obbligo di tenere separata evidenza contabile dei medesimi costi tramite una commessa di contabilità analitica.
- 9.3 L'Autorità quantifica, entro un periodo di 45 (quarantacinque) giorni dal ricevimento della relazione di cui al comma 9.1, l'ammontare dei costi riconosciuti per le attività di cui all'Articolo 3, commi 3.1, 3.2 e 3.3. I costi riconosciuti sono quantificati dall'Autorità in coerenza con le metodologie già in uso per il riconoscimento dei costi relativi alle infrastrutture soggette a regolazione.
- 9.4 La Direzione Mercati, in esito ai collaudi di cui all'Articolo 10, comma 10.8, definisce i livelli base per le prestazioni dei *data warehouse* e degli strumenti di *business intelligence*. L'Autorità, con successivo provvedimento, definisce un meccanismo di remunerazione incentivante volto ad assicurare il progressivo miglioramento delle predette prestazioni.

Articolo 10

Disposizioni transitorie e finali

- 10.1 E' previsto un periodo di prova della durata di 60 (sessanta) giorni dall'entrata in vigore del presente provvedimento, finalizzato a testare le funzionalità dei *data warehouse* e degli strumenti di *business intelligence* già in uso presso GME, Terna e GSE all'entrata in vigore del presente provvedimento.
- 10.2 Nelle more della messa in opera dei *data warehouse* e degli strumenti di *business intelligence* di cui ai commi 3.4, 3.5 e 3.6 nonché ai fini di quanto previsto al comma 10.1, GME, Terna e GSE assicurano alla Direzione Mercati l'accesso tramite connessione Internet sicura ai *data warehouse* e agli strumenti di *business intelligence* di cui al comma 10.1 a decorrere dall'entrata in vigore del presente provvedimento. GME, Terna e GSE forniscono, inoltre, il supporto tecnico utile a circostanziare le esigenze conoscitive sottostanti agli Allegati A, B e C, all'Articolo 5 e all'Articolo 6 nonché ad identificare le soluzioni tecniche più efficienti ed efficaci agli adempimenti di cui all'Articolo 3.
- 10.3 Entro 60 (sessanta) giorni dall'inizio del periodo di prova di cui al comma 10.1, GME, Terna e GSE trasmettono alla Direzione Mercati lo schema della convenzione di cui all'Articolo 3, comma 3.7, lettera c), corredato da una relazione tecnica. La medesima Direzione, entro 15 (quindici) giorni dal ricevimento dello schema, ne verifica la conformità ai criteri di cui al presente provvedimento, potendo chiederne modifiche ed integrazioni. Decorso inutilmente tale termine, lo schema si intende positivamente verificato e deve essere tempestivamente sottoscritto da Terna, GME e GSE.
- 10.4 Ai fini degli adempimenti di cui al comma 3.4 e al comma 5.1, entro 90 (novanta) giorni dall'inizio del periodo di prova di cui al comma 10.1, GME trasmette alla Direzione Mercati:
- a) uno schema di progetto del *data warehouse* di cui al comma 3.4 e uno schema descrittivo delle funzionalità e delle modalità di interfaccia coi dati archiviati nel medesimo *data warehouse* mediante lo strumento di *business intelligence* di cui al medesimo comma, corredati di una relazione tecnica che ne comprovi tempi e costi di messa in opera;
 - b) uno schema del documento metodologico di cui al comma 5.1, lettera a);
 - c) uno schema del rapporto settimanale di cui al comma 5.1, lettera b).
- La medesima Direzione, entro 30 giorni dal ricevimento degli schemi di cui al presente comma, ne verifica la conformità ai criteri di cui al presente provvedimento, potendo chiederne modifiche ed integrazioni. Decorso inutilmente tale termine, gli schemi si intendono positivamente verificati.
- 10.5 Ai fini degli adempimenti di cui al comma 3.5 e al comma 6.1, entro 90 (novanta) giorni dall'inizio del periodo di prova di cui al comma 10.1, Terna trasmette alla Direzione Mercati:
- a) uno schema di progetto del *data warehouse* di cui al comma 3.5 e uno schema illustrativo delle funzionalità e delle modalità di interfaccia coi dati archiviati nel medesimo *data warehouse* mediante lo strumento di *business intelligence* di cui al medesimo comma, corredati di una relazione tecnica che ne comprovi tempi e costi di messa in opera;

- b) uno schema del documento metodologico di cui al comma 6.1, lettera a);
- c) uno schema del rapporto settimanale di cui al comma 6.1, lettera b).

La medesima Direzione, entro 30 giorni dal ricevimento degli schemi di cui al presente comma, ne verifica la conformità ai criteri di cui al presente provvedimento, potendo chiederne modifiche ed integrazioni. Decorso inutilmente tale termine, gli schemi si intendono positivamente verificati.

- 10.6 Ai fini degli adempimenti di cui al comma 3.6, entro 90 (novanta) giorni dall'inizio del periodo di prova di cui al comma 10.1, GSE trasmette alla Direzione Mercati uno schema di progetto del *data warehouse* di cui al comma 3.6 e uno schema illustrativo delle funzionalità e delle modalità di interfaccia coi dati archiviati nel medesimo *data warehouse* mediante lo strumento di *business intelligence* di cui al medesimo comma, corredati di una relazione tecnica che ne compri tempi e costi di messa in opera. La medesima Direzione, entro 30 giorni dal ricevimento dello schema di cui al presente comma, ne verifica la conformità ai criteri di cui al presente provvedimento, potendo chiederne modifiche ed integrazioni. Decorso inutilmente tale termine, lo schema si intende positivamente verificato.
 - 10.7 Ciascuno dei *data warehouse* di cui ai commi 3.4, 3.5 e 3.6 deve essere realizzato entro l'1 gennaio 2009.
 - 10.8 Per ciascuno dei *data warehouse* di cui ai commi 3.4, 3.5 e 3.6 è previsto un periodo di collaudo di 90 (novanta) giorni, da condursi con la Direzione Mercati, che decorre dalla data di realizzazione del medesimo.
 - 10.9 In ogni caso, GME, Terna e GSE devono assicurare l'acquisizione dei dati per il monitoraggio di cui agli Allegati A, B e C al presente provvedimento a decorrere dall'1 gennaio 2009, pena l'eventuale attivazione da parte dell'Autorità di meccanismi di reazione amministrativa.
- 2. di conferire mandato al Direttore della Direzione Mercati per la predisposizione di una proposta di meccanismo di remunerazione incentivante delle attività strumentali all'esercizio della funzione di monitoraggio dell'Autorità;
 - 3. di conferire mandato al Direttore della Direzione Mercati per la predisposizione di una proposta di costituzione di anagrafiche comuni fra i soggetti istituzionali per l'identificazione univoca degli impianti di produzione, dei soggetti firmatari delle convenzioni con GSE per il ritiro dell'energia ai sensi della deliberazione n. 280/07, degli utenti del dispacciamento e degli operatori di mercato;
 - 4. di abrogare la deliberazione n. 50/05 a far data dall'invio del primo rapporto settimanale di cui al presente provvedimento;
 - 5. di pubblicare sulla Gazzetta ufficiale della Repubblica italiana e sul sito internet dell'Autorità (www.autorita.energia.it) il presente provvedimento, che entra in vigore il giorno della sua pubblicazione.

5 agosto 2008

Il Presidente: Alessandro Ortis