

# Mise en place d'une méthode de gestion de la congestion coordonnée sur l'interconnexion Allemagne-France

## *Résumé des contributions*

### 1 Contexte

RWE Transportnetz Strom GmbH, EnBW Transportnetze AG et Réseau de Transport d'Electricité (RTE) ont déclaré leur intention de mettre en place, dès le 1<sup>er</sup> janvier 2006, un mécanisme de gestion de la congestion coordonné sur l'interconnexion électrique Allemagne-France. Sur la base d'une version préliminaire du projet de règles d'allocation élaboré conjointement par les trois gestionnaires de réseaux, les régulateurs de l'énergie allemand (Federal Network Agency) et français (Commission de Régulation de l'Energie) ont souhaité lancer une consultation publique commune dans le but de faciliter la mise en œuvre d'une méthode efficace, complètement harmonisée, en conformité avec le règlement européen n° 1228/2003 et les futures « guidelines » sur la gestion des congestions.

Au total, 21 acteurs de marché ont participé à cette consultation publique. Ce document de synthèse résumé la nature des commentaires reçus pour chacune des questions posées. A l'exception des contributions confidentielles, l'ensemble des réponses est disponible sur le site Internet de chaque régulateur.

## 2 Questions ouvertes à la consultation

### 2.1 Fonctionnement du mécanisme d'enchère explicite

1. Quelle est votre préférence pour le choix des échéances de temps auxquelles les produits d'enchères explicites doivent être proposés (annuel, trimestriel, mensuel, hebdomadaire, journalier) ?

Dans l'ensemble, les participants sont d'accord pour dire que les produits annuel, mensuel et journalier sont nécessaires. Quelques participants font également part de leur intérêt pour des produits multi-annuel, trimestriel et, dans une moindre mesure, pour des produits hebdomadaires. Il est également fait mention que la question des échéances de temps retenues deviendra moins primordiale avec l'introduction de marchés secondaires de capacité liquides.

2. Lequel des trois principes mentionnés ci-dessous (ou un mélange des trois) vous paraît le plus adapté en ce qui concerne la répartition des capacités disponibles entre les différentes échéances de temps :
  - a. un maximum de capacité est alloué sur le terme le plus long et la capacité résiduelle est allouée à des échéances plus courtes.
  - b. un ratio prédéfini (%) est choisi pour répartir les capacités entre les différentes échéances de temps.
  - c. une capacité minimale est réservée pour des horizons de temps spécifiques.

La plupart des participants demande la maximisation des capacités annuelles. Dans une certaine mesure, l'option b) est également évoquée avec, dans certains cas, une répartition équilibrée (1/3, 1/3, 1/3) entre les trois échéances de temps et, dans d'autres cas, une répartition plus en faveur de l'échéance de temps annuelle.

3. Quelle méthode d'enchère (prix marginal, « pay as bid », enchère ascendante, etc.) préconisez-vous pour allouer les différents produits d'enchères et pourquoi ?

De manière générale, les participants s'accordent pour dire que la méthode du prix marginal est la méthode la plus adaptée pour donner des signaux de prix efficaces. Une des autres raisons avancées pour expliquer cette préférence vient du fait qu'elle est la méthode la plus couramment utilisée sur les autres interconnexions européennes et, en particulier, sur l'interconnexion Pays-Bas - Allemagne.

4. Pensez-vous qu'il soit nécessaire, pour des questions de pouvoir de marché, de limiter les capacités (à l'importation et/ou à l'exportation) qu'un acteur est en droit d'acquérir<sup>1</sup> et si oui, quelle limite devrait être imposée aux différentes échéances de temps? Pensez-vous qu'une telle limite pourrait être fonction de la part de marché des différents participants dans un des pays concernés et pourquoi ?

---

<sup>1</sup> En gardant à l'esprit qu'un acteur de marché peut avoir plusieurs filiales.

Une majorité d'acteurs est contre l'imposition de restrictions sur les volumes de capacité qu'un acteur est en mesure d'acquérir. Ceux qui se montrent favorables à ces restrictions de capacités proposent, par exemple, des limites à 50% de la capacité disponible par participant.

5. Pensez-vous qu'il soit préférable d'allouer les capacités annuelles et/ou mensuelles en une seule fois ou en deux ou plusieurs sessions et, si oui, pourquoi ?

Alors que les participants semblent d'accord sur le fait que la capacité mensuelle devrait être allouée en une seule fois, les avis sont plus partagés en ce qui concerne le produit annuel. Environ la moitié des participants est en faveur d'une allocation en deux fois, mais aucun consensus ne semble se dégager sur les modalités exactes de cette allocation. Certains proposent deux sessions rapprochées, à quelques semaines d'intervalle, pour allouer le même produit annuel, tandis que d'autres suggèrent d'ajouter un produit annuel différent de l'année calendaire qui serait alloué à mi-année.

Enfin, certains participants ont également manifesté un intérêt pour une allocation du même produit annuel tous les trimestres afin d'améliorer l'information sur la véritable valeur du prix de la capacité.

6. Jugez-vous important, dans le but d'empêcher certains comportements stratégiques (rétention de capacité), de limiter *ex ante* les possibilités de nommer de l'énergie dans les deux directions ? Si oui, quelles propositions recommandez-vous ?

La plupart des participants estime que le fait de garantir l'application du principe « use-it-or-lose-it », en lien avec le « netting » des capacités non utilisées, est suffisant pour empêcher les comportements stratégiques de certains acteurs de marché. Toute autre mesure préventive est jugée comme susceptible d'introduire des distorsions inutiles.

7. Jugez-vous important de créer un marché secondaire de capacités ? Si oui, quelle forme ces transferts de capacité devraient-ils prendre :
- des transferts libres réalisés dans le cadre d'un marché secondaire bilatéral avec une réconciliation finale par les GRT ?
  - des transferts organisés à travers une ré-allocation centralisée réalisée par les GRT dans le cadre des enchères explicites suivantes ?

Les participants s'accordent sur la nécessité d'introduire des marchés secondaires de capacité pour améliorer l'efficacité du marché et regrettent que les règles d'enchères proposés par les gestionnaires de réseaux ne prévoient pas leur mise en place. Il n'y a en revanche pas de consensus définitif entre les participants sur la meilleure manière d'organiser ce marché secondaire, même si une légère préférence se dégage pour les transferts libres.

8. Quel type d'engagement les GRT devraient-ils fournir par rapport aux capacités allouées et/ou aux programmes nominés ?
- Ferme et définitif dans les deux cas (capacités allouées/programmes nominés), excepté en cas de « force majeure » ?<sup>2</sup>

---

<sup>2</sup> Il est supposé qu'à ce niveau de fermeté, le risque financier supporté par les acteurs de marché, en cas de réduction physique de la capacité, est réduit au minimum.

- b. Les réductions de capacité allouées et/ou de programmes nominés sont possibles mais dans un cadre bien défini à l'avance, particulièrement en matière d'indemnisation ?<sup>3</sup>
- c. Pas de fermeté ?<sup>4</sup>
- d. Un mélange des cas a, b et/ou c? Merci d'expliquer vos préférences.

Tous les participants s'accordent sur le fait que les capacités allouées doivent être aussi fermes que possible et mentionnent les options a) ou b). Quelques participants ont souligné le fait que la garantie financière offerte par les gestionnaires de réseaux ne devait pas conduire ces derniers à réduire la capacité mise à disposition du marché. Enfin, quelques participants estiment que le schéma d'indemnisation proposé dans le projet de règles d'enchères était convenable.

9. Dans les cas 8b et 8c, où une réduction des capacités allouées et/ou des programmes nominés est possible, quelle serait selon vous la règle de réduction optimale (principalement lorsque la réduction est annoncée après l'allocation de court terme) :
- a. Réduire en priorité les droits alloués à long terme ?
  - b. Réduire en priorité les droits alloués à court terme ?
  - c. Réduire de manière proportionnelle tous les produits sans distinguer les échéances de temps auxquelles ils ont été alloués ?

Les avis sont partagés quant à la règle de réduction des capacités, dans la mesure où chacune des trois options est tour à tour mentionnée.

10. Etes-vous favorables à ce que des produits de long et moyen terme soient assortis d'une obligation de nommer pendant toute la durée du droit ? Sinon, dans quelle mesure pensez-vous qu'il soit important d'obliger les détenteurs de droits alloués à long et moyen terme de nommer fermement leurs droits suffisamment en avance de l'allocation journalière<sup>5</sup>, et pourquoi ?

Les participants s'accordent en général sur le fait qu'imposer une telle obligation ne serait pas utile.

## **2.2 Les échanges infra journaliers et d'ajustement**

Tandis que les acteurs ont répondu massivement à la première série de questions sur la mise en place d'enchères, les questions relatives aux échanges commerciaux infra journaliers et aux échanges d'ajustement ont suscité des réponses plus sporadiques.

---

<sup>3</sup> Il est supposé qu'à ce niveau de fermeté, le risque financier, en cas de réduction physique de la capacité, est partagé entre GRT et acteurs de marché.

<sup>4</sup> Il est supposé qu'à ce niveau de fermeté, le risque financier, en cas de réduction physique de la capacité, est entièrement supporté par les acteurs de marché.

<sup>5</sup> De manière à appliquer le principe « *use it or lose it* ».

### 2.2.1 Les échanges commerciaux en infra journalier

Les commentaires soulevés par les questions relatives aux échanges infra journaliers peuvent être résumés comme suit :

11. Etes-vous favorables à la mise en place d'un commerce transfrontalier infra journalier et si oui, pourquoi ?

Les acteurs du marché soutiennent nettement l'introduction d'un cadre rendant possible les échanges infra journaliers commerciaux. Les acteurs identifient les retombées positives suivantes : l'augmentation de l'efficacité globale du marché, l'accroissement de la concurrence, et l'amélioration de la flexibilité offerte aux acteurs pour équilibrer leurs positions à l'approche du temps réel.

12. Dans le cas où vous êtes favorables au développement du commerce transfrontalier infra journalier, quels obstacles de marché et/ou obstacles réglementaires vous semble-t-il nécessaire d'éliminer avant que de tels échanges puissent être réalisés ? Merci de préciser.

Environ la moitié des acteurs ayant répondu à cette question souligne un besoin d'harmonisation des différents marchés infra journaliers existants pour mettre en place un cadre efficace pour les échanges entre ces marchés. Néanmoins, le degré d'harmonisation demandé varie d'une réponse à l'autre. Deux des participants considèrent le mécanisme actuellement en vigueur en Allemagne, et fondé sur une gestion des demandes d'accès « au cas par cas », comme un obstacle pour le développement des échanges infra journaliers. Ils proposent de supprimer cet obstacle en ouvrant le marché à tous les participants.

13. Jugez-vous utile de réserver un volume minimal de capacité pour les mécanismes d'allocation infra journaliers, ou pensez-vous que la capacité non allouée et/ou non utilisée après l'allocation journalière est suffisante ?

Une large majorité des réponses plaide en défaveur de la réservation d'un volume minimal. Selon les acteurs de marché, les capacités disponibles pour les échanges infra journaliers devraient uniquement résulter du « netting » des programmes déjà nominés, ou des capacités non utilisées / non allouées lors des étapes précédentes. Les quelques participants qui soutiennent l'idée de réserver un niveau minimal de capacité pour les échanges infra journaliers nuancent leur position en précisant qu'ils ne souhaitent pas que cette pré-réservation affecte le niveau de capacité disponible lors des allocations de long terme ou J-1.

14. Jugez-vous utile d'empêcher *ex ante* certains comportements d'acteurs lors des nominations infra journalières transfrontalières afin de limiter l'apparition de résultats de marché inefficaces ? Si oui, quelles propositions recommanderiez-vous ?

Presque tous les participants jugent inutile ou non nécessaire de limiter *a priori* les possibilités de nominations au titre des échanges infra journaliers, particulièrement si les marchés existants fonctionnent correctement.

15. De manière alternative, considérez-vous qu'une surveillance de marché *ex post* pourrait suffire à empêcher certains comportements anti-concurrentiels ?

La plupart des acteurs qui se sont exprimés sur le sujet considère qu'une surveillance de marché *ex post* est suffisante pour empêcher la survenue de comportements anti-concurrentiels. Deux acteurs soutiennent même que, eu égard à la très faible activité observée sur les marchés *infra journaliers*, une surveillance *ex post* n'est pas nécessaire.

16. Trouvez-vous pertinent que les capacités allouées dans le cadre *infra journalier* (donc proche du temps réel) correspondent à des obligations (plutôt que des options) à nommer/utiliser l'énergie correspondante, et si oui, pourquoi ?

La moitié des participants estime que les capacités allouées dans le cadre *infra journalier* doivent revêtir le caractère d'option, tandis que l'autre moitié opte pour le caractère d'obligation. La principale raison évoquée pour étayer les réponses en défaveur de l'obligation de nommer est l'impact négatif que cette obligation est susceptible d'avoir sur la flexibilité offerte au marché. Parallèlement, d'autres commentaires font état du risque de perturbations que pourrait induire l'allocation de capacités *infra journalières* sans obligation de nommer sur le calcul des capacités disponibles pour les échanges d'ajustement.

17. De quelle manière pensez-vous que le commerce transfrontalier *infra journalier* devrait être organisé :
- En permettant aux acteurs de marché de réaliser des échanges *infra journaliers* dans la limite des capacités acquises lors de l'enchère *journalière* (dans l'hypothèse où une enchère explicite est mise en place pour cette échéance de temps) ? Ou,
  - En mettant en place une méthode d'allocation spécifique de la capacité *infra journalière* dans laquelle les acteurs de marché auraient la possibilité d'obtenir de la capacité non encore allouée et/ou non encore utilisée lors des allocations précédentes ?
  - A travers une combinaison des deux méthodes proposées ci-dessus ?

La majorité des participants s'exprime en faveur d'une méthode d'allocation de la capacité *infra journalière* spécifique. Ils recommandent que les capacités d'échanges mises à disposition des acteurs en *infra journalier* correspondent (i) aux capacités non allouées précédemment, (ii) aux capacités non nommées la veille et (iii) aux capacités additionnelles résultant d'une meilleure connaissance de l'état du réseau. Quatre participants mentionnent explicitement que l'allocation de capacité *infra journalière* devrait être gratuite.

18. Dans le cas où une méthode d'allocation spécifique de la capacité *infra journalière* était mise en place, quelle méthode d'allocation pensez-vous être la plus appropriée pour organiser ce commerce *infra journalier* (compte tenu de la possibilité de concentrer ces échanges en un seul guichet ou de manière continue) ? Dans le cas où votre solution préférée ne pourrait pas être, de manière réaliste, mise en œuvre dans un futur proche, merci d'indiquer votre solution « de second rang ».
- Une procédure de couplage des marchés étendue à l'horizon *infra journalier* ?<sup>6</sup>

---

<sup>6</sup> Cela nécessiterait de centraliser les échanges *infra journaliers*, ce qui n'est actuellement pas le cas.

- b. Un mécanisme d'enchère explicite ?
- c. Une autre méthode ? Merci de préciser.

Les réponses des participants ne permettent pas d'identifier clairement une préférence pour l'une des méthodes. Le market coupling et les enchères explicites ont chacun la faveur d'un quart des participants, tandis que presque la moitié des participants recommande une méthode alternative. Dans ces dernières réponses, le modèle scandinave Elbas arrive en tête, suivi du principe « premier arrivé premier servi ».

## 2.2.2 Commerce transfrontalier d'ajustement

Avant la mise en place d'échanges transfrontaliers d'ajustement, un certain nombre d'obstacles doivent être levés, comme l'indique le document de position d'ERGEG sur la compatibilité des mécanismes d'ajustement. Les deux régulateurs estiment qu'il est là aussi important de recueillir l'avis des acteurs sur ces questions.

19. Etes-vous favorables à la mise en place d'un commerce transfrontalier d'ajustement et si oui, pourquoi ?

L'établissement d'échanges transfrontaliers d'ajustement est le plus souvent souhaité. Les bénéfices attendus sont (i) l'augmentation des possibilités d'équilibrage offertes aux GRT, (ii) l'accroissement de la concurrence et (iii) la réduction des coûts d'équilibrage.

20. De quelle manière pensez-vous que le commerce transfrontalier d'ajustement devrait être organisé :

- a. En permettant aux acteurs de marché de réaliser des échanges d'ajustement dans la limite des capacités acquises lors de l'enchère journalière ou infra journalière (dans l'hypothèse où un mécanisme d'enchère explicite est mis en place à cette échéance de temps) ?
- b. En laissant les GRT gérer entre eux les échanges d'ajustement dans la limite des capacités encore disponibles ?
- c. Selon une autre méthode ?

La plupart des participants s'exprime en faveur d'une gestion des échanges d'ajustement par les GRT dans la limite des capacités encore disponibles.

21. Que pensez-vous des différences de « design » entre les différents marchés/mécanismes d'ajustement existants, et existe-t-il selon vous un besoin d'harmoniser ces « designs » ?  
Merci de préciser.

La grande majorité des participants considère comme importante l'harmonisation des « designs » afin de permettre la création d'un marché régional de l'ajustement liquide et transparent.

22. Dans quelle mesure partagez-vous les craintes selon lesquelles les différences de « design » actuelles peuvent conduire à des stratégies d'arbitrage entre les marchés ? Le cas échéant, quelles mesures correctrices recommanderiez-vous ? Merci de préciser.

Les participants confirment que des différences de « design » pourraient conduire à des arbitrages entre les différents marchés. Environ la moitié des participants considère que l'harmonisation des « designs » est une solution appropriée pour y remédier. L'autre moitié n'identifie pas de besoin particulier pour lutter contre ces arbitrages.

23. Pensez-vous qu'il soit opportun de réserver un montant minimal de capacité pour les échanges transfrontaliers d'ajustement ?

La vaste majorité des participants ne considère pas nécessaire la réservation d'une partie de la capacité d'interconnexion au bénéfice des échanges d'ajustement, car elle s'effectuerait au détriment des possibilités d'échanges commerciaux de long et court terme.