Значение антимонопольного регулирования в формировании конкурентных отношений в российской электроэнергетике

Италия, Рим
1 июня 2006 г.

Пироженко Александр
Федеральная антимонопольная служба

Цитата

«Ключом к успеху в создании конкурентного рынка электроэнергии (…) России, является формирование сильного, хорошо финансируемого, хорошо информируемого, обученного и независимого регулятора, способного обеспечить доступ к сетям и другим продуктам и услугам монополий на справедливых и разумных условиях для всех участников рынка»

Клод Мандил,

Исполнительный директор International Energy Agency (IEA)

Menu

1. Условия для развития конкуренции на рынках электроэнергии России
2. Роль ФАС России в реформе электроэнергетики
3. Риски манипулирования ценами на оптовом рынке электроэнергии
4. Система контроля манипулирования ценами: российский подход

1. Условия развития конкуренции на рынках электроэнергии России

Важнейшие условия формирования конкурентных рынков электроэнергии

На оптовом уровне:

- достаточное количество независимых друг от друга производителей
- разделение конкурентных и монопольных видов деятельности
- недискриминационный доступ к услугам естественных монополий
- система контроля манипулирования ценами
- развитая электроэненергетическая сеть

На розничном уровне:

- обеспечение возможности у потребителя выбирать поставщика электроэнергии
- отражение дифференциации стоимости электроэнергии оптового рынка в ценах розничного рынка:
  - трансляция цены оптового рынка
  - трансляция почасового учета

Конфигурация генерирующих компаний (1)

Решениями Правительства России из состава активов холдинга РАО «ЕЭС России» сформирована структура генерирующих компаний:

- 6 тепловых ОГК по экстерриториальному принципу
- 1 Гидро-ОГК на основе гидроэлектростанций
- 14 ТГК по территориальному принципу

Также на оптовом рынке действуют 5 независимых от РАО «ЕЭС России» компаний:

- Концерн «Росэнергоатом»
- «Иркутскэнерго»
- «Новосибирскэнерго»
- «Башкирэнерго»
- «Татэнерго»

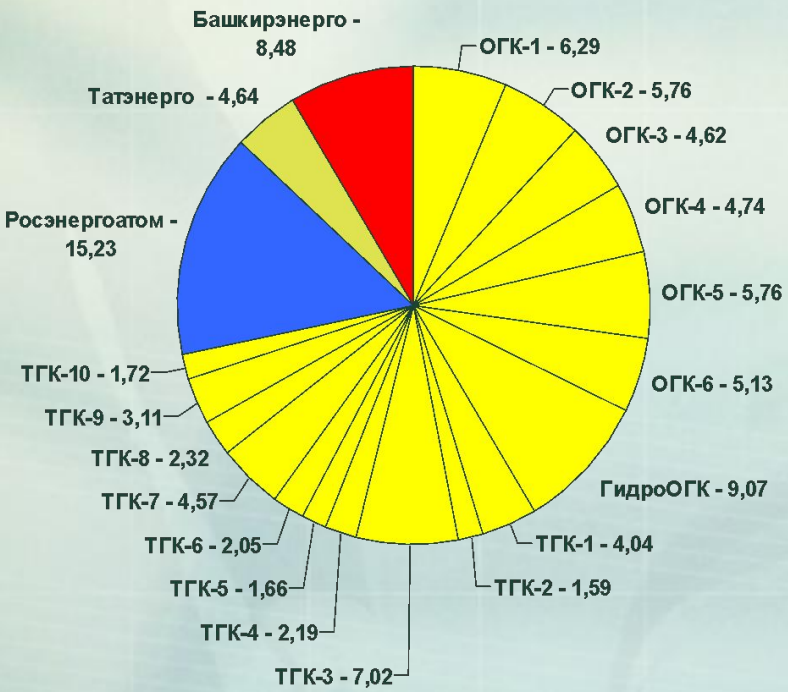
Предполагается, что в процессе реформы государство выйдет из акционерного капитала тепловых ОГК и всех ТГК

Конфигурация генерирующих компаний (2)

- Генерирующие компании сформированы с учетом максимального ограничения их рыночной силы.
- Каждая из ОГК и ТГК могла оказать наименьшее влияние на цены оптового рынка электроэнергии.
- Указанная конфигурация генерирующих компаний прошла независимую оценку ФАС России и признана как допустимая с точки зрения создания условий для развития реальной конкуренции на оптовом рынке.
- Индекс **CR-3** для каждой из двух ценовых зон оптового рынка России:
  - **Европа+Урал – 41%**
  - **Сибирь – 36%**

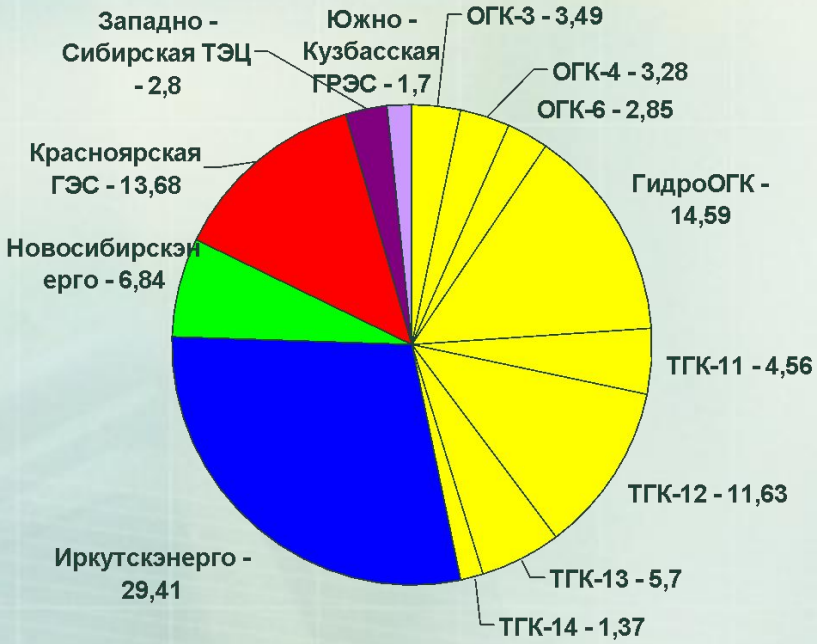
Рыночная концентрация по установленной мощности генерирующих компаний

Первая ценовая зона (Европа+Урал)



Холдинг РАО «ЕЭС Россия» - 71,65%
Концерн «Росэнергоатом» - 15,23%
Независимые производители - 13,12%

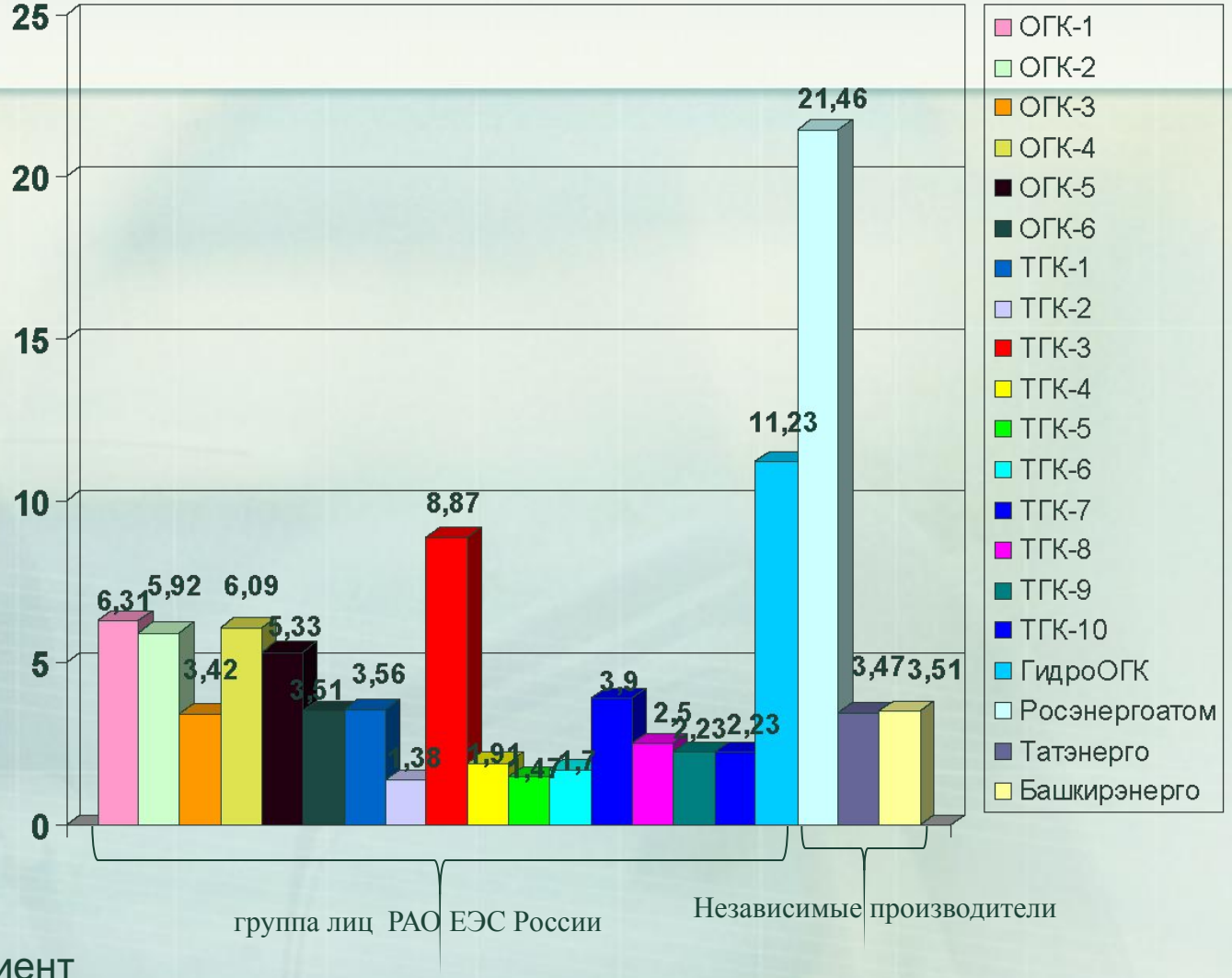
Вторая ценовая зона (Сибирь)



Холдинг РАО «ЕЭС Россия» - 45,57%
Независимые производители - 54,43%

Если бы реформа завершилась в 2005 году?

Распределение долей между генерирующими компаниями в Европе и Урале (приведенные показатели объема выработки).

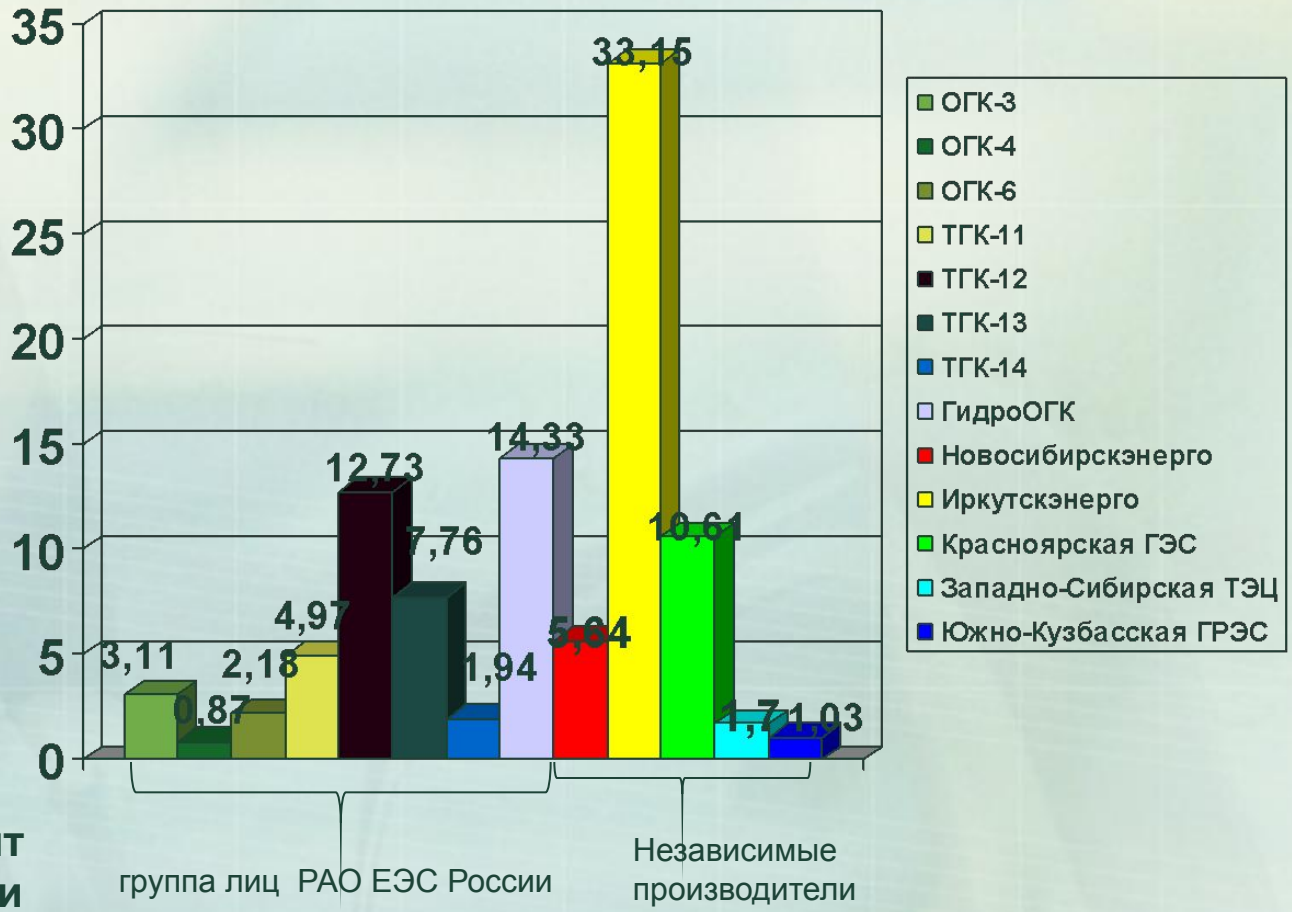


Коэффициент концентрации
CR-3 = 41,56%

Холдинг РАО «ЕЭС Россия» - 71,56%
Концерн «Росэнергоатом» - 21,46%
Независимые производители - 6,98%

Если бы реформа завершилась в 2005 году?

Распределение долей между генерирующими компаниями в Сибири (приведенные показатели объема выработки).

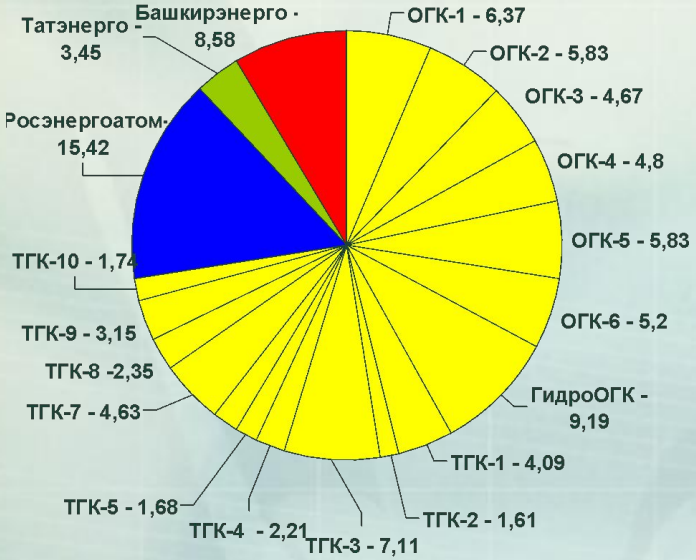


Коэффициент концентрации CR-3 = 36,49%

Холдинг РАО «ЕЭС Россия» - 46,87%
Независимые производители - 53,13%

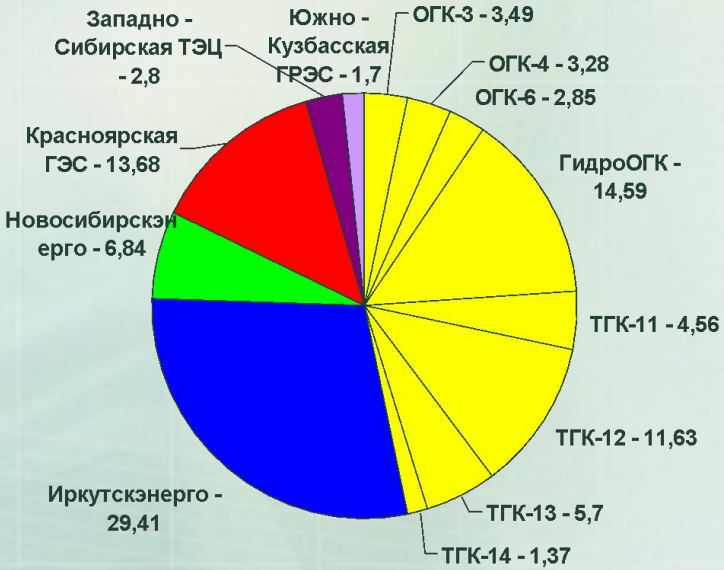
Рыночная концентрация по установленной мощности генерирующих компаний

Первая ценовая зона (Европа+Урал)



Холдинг РАО «ЕЭС Россия» - 72,55%
Концерн «Росэнергоатом» - 15,42%
Независимые АО-энерго - 12,03%

Вторая ценовая зона (Сибирь)



Холдинг РАО «ЕЭС Россия» - 45,57%
Независимые производители - 54,43%

Особенности рыночной концентрации на российском рынке

- Рыночная концентрация во Второй ценовой зоне заметно выше относительно Первой. Однако это не означает наличия большой рыночной власти лидеров – «ГидроОГК» и «Иркутскэнерго», поскольку основной вклад в производстве электроэнергии этими компаниями вносят ГЭС, возможности которых оказывать влияние на цены рынка существенно ограничены.
- При этом, как показало исследование ФАС России ситуации вокруг реформирования ОАО «Кузбассэнерго», ТГК-12 на базе ее активов обладает существенной рыночной властью и исключительным потенциалом влияния на цены рынка в Сибири. По этой причине было принято решение исключить 2 электростанции ОАО «Кузбассэнерго» из состава ТГК-12 которые должны быть проданы на аукционе до середины 2007 г.
- Значительная рыночная доля Концерна «Роэнергоатом» не пропорциональна его рыночной силе – способность влиять на цены атомных электростанций также существенно ограничена
- Правилами оптового рынка предусмотрено, что на объем технологического минимума производства (когенерация, безопасный режим работы АЭС, ограничения по водности для ГЭС) производителя подают ценопринимающие заявки

Рыночная сила производителя электроэнергии определяется:

1. Долей рынка (в т.ч. потенциальной от уст. мощности)

   Однако: границы рынка «плавают» в зависимости от текущего баланса спроса и предложения, наличия системных ограничений

2. Соотношения объема предложения производителя и «остаточного предложения» других производителей

Разделение видов деятельности в электроэнергетике

- Российским законодательством предусмотрена необходимость разделения конкурентных и естественно-монопольных видов деятельности до 1 апреля 2006 года
- Данное требование законодательства самое жесткое в мире: все энергокомпании, вне зависимости от размера должны разделить виды деятельности
- Виды деятельности должны осуществляться разными юридическими лицами, но в течение переходного периода могут быть аффилированными
- Энергокомпании, не выполнившие требование о разделении, подлежат принудительной реорганизации по суду
- До конца 2006 года процесс разделения будет в основном завершен (на данный момент более 35% компаний разделили виды деятельности)

Недискриминационный доступ к услугам монополий в электроэнергетике

В 2004 году Правительством России приняты правила недискриминационного доступа к услугам:

- сетевых компаний
- администратора торговой системы
- системного оператора

а также:

Правила присоединения к электрическим сетям

2. Роль ФАС в процессе реформирования электроэнергетики

Полномочия ФАС в электроэнергетике

1. Антимонопольный контроль в соответствии с законодательством о конкуренции

2. Антимонопольный контроль в соответствии со специальными нормами Федерального закона «Об электроэнергетике», контролирующий в том числе:
   - уровень экономической концентрации на рынке электроэнергии
   - цены на рынке электроэнергии

3. Уполномоченный Правительством орган, контролирующий:
   - администратора торговой системы
   - соблюдение правил недискриминационного доступа к инфраструктуре
   - соблюдение стандартов раскрытия информации субъектами розничного и оптового рынков
   - выполнение требований законодательства о разделении видов деятельности в электроэнергетике

Кроме того, ФАС играет активную роль в процессе определения стратегии и тактики реформирования электроэнергетики в России

Задачи ФАС на оптовом рынке электроэнергии

1. Не допустить манипуляции ценами за счет:

- **злоупотребления доминирующим положением** поставщиками электроэнергии
- **вертикальной интеграции** (в т.ч. ограничения поставок топлива)
- **горизонтальной интеграции** (аффилированности генерирующих компаний, способных вместе влиять на цену)
- **соглашений и согласованных действий** (между производителями; производителями и инфраструктурными организациями: системным оператором, администратором торговой системы, сетевыми компаниями

2. Обеспечение свободного и недискриминационного выхода потребителей и производителей на оптовый рынок

Меры снижения рисков горизонтальной и вертикальной интеграции в электроэнергетике

проблема	следствие	предложение ФАС
Горизонтальная интеграция	Повышение риска злоупотреблений рыночной силой – манипуляция ценами	Ограничить приобретение контроля группой лиц ОГК или ТГК, расположенных в одной зоне (способных вместе влиять на цены)
Вертикальная интеграция «поставщик топлива – генерирующая компания»	Вытеснение конкурирующих генераторов с рынка путем манипуляции поставками топлива – рост цен на электроэнергию	Ограничить приобретение контроля ОГК и ТГК топливными компаниями, занимающими доминирующее положение в поставках топлива на электростанции

Задачи ФАС
на розничном рынке электроэнергии

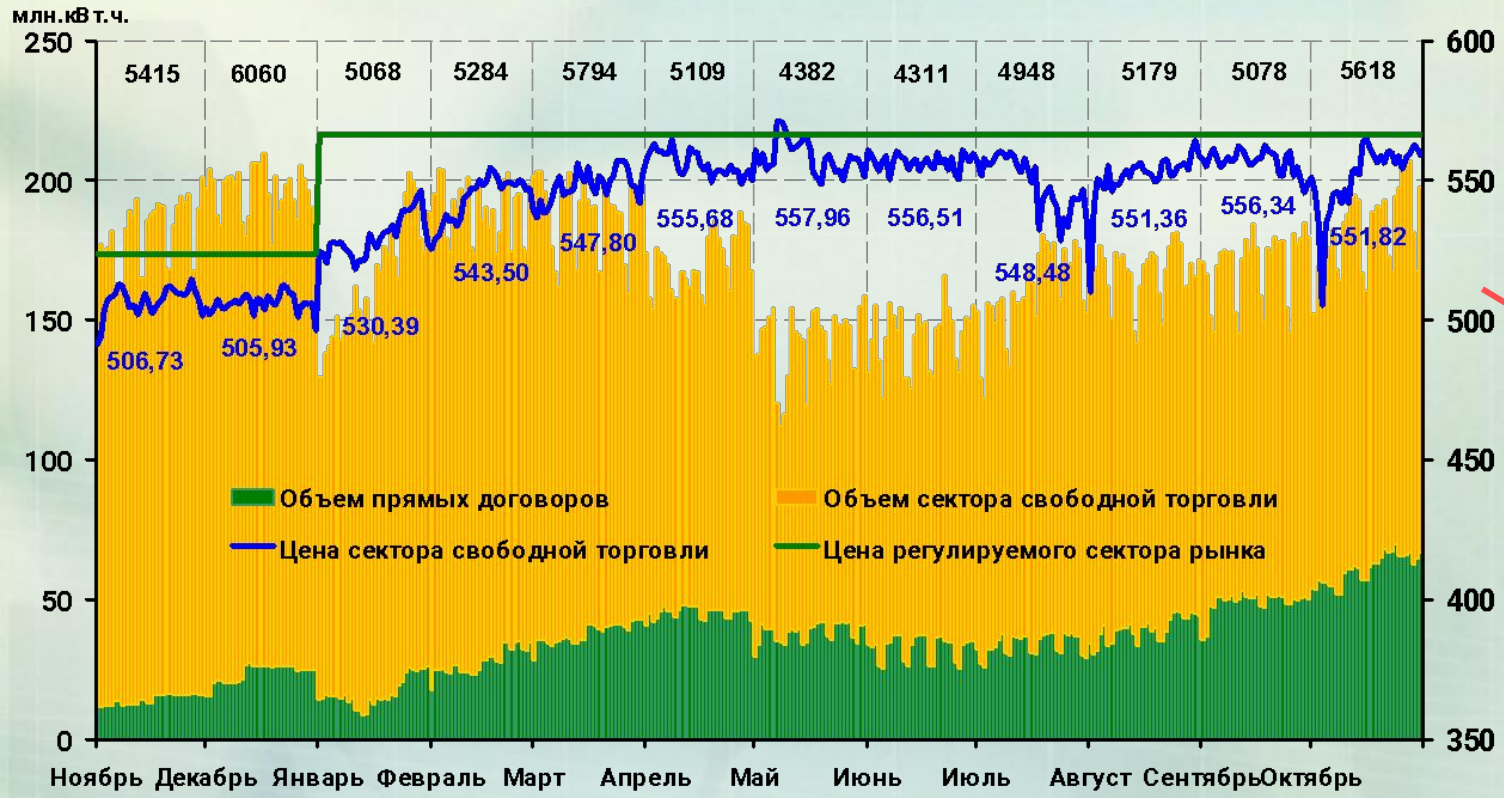
Обеспечить формирование конкуренции за счет:

- разделения конкурентных и естественно-монопольных видов деятельности
- создания условий для выхода местных энергоснабжающих организаций на оптовый рынок
- проведения справедливых конкурсов за статус гарантирующих поставщиков
- контроля недискриминационного доступа к сетям (потребителей, независимых энергосбытовых компаний)
- создания условий реализации права выбора потребителя поставщика электроэнергии

Реальная конкуренция на российской розничном рынке электроэнергии – дело ближайших 3-5 лет

3. Риски манипулирования ценами на оптовом рынке электроэнергии

Российский рынок сегодня: отсутствие ценовых рисков



Регулируемая цена (тариф)

Цена рынка

Такой рынок, где регулируемая государством цена является естественным price cap не дает объективных рыночных сигналов.

В 2006 году модель рынка будет изменена в направлении реальной конкуренции, в котрой появятся ценовые риски

Особенности рынка электроэнергии

Неэластичный спрос

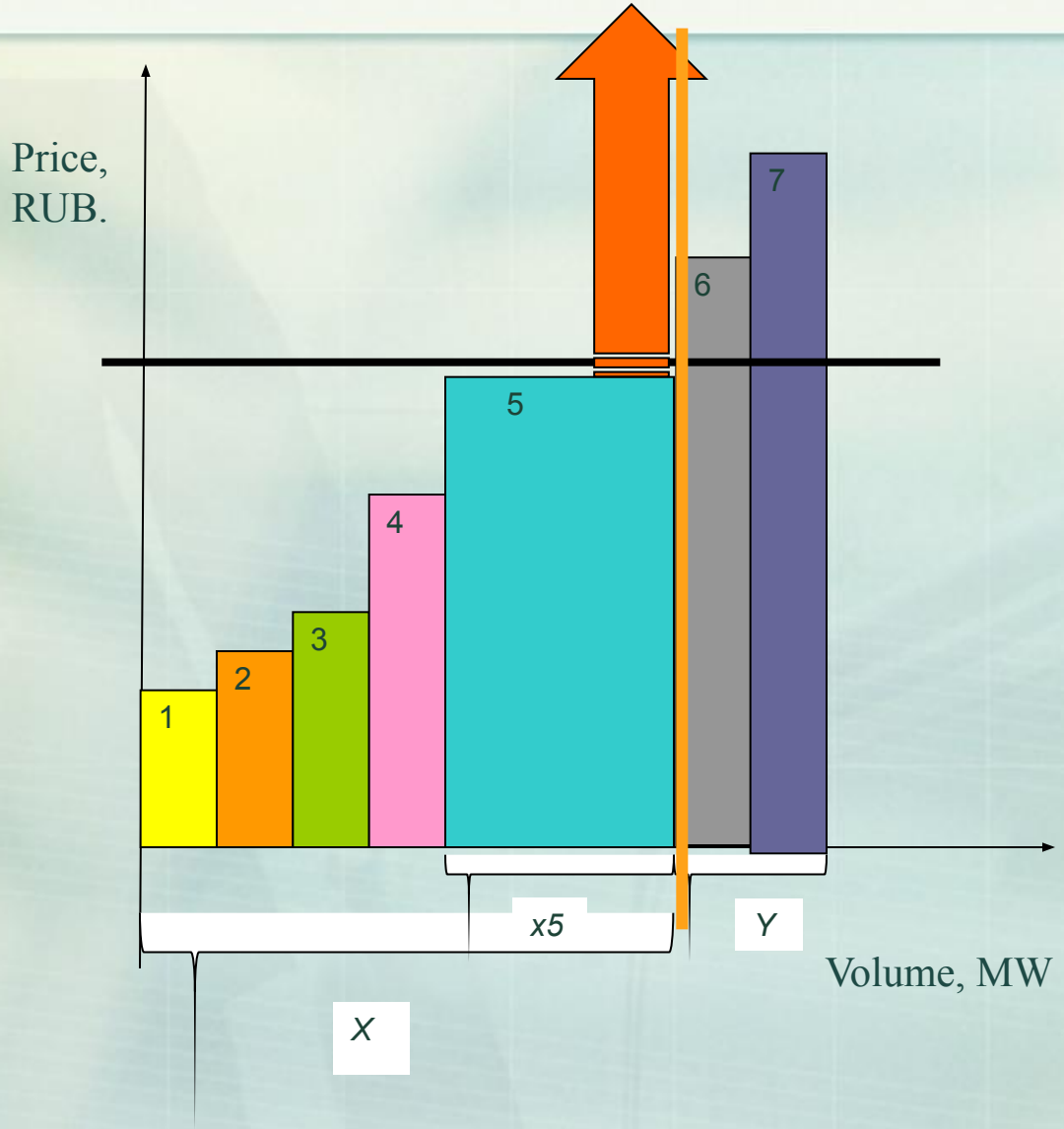
Неразрывный во времени процесс производства и потребления

Технические и технологические ограничения (производство, передача)

Особенность рынка электроэнергии с регуляторной точки зрения:

не обладая доминирующим положением в классическом понимании (доля рынка более 35%), производитель в отдельные моменты времени может манипулировать ценой на рынке (злоупотреблять своим положением)

Манипулирование ценой на рынке электроэнергии без существенной доли рынка



Без части объема **генератора №5** спрос (**вертикальная линия**) не будет удовлетворен. Ни один другой генератор не сможет заместить предлагаемый им объем электроэнергии.

Это означает, что такой генератор может повысить цену в своей заявке и сформировать цену (**горизонтальная пунктирная линия**).

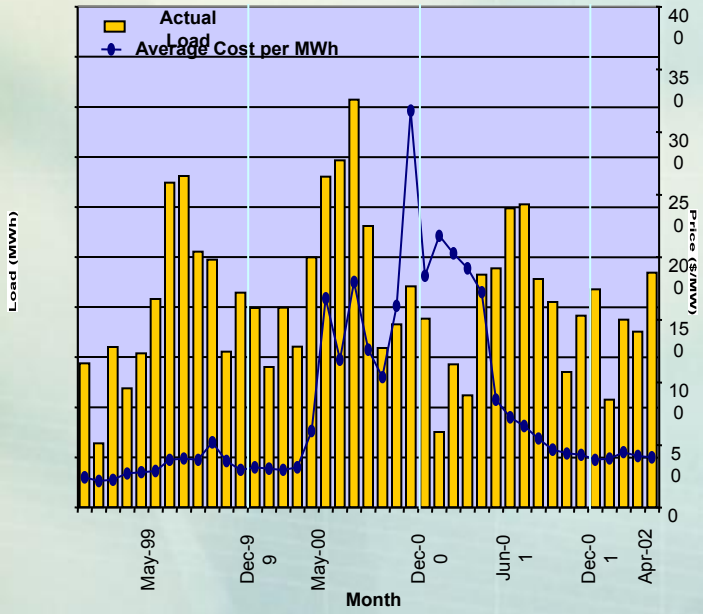
Объемы, предоставляемые любым другим генератором могут быть замещены конкурентами.

Возможность для манипулирования ценами:

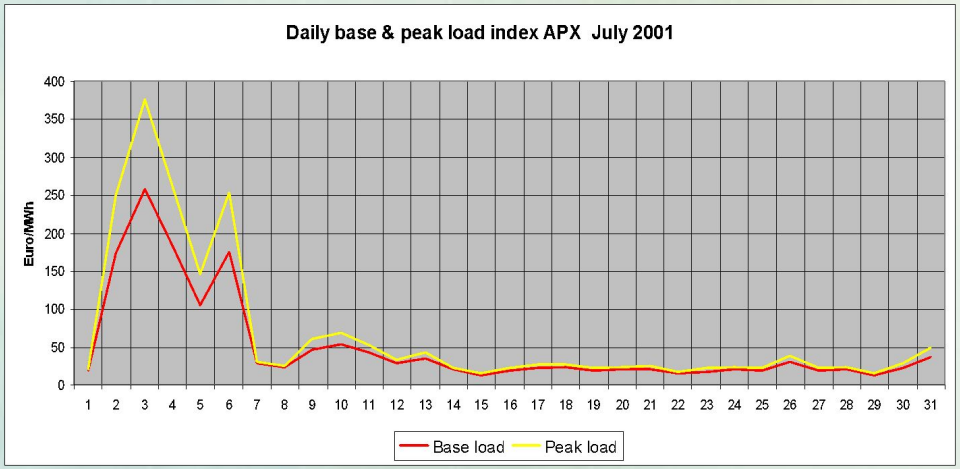
1. Не зависит напрямую от рыночной доли генерирующией компании.
2. Может возникнуть практически у каждой из ТГК или ОГК.
3. Возникает в различные периоды времени в зависимости от соотношения спроса и предложения электроэнергии, сетевых ограничений, которые зависят от:
   - погодных условий,
   - графиков планового и внепланового ремонта сетевого и генерирующего оборудования,
   - цен на топливо и других факторов.

Волатильность цен на рынках электроэнергии

CAISO (Калифорния) 2000-2001: 640%



APX (Нидерланды) 2001: 1200%



Россия не готова к таким колебаниям цен: столь значительный рост цены может «похоронить» дальнейшую либерализацию

Меры снижения рисков манипулирования ценами

- Развитый рынок финансовых инструментов (деривативы на электроэнергию и мощность) – сглаживание ценовых колебаний
- Своевременное и прозрачное развитие сетевой инфраструктуры в интересах рынка
- Информационная открытость и оперативность предоставления важной для рынка информации
- Достаточное количество независимых поставщиков электроэнергии
- Наличие профессионального, прозрачного, независимого и объективного государственного регулятора
- Эффективная система антимонопольного контроля, основанного на:
  - предупредительных мерах со стороны организатора торгов (АТС)
  - жестких санкциях со стороны государства

4. Система контроля манипулирования ценами: российский подход

Манипулирование ценами: как бороться?

- В целях снижения рисков резких колебаний цен и противодействия манипуляциям на большинстве зарубежных рынков электроэнергии действуют особые, отличные от других рынков, подходы к решению этих проблем.

- В России также будет действовать система контроля, ограничивающая возможности недобросовестного поведения на рынке электроэнергии

Российский подход (1)

1. Российская система мер контроля на ОРЭ будет основана на оценке рыночного поведения генерирующих компаний при подаче заявок на участие в РСВ и БР.
2. Будет определяться временное доминирующее положение генераторов, которые, пользуясь неэластичностью спроса по цене и сложившейся топологией сети, могут завышать цену продаваемой электроэнергии.
3. За поведением таких генераторов будет установлен особый контроль со стороны администратора торговой системы.

Российский подход (2)

1. В случае завышения (занижения) ценовой заявки доминирующим генератором по сравнению с заранее установленным уровнем, такая заявка будет автоматически корректироваться АТС
2. Критерием оценки «конкурентности» заявки генератора будет цена в ранее поданных и принятых рынком заявках этого генератора в то время, когда он не занимал доминирующего положения.
3. Окончательную оценку поведения доминирующих производителей если оно привело к завышению (занижению) цены рынка будет давать ФАС России.

Схема контроля

Участники рынка

Контролирует в соответствии с Правилами и антимонопольным законодательством **(контроль ex-post)**

Федеральная антимонопольная служба

Контролирует в соответствии с Правилами и регламентами **(контроль ex-ante)**

Контролирует в соответствии с Правилами

АТС
НЕКОММЕРЧЕСКОЕ ПАРТНЕРСТВО
АДМИНИСТРАТОР ТОРГОВОЙ СИСТЕМЫ

Перспективы системы контроля

- **Наличие системы контроля с жесткими санкциями за нарушения - необходимое и обязательное условие формирования конкурентного рынка электроэнергии**
- Со временем система будет совершенствоваться и сможет противостоять таким сложным правонарушениям как сговор, взаимосвязанные стратегии ценового поведения и др.
- До ликвидации РАО «ЕЭС России» в компании дополнительно будет действовать корпоративная система мер ответственности генеральных директоров генерирующих компаний (ТГК и ОГК) за неконкурентное поведение на ОРЭ. Такая система сейчас разрабатывается в РАО совместно со специалистами ФАС России.
- Генерирующие компании будут вынуждены учитывать при определении своего рыночного поведения наличие системы мер, не позволяющей злоупотреблять им поведением на рынке.

Спасибо за внимание. Вопросы?

© Федеральная антимонопольная служба