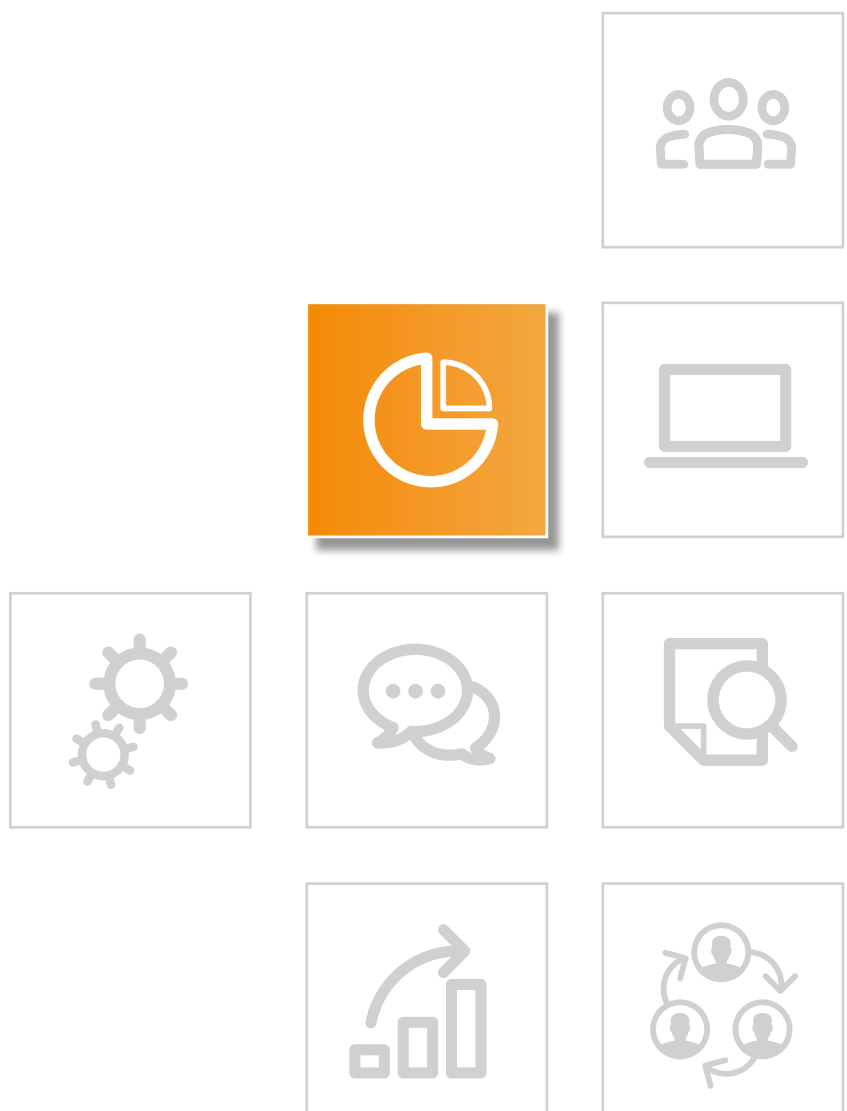


# PORTFOLIOMANAGEMENT, BILANZ- KREIS- & FAHRPLANMANAGEMENT

Erträge steigern, Risiken minimieren





## DAS MODUL „PORTFOLIOMANAGEMENT, BILANZKREIS- & FAHRPLANMANAGEMENT“ IN DER ÜBERSICHT

Intelligentes Portfoliomanagement gehört für Energieversorger zu den wesentlichen Erfolgsfaktoren. Der Energiebezug muss permanent mit dem Absatz abgestimmt werden. Gleichzeitig gilt es, das operative Risiko so gering wie möglich zu halten.

Mit dem rhenag-Modul „Portfoliomanagement, Bilanzkreis- & Fahrplanmanagement“ richten wir Ihr Portfolio zielgenau aus, immer mit Blick auf die zu erwartenden Entwicklungen des Marktes und des Bedarfs. Mit einer aktiven Portfoliostrategie sowie unseren leistungsfähigen Prognose-, Optimierungs- und Analysesystemen sorgen wir dafür, dass Sie für den immer aggressiveren Wettbewerb gerüstet sind.

### RISIKOMANAGEMENT

- Aufbau eines Risiko- und Beschaffungshandbuchs
  - Darstellung des Vertriebs- und Beschaffungsportfolios sowie Identifikation/Bewertung der Risiken
  - Abgleich mit der Strategie für Beschaffung/Vertrieb
  - Ableitung von Verfahrensanweisungen in den Bereichen Beschaffung/Vertrieb
  - Festlegung und Aufbau des Berichtswesens im Risikocontrolling
  - Definition von meldepflichtigen Risiken und Festlegung des jeweiligen Empfängerkreises
- Verifizierung von Vertragsrisiken
- Risikocontrolling
  - Marktrisikoprüfung: Preis-, Mengen- und Wirtschaftlichkeitsprüfung
  - Festlegung und Bewertung von offenen Positionen
  - Kreditklauseln in Verträgen
  - Kreditrisikoprüfung: Bonitätsprüfung, Exposure- und Expected-Loss-Analyse

#### Ihr rhenag-Praxis-Plus

- + Rund 50 Risikohandbücher (Strom und Gas) erfolgreich bei Kunden implementiert
- + Regelmäßige Erstellung von Risikoberichten für rhenag und Kunden
- + Unterstützung bei und Teilnahme an Kundengremiensitzungen (Aufsichtsrat, Risikokomitee)
- + Große Erfahrung und regelmäßiger Austausch durch Einbindung in ein großes Unternehmensnetzwerk



### PORTFOLIOMANAGEMENT

#### Beschaffungsstrategie

- Analyse des Absatz- und des Beschaffungsportfolios
- Segmentierung des Portfolios und Definition von Beschaffungsbüchern
- Ermittlung des Mengen-, Leistungs- und Flexibilitätsbedarfs
- Analyse der Absatzprodukte und Vertragslaufzeiten
- Identifikation von Beschaffungs- und Absatzrisiken
- Berücksichtigung der individuellen Risikobereitschaft
- Abstimmung der Beschaffungsstrategie segmentiert nach Absatzportfolio
- Festlegung einer Beschaffungsmatrix mit Beschaffungszeiträumen, Produkten und Mengengrenzen je Segment
- Durchführung von Workshops zur Anpassung der Strategie nach Maßgabe aktueller Marktentwicklungen

#### Beschaffungsplanung

- Analyse des Prognoselastgangs hinsichtlich Menge, Leistung und Flexibilitätsbedarf
- Zerlegung des Prognoselastgangs in Handelsprodukte
  - Standardhandelsprodukte
  - Spot (Day ahead, Intraday, Weekend)
  - Termin (Month, Quartal, Season, Year, Base, Peak, Off-Peak)
- Berücksichtigung aller gängigen und speziellen Beschaffungsprodukte
  - Individuelle Lieferabkommen auf bilateraler Ebene
  - ¼-Stunden-Fahrpläne
  - Temperaturregression
  - Flexvertrag
  - Tranchenverträge
  - Indexverträge
  - Oder eine Kombination daraus
- Erstellung eines Beschaffungsplans unter Berücksichtigung der Beschaffungsstrategie
- Stetige Abstimmung mit Ihnen

#### Marktinformationen

- Beobachtung des Marktes und Information über relevante Marktentwicklungen
- Aufzeigen von Marktchancen und -risiken
- Führen von Marktgesprächen und Austausch zu aktuellen Themen (Marktumfeld, Absatz-/Beschaffungsstrategie, Optimierung)
- Unterstützung bei Anfragen des Auftraggebers zu Marktentwicklungen und seinen Beschaffungsaktivitäten
- rhenag-Handelsforum mit verschiedenen Fachvorträgen sowie Austauschmöglichkeit der Beteiligten innerhalb des rhenag-Netzwerks
- Information zu Marktpreisen



### Durchführung von Beschaffungen (Ausschreibung Energieeinkauf)

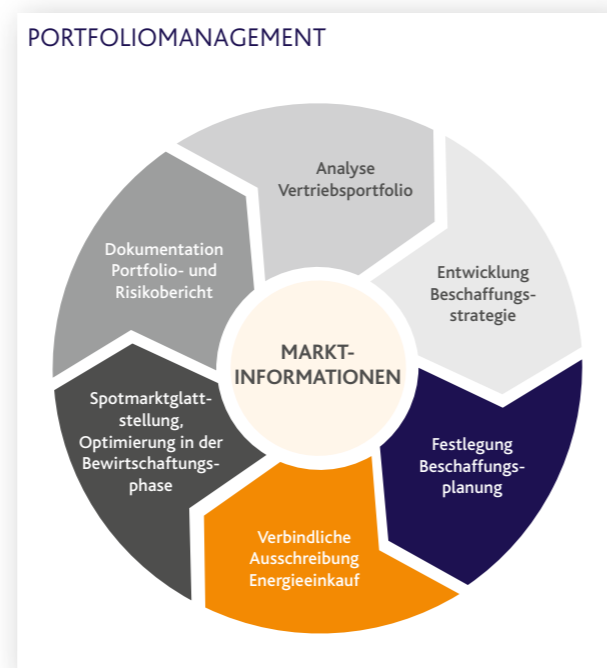
- Lieferantenunabhängige Gas- und Stromausschreibung mit Zielsetzung der Vergabe an den preisgünstigsten Anbieter
- Abstimmung der auszuschreibenden Produkte mit Ihnen
- Auswertung und Aufbereitung der Angebote und Ermittlung des günstigsten Angebots
- Prüfung der Beschaffungsverträge
- Konkrete Handlungsempfehlung an Sie oder Erteilung des Zuschlags für das beste Angebot durch rhenag
- Revisions sichere Dokumentation der eingeholten Angebote und abgeschlossenen Geschäfte

### Spotmarktglättstellung und Optimierung in der Bewirtschaftungsphase

- Tägliche Spotmarktglättstellung an den Gas- und Strommärkten
- Erstellung einer monatlichen Handlungsempfehlung für die tägliche Bewirtschaftung des Folgemonats mit allen Rahmenbedingungen zur betriebswirtschaftlichen Optimierung
- Abstimmung der Handlungsalternativen und Freigabe der Bewirtschaftung durch Sie

### Portfolio- und Risikobericht

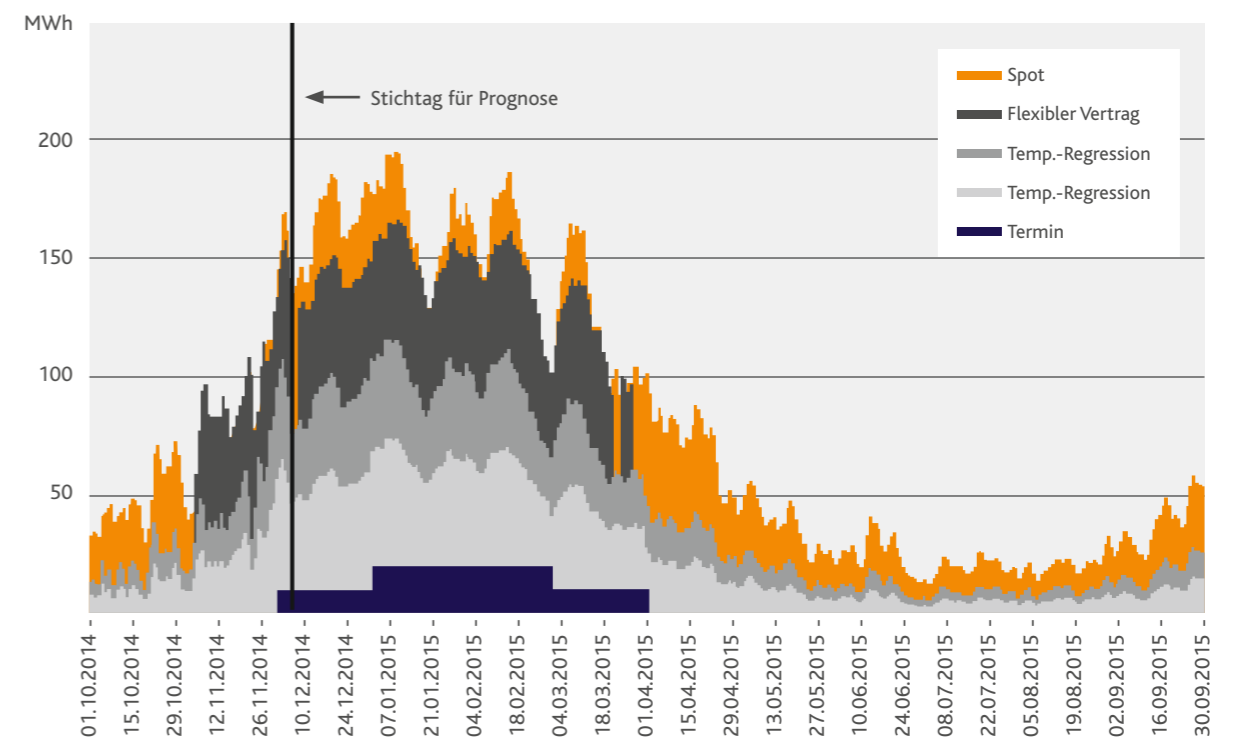
- Monatlicher Portfolio- und Risikomanagementbericht
- Überwachung des Portfoliowertes
  - Eindeckungsgrad je Portfolio
- Überwachung der Marktpreisrisiken anhand von Kennzahlen
  - Mark-to-Market (M2M)
  - Mark-to-Forecast (M2F)
  - Sensitivitätsanalyse
  - Value at Risk (VaR)
- Überwachung des Liquiditätsrisikos
- Berichterstattung gegenüber Risikokomitee, Aufsichtsgremien und Behörden



### Ihr rhenag-Praxis-Plus

- + Betreuung von 28 Beschaffungsportfolios in beiden Marktgebieten und beiden Gasqualitäten
- + Vielfältige Kooperationsmöglichkeiten mit den Partnern des rhenag-Netzwerkes
- + Durchführung von über 250 Ausschreibungen im Jahr
- + Langjährige Erfahrung als Portfoliomanagement-Dienstleister
- + Ausgezeichnete Kontakte im Markt

### OPTIMIERUNG DER VERTRAGSBEWIRTSCHAFTUNG



### ENERGIEDATENMANAGEMENT UND PROGNOSESYSTEME, PORTFOLIO- UND RISIKOMANAGEMENTSYSTEME

- Bereitstellen und Betreiben der Hardware im Rechenzentrum
- Fachliche Betreuung, Systemsupport, Software- und Schnittstellenwartung
- Software-Bereitstellung und -Betrieb
- Release-Wechsel
- Installation des Systems/Mandanten
- Optimierung und Pflege der Systeme
- Schulung der Mitarbeiter



## BILANZKREIS- UND FAHRPLANMANAGEMENT

### Aufbau

- Einrichtung des Energiedatenmanagement- und Prognosesystems
  - Aufbau der Energiemarktstruktur für Lieferant und Bilanzkreisverantwortlichen
- Konfiguration der Vertriebsstruktur nach Vorgabe des Portfoliomanagements, geclustert nach SLP-, TLP- und RLM-Kunden
  - Implementierung der historischen Lastgangdaten
- Erstellung von Kurz-, Mittel- und Langfristprognosen für die Kundensegmente SLP, TLP und RLM
  - Erstellung einer Best-of-Prognose mit den Prognoseverfahren (Lastgangfortschreibung, Vergleichstagesverfahren, Künstlich Neuronale Netze)
  - Ermittlung des Gesamtvertriebslastganges
- Aufbau und Pflege der Bilanzkreisverträge je Regelzone bzw. Marktgebiet und Handelspartner
- Vertragsverwaltung der Portfoliostruktur mit Ein- und Verkaufsverträgen
- Implementierung der Kommunikationswege zu Marktpartnern
  - Erstellung und Versand von Kommunikationsdatenblättern
- Abstimmung von Datenformaten und Zeitpunkten
- Umsetzung und Abwicklung der MaBiS-Prozesse
  - Erzeugung und Versand von Zuordnungsermächtigungen
  - Anforderung des Abonnements der Standardlastprofile Strom
  - Analyse und Prüfung der Lieferanten- und Bilanzkreissummenzeitreihen gegenüber den Prognosezeitreihen
  - Abwicklung der Clearing-Prozesse

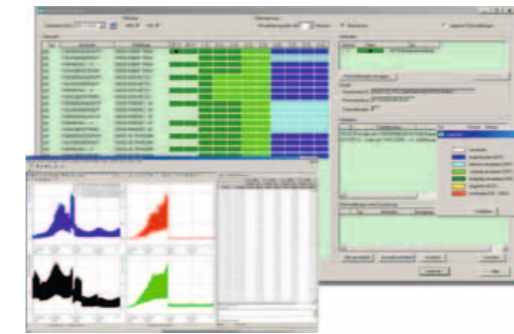
### BILANZKREISMANAGEMENT AUS LIEFERANTENSICHT



### Laufender Betrieb

- Bilanzkreisführung per täglicher Nominierung an Werktagen, Wochenenden und Feiertagen
  - Fristgerechter Versand der Nominierungen und Fahrpläne an Marktgebietsverantwortliche bzw. Bilanzkreiskoordinatoren und Handelspartner
  - Abwicklung und Dokumentation der Fahrplan- und Nominierungsprozesse mit Zeitreihenverwaltung
- 24/7-Bereitschaftsdienst
- Laufende Überwachung der Bezugs- und Absatzmengenverträge hinsichtlich der Restriktionen
- Ermittlung der Vertragsbeschäftigung
- Glattstellung am Spotmarkt
- Analyse und Kontrolle des Bilanzkreisstatus
  - Abgleich Allokation zu Prognose für SLP-, TLP- und RLM-Entnahmestellen
  - Zugriff auf alle relevanten Bilanzkreisdaten
- Prüfung der Deklarationslisten
- Allokations- und Deklarationsclearing

### FAHRPLANVERSAND



### Pooling Gas

- Viele Bilanzkreise von Gasversorgern werden in einem qualitätsübergreifenden Rechnungsbilanzkreis je Marktgebiet zusammengeführt
- Saldierung der Abweichungen zwischen Prognose und Allokation
- Verringerung der Ausgleichsenergie und damit Minimierung der Kosten
- Vermeidung von Kosten für Strukturierungsbeitrag
- Möglichkeiten der bewussten Konvertierung
- Synergien im großen Portfolio führen zur Verringerung der Beschaffungsrisiken

### Ihr rhenag-Praxis-Plus

- + Professionelle Abwicklung (24/7) aller Prozesse und Vorgaben (KoV IV, GaBi Gas, MaBiS etc.)
- + Bilanzkreismanagement Gas in 51 Kundenbilanzkreisen und 4 rhenag-Bilanzkreisen für ein Beschaffungsvolumen von 17,2 TWh p. a.
- + Bilanzkreismanagement Strom in 23 Kundenbilanzkreisen und 4 rhenag-Bilanzkreisen für ein Beschaffungsvolumen von 1,2 TWh p. a.
- + Zuverlässige Prognoseverfahren und -systeme
- + Leistungsstarkes Rechenzentrum mit hoher Verlässlichkeit (regelmäßig testiert)
- + Umsetzung durch ein TÜV-zertifiziertes Rundum-sorglos-Dienstleistungspaket

### EEG-DIREKTVERMARKTUNG

- Unterstützung bei der Umsetzung gesetzlicher Anforderungen nach aktuellem EEG
- Bereitstellung des Marktzugangs für EEG-Direktvermarktung und Regenergie
- Erstellung der Einspeiseprognose und Organisation des Bilanzkreismanagements
- Rechnungsstellung und finanzieller Ausgleich

### WEITERE LEISTUNGEN

- Qualifizierung und Schulung von Mitarbeitern
- Einstieg in die strukturierte Beschaffung: individuelles Schattenportfolio
  - Simulation des kompletten Portfoliomanagements
  - Ohne große Bindung von personellen oder technischen Kapazitäten die Einsparpotenziale erkennen

---

## Sprechen Sie uns an!

### **rhenag Rheinische Energie AG** **Dienstleistungsvertrieb**

Bayenthalgürtel 9  
50968 Köln

T 0221.93731-602  
F 0221.93731-600

[dienstleistung@rhenag.de](mailto:dienstleistung@rhenag.de)  
[www.rhenag.de](http://www.rhenag.de)