

广东电力市场风险防范指引

(第二次征求意见稿)

第一条 为建立健全电力市场运营风险管控机制，有效防范和及时处置市场风险，保障市场平稳运行，维护市场主体合法权益和社会公共利益，根据《广东电力市场监管实施办法（试行）》，制定本指引。

第二条 本指引适用于广东电力市场范围内、按照能源监管机构组织制定或审定的市场规则组织开展的电力市场交易活动的风险防范。

第三条 市场运营机构按照“谁运营、谁防范”的原则，落实电力市场整体风险防范的主体责任；负责建立并落实风险防范相关工作制度，编制市场风险防范预案，并按照有关程序处理市场风险。

市场主体、电网企业应当做好自身市场风险防范，严格遵守电力市场风险管理有关工作制度，配合市场运营机构编制市场风险防范预案并按照预案处置有关风险。

能源监管机构对电力市场风险防范落实情况实施监管。

第四条 电力市场成员应当高度重视电力市场风险防范工作，按照本指引要求定期梳理可能存在的风险源，有针对性地做好风险辨识、风险分析、风险预警、风险处置等工作，以便及时了解、掌握和化解各类电力市场风险。

第五条 本指引所称电力市场风险是指发生危害事件或不利影响的可能性，与随之引发的影响电力市场交易活动正

常开展，乃至危及电力批发市场正常运营的组合。

电力市场风险防范是指电力市场风险监测辨识、分析评价、预警处置并持续改进的动态过程。

第六条 电力市场风险包括但不限于：

（一）市场价格异常风险。由于燃料价格大幅变化、电力供应和需求大幅波动、输电能力发生重大改变等，导致电力批发市场价格持续偏高、偏低、频繁大幅波动等明显超出正常变化范围的风险。

（二）电力市场技术支持系统风险。由于支撑电力市场运营的各类技术支持系统（含调度运行技术支持系统、自动化系统、数据通信系统、计量自动化系统等）处于不可用状态，影响正常开展市场申报、市场出清、出清结果执行、计量统计等工作的风险。

（三）极端自然灾害和网络安全风险。由于台风、冰灾、山火、洪水、地震等恶劣极端自然灾害，或者电力监控系统信息安全受到严重攻击及侵害，影响电力系统安全稳定运行，从而间接或直接影响电力市场正常运营的风险。

（四）合同履约风险。市场主体签订的批发侧中长期合约、零售合同等大范围或大规模不能正常履行，影响市场电费结算正常开展的风险。

（五）市场运营机构认为需要防范的其他风险；

（六）政府有关部门、能源监管机构提出的需要加强防范的有关风险。

第七条 市场运营机构在开展电力市场风险防范时，应当

遵循以下工作要求：

（一）建立相应的市场风险防范机制。借鉴成熟市场好的风险防范做法，建立电力市场风险防范相关工作制度，从源头上规避可能发生的市场风险。

（二）事前编制市场风险防范预案。对于本指引**第六条**的每一类风险，有针对性编制相应的风险防范预案，明确具体的风险源、风险级别、防范措施、各方职责和处置程序等内容。根据实际，滚动修编市场风险防范预案，改进完善风险防范措施，提升风险防范能力。

市场处置环节采取的有效措施，可按程序增加到电力市场运营规则；条件成熟的，也可单独作为一项风险防范制度。

（三）做好市场风险动态监控。充分利用信息化手段和大数据技术，加强对电力市场各类交易活动和风险防范有关工作制度执行情况的监控，提高市场风险处置效率。

（四）明确市场风险防范工作程序。电力市场风险分为风险辨识、风险分析、风险预警、风险处置等主要工作环节。

电力市场风险防范要与电网安全风险管控、电力监控系统网络安全防护工作等有机衔接。

（五）加强有关信息披露和报告。市场运营机构按照有关预案进行市场风险处置后，定期披露风险处置情况。

对于电力市场运营规则中需要政府有关部门、能源监管机构进行决定采取市场中止的有关情形，市场运营机构应当做好风险预警并及时报告。

第八条 市场风险辨识是动态发现、筛选并记录各类市场

风险的过程。市场运营机构应当充分利用市场监控掌握的数据信息，找出电力市场所面临的和潜在的风险源。

第九条 市场风险分析是在风险辨识的基础上，对风险进行确认、归类、分级并判断风险特征和风险源头的过程。市场运营机构选择适用的定性、定量或定性定量相结合等方法，对风险发生的可能性和后果严重性进行估计和预测，根据市场风险可造成后果的不同严重程度对风险进行分级，为风险预警和处置提供支持。

市场风险等级从高到低划分为重大风险、较大风险、一般风险和低风险四个级别。

第十条 电力市场风险预警是依据风险分析确定风险等级，对可能发生的风险进行预警的过程。市场运营机构根据市场风险等级，对可能发生的市场风险进行预警，提醒市场主体事先采取必要的防范措施。

第十一条 电力市场风险处置是依据风险评价确定的风险等级，按照有关预案处置市场风险的过程。市场运营机构针对已经发生的市场风险，根据其风险特点和等级，按照事前制定的有关预案在事中环节采取相应的措施，及时应急处置，尽可能降低或消除风险造成的不利影响。

第十二条 能源监管机构对市场运营机构、市场主体和电网企业市场风险防范落实情况开展不定期抽查。