



Михаил Быканов

аналитик журнала «ЭнергоРынок»

Электроэнергетика без газа не останется

В течение последних двух лет вышел ряд нормативно-правовых актов, предопределивших вектор развития рынка газа России. Постановление Правительства РФ от 2 сентября 2006 г. № 534 запустило электронную торговую площадку (ЭТП) ООО «Межрегионгаз», а в протоколе заседания Правительства РФ от 30 ноября 2006 г. № 42 была закреплена программа внедрения долгосрочных договоров.

Помимо этого введены индикации равновыгодной цены на газ для внутреннего и внешнего рынков, а также установлены пошлины на продукцию опосредованных экспортеров газа (постановления Правительства РФ от 28 мая 2007 г. № 333 и от 11 марта 2008 г. № 159).

Эксперимент по развитию электронной торговли получил положительную оценку участников рынка, несмотря на то, что не все требования постановления № 534 были выполнены.

Наглядной иллюстрацией успешности этого начинания служат итоги работы ЭТП за период с декабря 2006 г. по декабрь 2007 г.: 7,16 млрд

куб. м газа было продано ОАО «Газпром» (4,35 млрд куб. м, или 61%) и одиннадцатью независимыми поставщиками (2,81 млрд куб. м, или 39%). Среди крупнейших продавцов, помимо Газпрома, — ОАО «НК Роснефть» (1,01 млрд куб. м), ОАО «ЛУК-ОЙЛ» (0,70 млрд куб. м) и ОАО «НОВАТЭК» (0,67 млрд куб. м).

Доля крупных покупателей на площадке составила 60%, региональных газовых компаний — 23%, трейдеров — 17% (всего за год в торгах принимали участие 54 потребителя).

Не менее впечатляющими оказались результаты I квартала 2008 г. По состоянию на 1 апреля на ЭТП реализовано 2 711, 5 млн куб. м газа.

Благодаря серьезной работе двух корпораций — ОАО «Газпром» и реорганизованного ныне РАО «ЕЭС России» — была внедрена в практику весьма сложная программа долгосрочных договоров поставки газа для предприятий электроэнергетики. Договоры, исполнителями которых выступают региональные компании по реализации газа и независимые производители, а покупателями — ОГК и ТГК, предусматривают следующие объемы поставок: в 2008 г. — 166,9 млрд куб. м, в 2009 г. — 174,8 млрд куб. м и в 2010 г. — 186 млрд куб. м (при этом ежегодно 105 млрд куб. м газа будет реализовано по регулируемым ценам). Цены за указанный период вырастут с 70,7 до 119,9 долл./тыс. куб. м.

В то же время произошли серьезные изменения в отношениях поставщиков и покупателей. Теперь по желанию потребителя допускается разбивка годовых объемов по месяцам и отбор газа без штрафных санкций в течение суток месяца в диапазоне

1 По материалам, предоставленным пресс-службой ООО «Межрегионгаз».

80—110% от среднесуточной нормы данного месяца.

Но и вторая сторона — поставщик — не осталась в накладе. Устойчивая работа ЭТП вкупе с умеренным ростом цен в 2007 г. подтолкнула Правительство РФ предоставить Газпрому право продажи сверхдоговорных объемов по предельным ценам, сориентированным на цены электронной торговой площадки. Впервые понятие «предельные цены» появилось в постановлении Правительства РФ № 1021 еще в декабре 2000 г., но потребовалось семь лет, чтобы оно стало реальностью. Поставка газа по предельным ценам сверх договора происходит за счет резервов Газпрома и дополнительных объемов добычи и составляет ориентировочно 12 млрд куб. м в год. Предельные и регулируемые цены на ближайшие три года приведены в таблице 1.

Совокупность упомянутых в начале статьи нововведений оказала противоречивое влияние на характер работы российского рынка газа в I квартале 2008 г.

Ресурсы, предназначенные для спотовых поставок, по требованию покупателей были введены в программу долгосрочных и годовых договоров. Сумма объемов по указанным договорам на текущий год значительно превосходит потребление газа в 2007 г. Для удовлетворения возрастающих запросов потребителей Газпрому пришлось скупить резервы у ОАО «СИБУР Холдинг» и других независимых производителей, включив их в договорные объемы. Сформировалась достаточно жесткая конструкция рынка, некоторую гибкость которой должна была обеспечить ЭТП за счет выделенных 7,5 млрд куб. м газа. Но в результате несанкционированного отбора потребителями (в том числе населением) 2 млрд куб. м, принадлежащих Газпрому, в январе 2008 г. ЭТП лишилась квартальных плановых объемов. Во избежание разгрузки транспортной системы торговая площадка по требованию центрального производственно-диспетчерского департамента Газпрома остановила торговлю на декад-

ных сессиях февраля и марта. В этот же период ОАО «НОВАТЭК» не смогло выполнить свои обязательства по продаже газа на ЭТП, желая закрепить позиции по прямым договорам с ведущими потребителями. На рынке Свердловской области для упрочения своего монопольного положения НГК «ИТЕРА» трансформировалась из продавца в покупателя. В итоге возникший дефицит газа на торгах привел к скачкообразному росту цен в феврале и марте, отпугнул от торговой площадки дисциплинированных потребителей, традиционно закупавших дополнительные объемы на ЭТП, и вынудил их пойти на несанкционированный отбор.

Таким образом, в I квартале 2008 г. вместо планируемых 3,3 млрд куб. м ЭТП реализовала лишь 2,4 млрд куб. м газа. И хотя это в 1,4 раза больше уровня I квартала прошлого года, результат был признан неудовлетворительным (рис. 1). В феврале-марте площадка не выполнила функции оперативного обеспечения газом и индикации рыночной цены, но установила диагноз «гриппозного состояния» рынка.

Проведение столь масштабных преобразований в важнейшем секторе отрасли должно было сопровождаться соответствующими изменениями и дополнениями законодательства. В частности, это предусматривал п. 2 протокола № 42 заседания Правительства РФ от 30 ноября 2006 г.: «С целью реализации указанных предложений Минэкономразвития России (Г.О. Грефу) с участием заинтересованных федеральных органов исполнительной власти и организаций до 15 февраля 2007 г. разработать и представить в Правительство Российской Федерации проекты нормативных правовых актов, в том числе о заключении долгосрочных договоров поставки и транспортировки газа для всех категорий потребителей».

Поручение не выполнено до сих пор. Долгосрочные договоры заключаются на новых условиях, правила поставки газа остаются в прежней редакции, и в результате каждая сторона

Табл. 1. Условия поставки газа в 2008—2010 гг.

Цены, долл./куб. м	2008 г.		2009 г.		2010 г.	
	на 1 января	на 1 января	на 1 июля	на 1 января	на 1 июля	
Регулируемые	70,7	83,1	93,9	106,1	119,9	
Предельные	106	116,3	122	127,3	131,9	



в тандеме «поставщик — покупатель» извлекает из двух документов (долгосрочного договора и правил поставки) наиболее выгодные для себя параметры. К примеру, коэффициент штрафных санкций за перебор газа в долгосрочных договорах установлен в размере 3,0; в правилах — 1,5. В конечном итоге немалая часть потребителей вообще ушла от оплаты.

Управление системой газоснабжения в I квартале 2008 г. значительно осложнилось. Критических ситуаций удалось избежать благодаря умеренным погодным условиям. До 6—8% объемов планового баланса газа ежемесячно распределялось с нарушением договоров (табл. 2).

Переизбыток ресурсов, предоставленных рынку по долгосрочным и годовым договорам в ущерб формированию оптимального по размерам спотового рынка, начал подтверждаться в феврале-марте текущего года. За два указанных месяца невыборка промышленными предприятиями составила 2,2 млрд куб. м газа, а суммарно с объемами, не проданными на ЭТП, эта цифра достигла 3,1 млрд куб. м.

Табл. 2. Данные о характере потребления газа ведущими промышленными предприятиями в I квартале 2008 г., млрд куб. м

Месяц	Объем поставки газа	Объем газа, отобранный сверх договоров	Объем газа, не выбранный против договоров	Сальдо отклонения (3 + 4)	Отклонение относительно договоров	
					(3 + 4)	%
Январь	35	1,5	-0,6	0,9	2,1	6,2
Февраль	31,7	0,7	-1,3	-0,6	2	6,2
Март	30,8	0,5	-2,1	-1,6	2,6	8
ИТОГО:	97,5	2,7	-4,0	-1,3	6,7	6,96

Табл. 3. Структура поставок газа

Вариант А:					
Годовые объемы потребления	=	поставки по долгосрочным договорам	+	поставки по годовым договорам	+ поставки по договорам «спот» (месяц, неделя, сутки)
100%		70%		20%	10%
Вариант В:					
годовые объемы потребления	=	поставки по долгосрочным договорам	-	перепродажа излишков газа	
100%		107%		7%	

Табл. 4. ЭТП и биржа газа: основные характеристики

ЭТП	Биржа
Основная задача:	
Торговля физическими объемами газа	Торговля фьючерсными контрактами с поставкой (по желанию участников) физических объемов газа (1–2% от денежного оборота) по наступлению срока действия контракта
Сроки исполнения контрактов:	
На следующий день	Нет
В следующую декаду	Нет
На следующий месяц	На следующий месяц
Нет	На последующие 2–72 мес.
Основные итоги деятельности:	
Регистрирует цены спотового рынка на текущий месяц	Дает прогноз цены на период до 72 мес.
	Дает объективные индикаторы цены для взаиморасчетов на последующий месяц по долгосрочным договорам.
	Создает реальные условия для страхования (хеджирования) продавцов и покупателей от ущерба, связанного с резкими изменениями цен на спотовом рынке

Выявив «болезнь» рынка, площадка сама получила «обширную пневмонию». Произошло это в преддверии запуска новой формы торгов — с поставкой на следующие су-

тки. Модернизированная техническая система для нее готова, и для синхронизации рынков газа и электроэнергетики осталось стабилизировать работу ЭТП.

В первую очередь, считают специалисты, необходимо восстановить дисциплину газопотребления, а также завершить согласование постановления Правительства РФ по долгосрочным договорам. Существует ряд проблем, требующих скорейшего решения. В частности, пока не приняты повышающие коэффициенты, уже согласованные потребителями. По этим же коэффициентам несет ответственность и поставщик за недопоставку договорных объемов. Аппарат РАО «ЕЭС России» до последнего времени настаивал на возможности перепродажи газа, приобретенного по цене 70 долл./тыс. куб. м на регулируемом рынке. По его мнению, эти ресурсы должны были получить доступ на свободный рынок, где цена равна 120 долл./тыс. куб. м.

Газпром восстановил декадные торги на ЭТП в плановых объемах. Сегодня в компании полагают необходимым призвать к выполнению принятых обязательств НГК «ИТЕРА» и НОВАТЭК, создать условия для возвращения на ЭТП газа «СИБУР Холдинга».

Нужно осознать роль спотового рынка — торговой площадки с продажей газа на сутки вперед, неделю, декаду, месяц.

Существуют две схемы поставок газа, приведенные в таблице 3. По мнению специалистов, оптимальной является структура поставок по варианту А.

При этом спотовый рынок — не только электронная торговая площадка. В Газпроме считают, что пришло время наладить прямые связи «независимый производитель — потребитель», «Газпром — потребитель» и реализовать их, используя возможности ИТ, в том числе автоматизированный учет поставки ресурсов.

В компании осознают насущность создания в России биржи по торговле товарными фьючерсами на газ. Технология торгов ЭТП ООО «Межрегионгаз» изначально формировалась для ее последующего применения на бирже газа.

Этот план зафиксирован в приказе правления ОАО «Газпром» от 27 июня

2005 г. № 103 «О формировании рабочей группы по разработке рыночных механизмов торговли газом». Некоторые специалисты высказывали мнение, что с пуском биржи газа упадет целесообразность в сохранении и развитии ЭТП. Но у обеих структур, при сходстве некоторых функций и параметров, есть существенные отличия (табл. 4). Электронная торговая площадка специализируется на физических поставках газа в пределах ближайшего месяца и индикации цен на краткосрочный период. Биржа — определяет цену поставочных сделок на ближайший месяц и занимается фьючерсными контрактами на следующие 72 месяца.

Современные рынки газа через биржи обеспечивают очень тесную связь сегмента поставок по долгосрочным договорам и сегмента спотовых поставок. В долгосрочных договорах нового поколения вместо формулы цены, связанной с ценой нефти, вводится положение о том, что цена в отчетном месяце определяется по ценам торгов на бирже с поставкой газа на данный месяц.

Это означает, что система долгосрочных договоров на продажу газа по свободным ценам может эффективно функционировать только при достаточно масштабном, хорошо работающем спотовом рынке и объективной регистрации спотовой цены. Итоги торгов на ЭТП в I квартале 2008 г. показали актуальность этой задачи для рынка газа России.

Исходя из того, что две структуры (ЭТП и биржа) более полно, комплексно удовлетворяют потребности газового рынка, Газпром принял концепцию параллельного развития обоих направлений. При этом компания планирует использовать как опыт работы ЭТП, так и результаты деятельности дочерних структур на рынке ЕС.

Организаторами биржи, которая будет, по всей видимости, располагаться в Санкт-Петербурге, помимо самого газового холдинга выступают АБ «Газпромбанк» и НП «МБНК». Начало торговли товарными фьючерсами по

газу запланировано на I квартал 2009 г., но разработчики программы осознают, что для придания биржевым торгам ликвидности (т. е. для создания ситуации, когда их результатам будут верить участники рынка) потребуется определенное время, течение которого необходимо преобразовать сам рынок.

Биржа, как и ЭТП, должна играть одну из ведущих ролей в формировании и реализации задач по совершенствованию рынка газа для целей ликвидности биржевой торговли и выполнять следующие задачи:

- оптимизация размера штрафных коэффициентов;
- создание системы двухставочных тарифов по транспортировке газа с обязательной платой за заявляемую мощность;
- ликвидация практики хранения газа независимых производителей «в трубе»;
- создание системы балансировки объемов газа в ГТС;
- снижение уровня региональной монополизации поставок газа в свободном секторе;
- создание комплексной системы индикации цен, в том числе в сегменте прямых договоров свободного сектора;
- оптимизация соотношений объемов газа для спотовых поставок, годовых, долгосрочных договоров;
- оптимизация объемов поставки газа населению;
- принятие на правительственном уровне графика расширения свободного сектора рынка газа.

Биржа газа позволит осуществлять рыночный прогноз цен на газ на 72 месяца вперед, будет способствовать переходу от монополярной ориентации стоимости акций ОАО «Газпром» (с установкой на конъюнктуру мирового фондового рынка) к биполярной, учитывающей рост цен на газ на внутреннем рынке. Также очевидно положительное влияние биржевых торгов на капитализацию Газпрома и повышение стимулов к экономии газа и энергоресурсов у российских потребителей.

