

# Muster Beschaffungsstrategie

Gliederung

**diem**

Diem Consulting GmbH

Hinweis:

Die Gestaltung einer Beschaffungsstrategie hängt von der Größe des Unternehmens, der Erfahrung der beteiligten Mitarbeiter im Energiehandel wie auch von der im Unternehmen vorhandenen Infrastruktur für Energiehandel und Risikomanagement ab. Ziel einer dokumentierten Beschaffungsstrategie ist die Steuerung von Marktrisiken und die verbindliche Dokumentation von Mitarbeiterverantwortung und Mitarbeiterspielräumen. Möglich ist somit eine Steuerung der Risiken über Risikokennzahlen ohne konkrete Geschäfte an den Handelsmärkten vorzugeben wie auch eine relativ enge Vorgabe der zu tätigenen Geschäfte, wobei nur einfache Risikomaße wie z.B. offene Mengen verwendet werden.

Das vorliegende Dokument enthält eine beispielhafte Gliederung, die teilweise mit **Erklärungen** (rot) teilweise mit **Mustertexten** (schwarz) untersetzt ist. Auch die Mustertexte müssen an die Gegebenheiten des eigenen Unternehmens angepasst werden.

Die im Dokument angeführten Links auf andere Dokumente demonstrieren nur die Textstruktur. Die verlinkten Dokumente existieren nicht bzw. sind nicht Teil dieser Mustervorlage.

## 1 Einleitung

Gegenstand der Einleitung ist die Beschreibung von Umfang und Art der Aktivitäten des Unternehmens an den Handelsmärkten. Es wird beschrieben, für welche Zwecke / Grundgeschäfte Beschaffungsaktivitäten durchgeführt werden und für welchen Teil davon die vorliegende Beschaffungsstrategie gilt (Geltungsbereich). Beispieltext:



Der Versorger **MusterEnergie** versorgt die Gemeinden Adlershöh, Liebenau und Ulmenhain mit Strom, Gas und Fernwärme. Der abgesetzte Strom wird vollständig an den Handelsmärkten beschafft, wobei Angebote für Kunden über 10 GWh über eine back-to-back-Beschaffung bedient werden, während die Mengen für alle anderen Kunden über die vorliegende Strategie beschafft werden.

Ist der Gegenstand der Beschaffungsstrategie die Absicherung eines komplexeren Grundgeschäftes am Markt, z.B. die Beschaffung für einen indizierten flexiblen Liefervertrag, so sollte dieses Grundgeschäft in einem separaten Kapitel mit seinen Risikomeerkmalen beschrieben werden.

## **Inhaltsverzeichnis**

|          |   |          |
|----------|---|----------|
| <b>1</b> | <b>Einleitung</b>                               | <b>1</b> |
| <b>2</b> | <b>Grundgeschäft</b>                            | <b>4</b> |
| <b>3</b> | <b>Absatzerwartung</b>                          | <b>4</b> |
| <b>4</b> | <b>Marktplätze, Produkte und Handelspartner</b> | <b>5</b> |
| <b>5</b> | <b>Vorgaben und Limits für die Beschaffung</b>  | <b>5</b> |
| <b>6</b> | <b>Benchmarkstrategie</b>                       | <b>6</b> |
| <b>7</b> | <b>Verantwortung und Handelsspielräume</b>      | <b>6</b> |



## 2 Grundgeschäft

Optional: bei einfachen Portfolien reicht die Bestimmung der Absatzerwartung (siehe Folgekapitel) aus.

## 3 Absatzerwartung

Hier wird der Prozess und die Datenbasis für die Ermittlung einer realistischen Absatzerwartung beschrieben. Wesentliche Annahmen, wie z.B. der prognostizierte Kundenverlust oder -zugewinn werden dokumentiert. Der als Ergebnis des Prozesses und der Annahmen ermittelte Fahrplan für die nächsten Lieferjahre kann ebenfalls an dieser Stelle dokumentiert werden. Beispiel:

**MusterEnergie** erwartet in den Jahren 20XX - 20YY in dem Segment der Kunden unter 10 GWh einen Absatz von ca. 100 GWh. Diese Annahme basiert auf dem Istabsatz der Lieferjahre 20AA-20BB, der um back-to-back-beschaffte Kunden bereinigt wurde, weiterhin wurde eine Absatzminderung durch Kundenverlust von 1% per annum unterstellt. Der entsprechend bereinigte und proportional um den prognostizierten Kundenverlust angepasste Lastgang wurde mit dem EDM-System XYZ typtagsgerecht in die Lieferjahre 20XX-20YY geschrieben. Das Ergebnis findet sich hier:

/ ... / ... /Absatzprognose20XX-20YY.xls

Eine Aktualisierung der Absatzprognose unter Berücksichtigung eines neuen Lieferjahres erfolgt jährlich im Oktober durch die für die Absatzplanung zuständige Abteilung YXZ.

## 4 Marktplätze, Produkte und Handelspartner

Dokumentation freigegebener, zur Verfügung stehender Marktplätze, Produkte und Handelspartner ggf. (wenn nicht anderweitig dokumentiert) mit gültigen Limitierungen wie z.B. Sicherheitenhöhe für das Börsenclearing und Kreditlinien

## 5 Vorgaben und Limits für die Beschaffung

Dies ist der Kern der Beschaffungsstrategie. Hier werden entweder konkrete Vorgaben an die Beschaffung dokumentiert wie z.B.

Der Portfoliomanager hat die folgenden Geschäfte zu tätigen:

- Kauf 1 MW Base 2017 bis zum 15.03.2016
- Kauf 1 MW Peak 2017 zwischen 15.03.2016 und 15.04.2016
- ...

oder allgemeine Rahmenbedingungen für die Marktrisikobegrenzung aufgestellt, wie z.B.

- die absolute offene Menge des Portfolios darf für das kommende Lieferjahr 10 GWh nicht überschreiten
- der Value-at-Risk des Portfolios darf 5 Mio nicht überschreiten
- ...

Dabei werden für naheliegendere Zeiträume restriktivere Rahmenbedingungen gesetzt als für weiter in der Zukunft liegende. Im Allgemeinen werden dem zuständigen Portfoliomanager Spielräume für das marktoptimale Agieren gelassen. Die Performance des Portfoliomanagers kann gegen eine automatisierte Benchmarkstrategie gemessen werden. Diese wäre dann in einem separaten Kapitel darzustellen. Verfahren zur Risikomessung werden im allgemeinen separat in Whitepapers oder einem Methodenhandbuch dokumentiert, auf das hier ver-



wiesen werden kann.

## **6 Benchmarkstrategie**

optional

## **7 Verantwortung und Handelsspielräume**

Hier wird dokumentiert, wer für die Durchführung der Beschaffungsstrategie und wer für die Erarbeitung und Freigabe der Beschaffungsstrategie verantwortlich ist. Letzteres ist im Allgemeinen die Geschäftsführung. Im Sinne einer Unterschriftenordnung sind Volumengrenzen für Einzelgeschäfte, möglicherweise hierarchieabhängig sinnvoll. Weiterhin sollten gewisse Meldepflichten z.B. bei größeren oder anhaltenden Verlusten, starken Marktbewegungen, operativen Fehlern usw. vereinbart werden.