

广西电力交易中心有限责任公司文件

桂电交易〔2023〕137号

关于印发《广西电力市场履约风险管理工作指引》的通知

各相关市场成员：

为规范广西电力市场履约风险管理，根据国家发展改革委国家能源局《售电公司管理办法》（发改体改规〔2021〕1595号）和南方区域电力市场履约保障凭证管理、履约风险管理实施细则等有关规定，我中心组织编制了《广西电力市场履约风险管理工作指引》。在广泛征求市场主体意见的基础上，报请广西电力市场管理委员会审议通过后，经政府主管部门同意，现予以印发，请遵照执行。

本工作指引从2024年度交易起实施，原《广西电力市场售电公司履约保障凭证管理实施细则》（桂电交易〔2022〕

61号)同时废止。

特此通知。

附件：广西电力市场履约风险管理工作指引



广西电力交易中心有限责任公司

2023年11月7日

(联系人及电话：祁宏鹏，0771-2550505)

附件：

广西电力市场履约风险管理工作指引

1 总则

1.1 为规范广西电力市场履约风险管理，根据国家发展改革委 国家能源局《售电公司管理办法》（发改体改规〔2021〕1595号）和南方区域电力市场履约保障凭证管理、履约风险管理实施细则等有关规定，结合广西电力市场建设实际，制定本工作指引。

1.2 本指引所称履约风险管理是指广西电力交易中心有限责任公司（以下简称“广西电力交易中心”）组织建立电力市场履约风险管理机制，对履约保函（保险）的开立、接收、执行、退还的全生命周期管理。现阶段，履约保障凭证提交主体为售电公司，市场条件成熟后逐步将其他市场主体纳入管理范围。

1.3 本指引适用于广西电力市场中长期及现货交易条件下电力交易机构对售电公司的履约风险管理工作。

2 职责分工

2.1 广西电力交易中心职责

2.1.1 负责拟定、修订广西电力市场履约保障凭证管理要求。

2.1.2 按照“谁运营、谁监控，谁运营、谁防范”的原则，对广西区内售电公司开展履约保障凭证的接收、保管、

退还、使用申请、执行情况记录、履约风险跟踪和通报等工作。

2.1.3 负责建立广西电力市场售电公司履约风险跟踪预警机制，开展履约风险的评估、预警和控制工作，并将有关预警信息向政府主管部门、相关市场主体披露。

2.1.4 负责配合电网企业开展履约保障凭证的执行工作，向相关市场主体发出执行告知书，并于履约保函、保险执行前向市场主体公示售电公司欠费情况。

2.2 售电公司职责

2.2.1 按照本指引及时、足额开立符合要求的履约保函、保险单，在规定时间内提交至广西电力交易中心。

2.2.2 按照本指引规定做好履约保障凭证的执行工作。

2.2.3 配合广西电力交易中心开展履约情况监督工作。

2.3 广西电网有限责任公司(以下简称“广西电网公司”)职责

2.3.1 对售电公司提交的履约保障凭证进行真实性、有效性查验。

2.3.2 按时与售电公司开展电费结算并进行欠费追偿。

2.3.3 对未及时足额缴纳相关电力市场交易费用的售电公司发起履约担保索赔流程。

3 履约风险评估模型

3.1 广西电力市场履约风险评估的主要依据包括风险额度、信用额度以及信用额度占用率。其中：

(1) 风险额度是售电公司在电费结算、交易服务费缴

纳等过程中，不履行市场义务，对其他市场成员造成或可能造成的经济损失的总和。

(2) 信用额度是售电公司在电费结算、交易服务费缴纳等过程中，不履行市场义务，给其他市场成员造成经济损失时，用于支付其应付费用的金额。

(3) 信用额度占用率是售电公司风险额度占其信用额度的比率。参与交易时，售电公司应确保其信用额度占用率不得超过 100%。

3.2 售电公司参与跨省电力交易所形成的履约风险，共用其广西电力市场的风险额度、信用额度。

4 信用额度

4.1 广西电力交易中心动态计算、监测售电公司的信用额度情况。

4.2 售电公司应按信用额度管理要求向广西电力交易中心缴纳一定额度的履约保障凭证，其最低信用额度不得少于与其签约的电力用户过去 12 个月总用电量 $\times 0.8$ 分/千瓦时。

4.3 信用额度的计算主要包括信用担保额度和凭证担保额度，信用额度=信用担保额度+凭证担保额度，其中：

(1) 信用担保额度=最低信用额度 \times 信用等级系数，根据售电公司的最低信用额度、信用等级系数确定。

(2) 凭证担保额度是售电公司缴纳履约保障凭证的有效额度。

(3) 售电公司信用评价等级系数，根据广西电力市场主体信用评价发布后的结果确定。新准入注册及近一次信用

评价等级为 A 等级及以上的售电公司，信用评价等级系数均为 0；对近四次信用等级评定为 AAA 等级的售电公司，其信用评价等级系数为 0.2；对近三次信用等级评定为 AAA 等级的售电公司，其信用评价等级系数为 0.15；对近两次信用等级评定为 AAA 等级的售电公司，其信用评价等级系数为 0.1；对近四次信用等级评定为 AA 等级及以上的售电公司，其信用评价等级系数为 0.1；对近三次信用等级评定为 AA 等级及以上的售电公司，其信用评价等级系数为 0.08；对近两次信用等级评定为 AA 等级及以上的售电公司，其信用评价等级系数为 0.05；对近一次信用等级评定为 B 等级的售电公司，其信用评价等级系数为-0.3；对近一次信用等级评定为 C 等级的售电公司，其信用评价等级系数为-0.5。售电公司近 12 个月发生过未及时足额支付费用的，其信用等级系数为 0。

4.4 售电公司参与交易标的年的零售交易时，其可签约零售电量规模=信用额度÷0.8 分/千瓦时。

4.5 售电公司参与交易标的年的批发交易时，其信用额度对应的可交易规模=信用额度÷0.8 分/千瓦时-标的年累计成交电量+标的年已履约电量。

5 风险额度

5.1 广西电力交易中心每日评估计算、监测售电公司的风险额度情况。

5.2 风险额度的评估计算内容包括售电公司的结算风险费用和其他风险费用，其中：

(1) 结算风险费用应考虑根据结算依据确定的电费应

付已付情况、根据交易结果计算的预期应付电费情况以及根据用电预测估算的预期应付电费情况。

(2) 现阶段，其他风险费用主要是交易服务费的应付未付情况。

5.3 风险额度评估计算过程中，评估日为当月 15 日以前的，评估的时间范围包括往月和当月。评估日为当月 15 日及以后的，评估的范围包括往月、当月和次月。其中：

(1) 往月结算风险费用根据出具的结算依据进行评估计算；未出具结算依据的，可根据中长期交易的日分解计划或现货交易的日清分结果等情况进行评估计算。

(2) 当月结算风险费用应根据零售交易结果和中长期交易结果的日分解情况或现货交易结果的日清分情况等进行评估计算。已清分的运行日按实际情况取值，未清分的运行日按计划或预测情况取值。

(3) 次月结算风险费用根据用电预测情况和历史度电盈亏情况进行评估计算。

6 风险预警

6.1 广西电力交易中心每日动态计算、监测售电公司信用额度占用率情况，作为履约风险管理的主要参考依据。

6.2 根据信用额度占用率不同，售电公司的履约风险状态分为以下等级：

- (1) 信用额度占用率 $<60\%$ ，履约风险状态为绿色。
- (2) 信用额度占用率 $\geq 60\%$ ，履约风险状态为黄色。
- (3) 信用额度占用率 $\geq 80\%$ ，履约风险状态为橙色。

(4) 信用额度占用率 $\geq 100\%$ ，履约风险状态为红色。

6.3 广西电力交易中心应按售电公司风险状态发出风险预警，风险预警信息作为公开信息进行披露。

7 风险控制

7.1 售电公司应在收到风险预警后，按以下要求开展风险响应：

(1) 收到黄色预警时，应做好补充履约担保凭证、支付电费的准备。

(2) 收到橙色预警时，应及时补充履约担保凭证、支付电费，避免信用额度占用率进一步升高。

(3) 收到红色预警时，应在 10 个工作日内补充履约担保凭证，将信用额度占用率恢复至 100%以下。

7.2 广西电力交易中心对售电公司发出风险预警时，应同步开展风险预控：

(1) 发出红色预警的，应同时暂停其在交易系统建立零售关系、参与后续市场交易的资格。

(2) 发出红色预警后第 10 个工作日，其信用额度占用率仍超过 100%的，电力交易中心书面通知售电公司补缴履约保障凭证。

7.3 售电公司应在接到交易中心书面通知的 3 个工作日，向交易中心提交足额履约保障凭证，满足后续市场交易的信用要求。逾期未足额缴且信用额度占用率仍超过 100%的，经政府主管部门和能源监管机构同意，对其进行风险处置：

(1) 将其纳入交易失信行为管理。

(2) 取消其后续交易资格，强制其退出市场。

(3) 在电力交易平台、“信用中国”等渠道公布其有关信息和行为。

(4) 按照国家有关规定，报有权部门同意后对其法定代表人、自然人股东和其他相关人员依法依规实施失信惩戒。

(5) 其待履行的批发、零售合同按所在省区保底售电有关规定处理。

8 履约保障凭证管理要求

8.1 履约保障凭证包括履约保函和履约保险。

8.2 售电公司须在参与批发、零售市场交易前，向广西电力交易中心提交足额的履约保障凭证。

8.3 售电公司可以提交多份履约保障凭证。售电公司有效期内每日的有效额度为其提交的所有履约保障凭证有效期内该日额度的总和。

8.4 履约保障凭证有效期应与考虑电费退补的市场结算周期匹配。考虑市场化电费差错退补有滞后性，其生效日期不晚于交易标的组织开始日期或已提交履约保函（保险）终止日期的次日，终止日期不早于交易标的月份次月起6个自然月最后一天。

8.5 履约保障凭证担保事项包括但不限于：未足额支付省间及省内交易服务费；未足额支付省间及省内批零价差亏损以及由此造成的违约金；因无法继续履行电力交易合同对其他市场成员造成的其他经济损失。

8.6 售电公司对所提交履约保障凭证的真实性、合法性

和有效性负责。售电公司存在伪造、变造履约保障凭证，履约保障凭证到期前未经受益人同意而撤销等行为的，将被暂停交易权限，受益人保留通过法律手段追偿损失的权利。

8.7 鉴于广西电网有限责任公司为资金结算方并兜底提供保底售电服务，统一由广西电网有限责任公司作为受益人/被保险人，代表受损失的市场成员执行履约保障凭证，并按照经公示的偿付方案完成后续资金划拨。

9 履约保障凭证开立

9.1 履约保函须为不可撤销、见索即付、独立性保函。商业银行须严格按照本指引规定的履约保函范本（见附录 3）开立，不得修改。

9.2 履约保函被保证人为售电公司。

9.3 履约保函保证人为经国家有权部门批准设立、颁发金融许可证且具有相应业务资格的国有商业银行或全国性股份制商业银行（须支持在广西区内分支机构核验和兑付）。

9.4 履约保函受益人应与被保证人签署资金结算协议。

9.5 履约保险投保人为售电公司。

9.6 履约保险保险人为经国家有权部门批准设立、颁发保险业务许可证且有相应业务资质的保险公司，并在保险行业监管机构完成产品注册，获准销售范围须包含广西壮族自治区。

9.7 履约保险被保险人应与投保人签署资金结算协议。

9.8 履约保单原则上按模板开立（见附录 4）。履约保险合同中应包含但不限于相关规范性条款内容（见附录 5），保

险条款与保单内容须事先与被保险人达成一致。

9.9 为优化电力营商环境，推动履约保障凭证便捷化管理，各银行、保险公司若与电力交易机构建立电子信息交互通道，须与广西电力交易中心签署广西电力市场履约保障凭证业务合作协议（见附录6）。

9.10 广西电力交易中心将组织售电公司对银行、保险公司的服务质量开展评价，服务质量评价结果向市场主体发布。

10 履约保障凭证接收

10.1 售电公司通过银行、保险公司开立履约保函（保险）后，须及时告知广西电力交易中心，并按照其认可的方式提交履约保障凭证有关材料：

（1）与电力交易机构建立电子信息交互通道的银行、保险公司，可开具符合本工作指引规定的电子履约保函（保险），并在电子履约保函（保险）上加盖电子签章。电子履约保函（保险）开立后，由开立机构通过电子信息通道发送至对应省级电力交易机构，电力交易机构根据接收到的信息，完成履约保函（保险）自动审核。

（2）对于尚未与电力交易机构建立电子信息交互通道的银行、保险公司，电力交易中心在收到纸质履约保函（保险）后，向市场主体出具接收证明（附录7），并在3个工作日内完成审核。

10.2 电网企业收到履约保函后，须在3个工作日内通过以下任一方式进行履约保障凭证信息核验：

（1）履约保函开立银行具备纸质履约保障凭证信息线

上验证平台的，通过该平台核验纸质履约保障凭证信息；

(2) 履约保函开立银行，通过中国人民银行大额支付系统将履约保函相关要素信息发送给电网公司合作银行核验履约保函信息。

10.3 电网企业履约保险后，须在3个工作日内通过保险公司保单查询服务核验履约保险信息，并通过国家金融监督管理总局查询确认保险人员销售资格及相关产品条款。

11 履约保障凭证执行

11.1 触发以下场景的，可使用售电公司提交的履约保障凭证进行偿付：

(1) 售电公司未按时足额向电网企业缴纳批发、零售价差相关结算费用；

(2) 售电公司未按期足额支付交易服务费；

(3) 拟退出售电公司在处置电力交易合同中，因售电公司原因造成其他市场成员经济损失的。

11.2 售电公司未按时足额向电网企业缴纳批发、零售价差相关结算费用的，履约保障凭证应偿付额度为售电公司欠缴的相关结算费用及其违约金金额之和。

11.3 售电公司未按期足额支付交易服务费的，履约保障凭证应偿付额度为售电公司欠缴的交易服务费金额。

11.4 拟退出售电公司因合同处置造成购售方市场成员经济损失的，广西电力交易中心应向电力市场主体发布履约保障凭证偿付申请公告，收集售电公司造成经济损失及需偿付金额。

11.5 触发履约保障凭证偿付场景的，受损失的市场成员应在偿付申请期内（10 个工作日），向广西电力交易中心提出履约保障凭证偿付申请，否则视为自愿放弃履约保障凭证偿付的权利。其中，各偿付申请期起始日期如下：

（1）售电公司未按时足额向电网企业缴纳批发、零售价差相关结算费用的，偿付申请期自结算协议约定的缴费日期次日起开始计算，暂未约定缴费日期的，自交易机构开具结算单后 10 个工作日内开始计算。

（2）售电公司欠缴电力交易机构交易服务费的，偿付申请期自欠缴费用的次日起开始计算。

（3）拟退出售电公司因合同处置造成购售方市场成员经济损失的，偿付申请期自偿付申请公告发布之日起开始计算。

11.6 广西电力交易中心收到履约保障凭证偿付申请（见附录 8）后，在 2 个工作日内判断是否属于受理范围，不予受理的须告知原因。明确受理的，应书面通知相关售电公司核实情况，其中售电公司可在通知发出后 3 个工作日内提出书面反馈及相关证明材料，作为履约保障凭证偿付的参考依据，逾期未反馈的视为无异议。若当事双方对事实存在明显争议，广西电力交易中心将有关情况提请主管部门协调指导。

11.7 拟退出售电公司因合同处置造成购售方市场成员经济损失的，广西电力交易中心结合实际按需依法依规制定售电公司履约保障凭证偿付相应市场主体的方案并报政府主管部门同意。偿付执行前，广西电力交易中心应向市场主

体公示售电公司对其他市场成员造成经济损失及偿付额度，公示期为 3 个工作日。

11.8 广西电力交易中心会同电网企业完成履约保障凭证使用、偿付工作，并将执行情况报告政府主管部门。涉及履约保函（保险）原件使用的，由电网企业向电力交易机构提出纸质履约保函（保险）原件使用申请（见附录 9），在做好相关记录后，电力交易机构将履约保函（保险）原件交付电网企业，并将有关情况告知履约保函（保险）开立单位，同时向售电公司发出执行告知书（见附录 10）。电网企业向履约保函开立单位出具履约保函（保险）原件，提交经电力交易机构盖章确认的索赔通知书并要求支付款项。对于已经与电力交易机构建立电子信息交互通道的银行、保险公司，上述流程可以改为线上操作。

11.9 售电公司履约保障凭证涉及多个偿付场景的，按照以下场景顺序依次偿付相应费用。同一偿付场景下涉及多个偿付主体的，若履约保障凭证额度不足，按照各偿付主体应偿付金额等比例偿付。

（1）售电公司未按期足额支付交易服务费。

（2）售电公司未按时足额向电网企业缴纳批发、零售价差相关结算费用。

（3）拟退出售电公司在购售电合同处置过程中，对其他市场成员造成的经济损失。

（4）涉及偿付的其他费用。

11.10 售电公司提交多份履约保障凭证的，应综合考虑

凭证种类、到期时间、金额大小等情况使用偿付。售电公司履约保障凭证执行完毕后，仍不足以结清的市场化交易结算费用，售电公司应根据履约保函、保险执行告知书要求，在规定时限内足额缴纳相关结算费用。售电公司承担履约保障凭证偿付过程中的银行转账手续费等相关费用。

11.11 偿付执行完成后，若履约保障凭证还有未执行金额，受益人（被保险人）应将履约保障凭证交还广西电力交易中心保管。

11.12 电网企业向经营主体付款的总额不应超过实际收款及提取到的履约保函、保险金额总和。

12 履约保障凭证退还

12.1 售电公司在满足信用额度、信用额度占用率要求的前提下，可向申请退还多缴纳的履约保障凭证：

12.1.1 若为纸质保函（保险），售电公司须提供履约保函（保险）退还申请（见附录 11）及接收证明，退还申请由售电公司法定代表人签字并加盖企业公章，广西电力交易中心核验通过后将履约保函（保险）文本退还售电公司；

12.1.2 若为电子保函（保险），售电公司通过电力交易平台发起电子履约保函退还申请，经广西电力交易中心核验通过，有关数据推送至银行业务系统后，系统自动退还。

12.2 若履约保障凭证已失效，无需提交书面申请。广西电力交易中心对失效的履约保障凭证保存 2 年，自失效之日起开始计算。

12.3 考虑市场化电费差错退补有滞后性，广西电力交易

中心在售电公司退出后，按照其电费结算终止日期计保留其履约保障凭证 6 个月，期满退还。履约保障凭证在售电公司电费结算终止日期后 6 个月内失效的，或售电公司在退出后 6 个月内办理企业注销、需取回履约保障凭证的，售电公司须与其股东、上级单位或其他有履行能力的第三方协商，由第三方出具连带责任担保并经过公证的承诺书，提交各省区电力交易机构后退还其履约保障凭证。

13 附则

13.1 本工作指引由广西电力交易中心负责解释。

13.2 本工作指引从 2024 年度交易起实施，原《广西电力市场售电公司履约保障凭证管理实施细则》（桂电交易〔2022〕61 号）同时废止。

附录 1：风险额度计算方法

一	信用额度	计算说明
(一)	$R_{\text{信用额度}} = R_{\text{凭证担保额度}} + R_{\text{信用担保额度}}$	信用额度计算
1	$R_{\text{凭证担保额度}} = M_{\text{首缴}} + M_{\text{补缴}} - M_{\text{退还}}$	凭证担保额度计算
2	$R_{\text{信用担保额度}} = R_{\text{信用额度}} \times \rho_{\text{信用等级系数}}$	$\rho_{\text{信用等级系数}}$ 取值见附录 2
(二)	$R_{\text{信用额度}} \geq Q_{\text{签约电力用户过去12个月总用电量}} \times S_{\text{缴纳标准}}$	$S_{\text{缴纳标准}}$ 取值见附录 2
(三)	$Q_{\text{可交易规模}} = R_{\text{信用额度}} \div S_{\text{缴纳标准}} - Q_{\text{累计成交量}} + Q_{\text{已履约电量}}$	$S_{\text{缴纳标准}}$ 取值见附录 2
三	风险额度	计算说明
(一)	$R_{\text{风险额度}} = \sum R_{\text{月度结算风险费用}} + \sum R_{\text{月度其他风险费用}}$	风险额度计算
(二)	$R_{\text{月度结算风险费用}} = \max\{C_{\text{月度应付结算费用}} - C_{\text{月度已付结算费用}}, 0\}$	/
1	对于月度结算风险费用，已形成结算正式结果的，取正式结果。 未形成结算正式结果但已形成结算临时结果的，取临时结果。	往月
2	$C_{\text{月度应付结算费用}} = C_{\text{月度中长期}} + C_{\text{月度现货}} + C_{\text{月度分摊返还}} - C_{\text{月度零售}}$	当月（现货运行月）
(1)	$C_{\text{月度中长期}} = \sum(Q_{\text{中长期合约分月}} \times P_{\text{中长期合约分月}})$	/
(2)	$C_{\text{月度现货}} = \sum C_{\text{日现货}}$	对于已形成日清分临时结果的日期，取临时结果，对于其他日期，按公式 A-C 计算
A	$C_{\text{日现货}} = Q_{\text{现货偏差}} \times P_{\text{日前}} + K_{\text{折算系数}} \times Q_{\text{实时偏差}} \times P_{\text{日前实时差价}}$	$K_{\text{折算系数}}$ 取值见附录 2
B	$Q_{\text{现货偏差}} = Q_{\text{预测日用电}} - Q_{\text{中长期合约分日}}$	/
①	$Q_{\text{预测日用电}} = (Q_{\text{预测月度用电}} - Q_{\text{月度已清算}}) / T_{\text{月度未清算}}$	/
②	$Q_{\text{预测月度用电}} = \max\left\{ \begin{array}{l} Q_{\text{零售历史同期月份}}, Q_{\text{零售近期用电均值}}, \\ Q_{\text{已清算运行日日均实际}} \times T_{\text{总天数}} \end{array} \right\} \times G_{\text{调整系数}}$	
C	$Q_{\text{实时偏差}} = Q_{\text{日用电}} \times \sigma_{\text{日前申报偏差}}$	/
(3)	$C_{\text{月度分摊返还}} = Q_{\text{预测月度用电}} \times P_{\text{分摊返还}}$	/
(4)	$C_{\text{月度零售}} = Q_{\text{预测月度用电}} \times P_{\text{月度零售}}$	/

广西电力市场履约风险管理工作指引

3	$C_{\text{月度应付结算费用}} = C_{\text{月度中长期}} + C_{\text{月度偏差}} - C_{\text{月度零售}}$	当月（非现货运行月）
(1)	$C_{\text{月度中长期}} = \sum(Q_{\text{中长期合约}} \times P_{\text{中长期合约}})$	/
(2)	$C_{\text{月度偏差}} = Q_{\text{月度偏差}} \times P_{\text{用户侧偏差}}$	/
(3)	$Q_{\text{月度偏差}} = Q_{\text{预测月度用电}} - Q_{\text{中长期合约分月}}$	/
①	$Q_{\text{预测月度用电}} = \max\{Q_{\text{零售历史同期月份}}, Q_{\text{零售近期用电均值}}\} \times G_{\text{调整系数}}$	
(4)	$C_{\text{月度零售}} = Q_{\text{预测月度用电}} \times P_{\text{月度零售}}$	/
4	$C_{\text{月度应支付结算费用}} = Q_{\text{预测月度用电}} \times R_{\text{度电盈亏}}$	次月
(1)	$Q_{\text{预测月度用电}} = \max\{Q_{\text{零售历史同期月份}}, Q_{\text{零售近期用电均值}}\} \times G_{\text{调整系数}}$	$G_{\text{调整系数}}$ 取值见附录 2
(三)	$R_{\text{月度其他风险费用}} = \max\{C_{\text{月度应付服务费}} - C_{\text{月度已付服务费}}, 0\}$	/
三	信用额度占用率	计算说明
1	$O_{\text{信用额度占用率}} = R_{\text{风险额度}} / R_{\text{信用额度}}$	/

附：

1	$R_{\text{信用额度}}$	信用额度
2	$R_{\text{凭证担保额度}}$	凭证担保额度
3	$R_{\text{信用担保额度}}$	信用担保额度
4	$R_{\text{风险额度}}$	总体风险额度
5	$R_{\text{月度结算风险费用}}$	评估月份的结算风险费用
6	$R_{\text{月度其他风险费用}}$	评估月份的其他风险费用，主要是交易服务费的应付未付情况
7	$O_{\text{信用额度占用率}}$	售电公司风险额度占其信用额度的比率
8	$S_{\text{缴纳标准}}$	缴纳标准
9	$\rho_{\text{信用等级系数}}$	信用等级系数
10	$M_{\text{首缴}}$	首次缴纳的履约保障凭证对应额度
11	$M_{\text{补缴}}$	补缴的履约保障凭证对应额度

12	M 退还	退还的履约保障凭证对应额度
13	C 月度应付结算费用	应当支付的月度结算费用
14	C 月度已付结算费用	已经支付的月度结算费用
15	C 月度应付服务费	应当支付的月度服务费，按照交易服务费标准计算
16	C 月度已付服务费	已经支付的月度服务费
17	C 月度中长期	对应评估月份的中长期电能量电费
18	C 月度现货	对应评估月份的现货电能量电费
19	C 月度分摊返还	对应评估月份的分摊返还费用
20	C 月度零售	对应评估月份的零售电费
21	C 日现货	日现货电能量电费
22	C 月度偏差	对应评估月份的偏差电费
23	Q 签约电力用户过去 12 个月总用电量	签约电力用户过去 12 个月总用电量
24	Q 可交易规模	可交易规模
25	Q 累计成交电量	评估周期内累计成交电量
26	Q 已履约电量	评估周期内已履约电量
27	Q 中长期合约分月	中长期合约分月净电量
28	Q 现货偏差	预测日用电量与中长期合约分日净电量的差值
29	Q 实时偏差	实时偏差电量
30	Q 中长期合约分日	中长期合约分日净电量
31	Q 预测日用电	预测日用电量
32	Q 预测月度用电	预测月度用电量
33	Q 月度已清算	月度已清算运行日总用电量
34	Q 零售近期用电均值	售电公司的零售用户最近 M 个已结算月份的实际用电量平均值
35	Q 已清算运行日日均实际用电	月度已清算运行日的日均实用电量

36	Q _{月度偏差}	月度偏差电量
37	Q _{零售历史同期月份}	售电公司的零售用户上一年同期月份实际用电量
38	P _{中长期合约分月}	中长期合约分月价格
39	P _{日前}	最近 D 个已清算运行日各时段用户侧统一结算点日前价格的算术平均值，非现货运行日以缺省值替代
40	P _{日前实时差价}	最近 D 个已清算运行日各时段用户侧统一结算点日前实时差价绝对值的算术平均值，非现货运行日以缺省值替代
41	P _{分摊返还}	分摊返还度电均价，取最近 M 个已结算月份分摊返还度电均价平均值，非现货月份以缺省值替代
42	P _{月度零售}	最近 M 个已结算月份售电公司零售度电均价平均值，售电公司在该时段内未参与交易的，以全市场零售度电均价替代
43	P _{用户侧偏差}	用户侧最近一次的偏差电量加权平均价格
44	R _{度电盈亏}	电费度电盈亏，取最近 M 个已结算月份售电公司电费度电盈亏平均值，售电公司在该时段内未参与交易的，以全市场电费度电盈亏替代
45	T _{月度未清算}	该月未清算运行日天数
46	T _{总天数}	该月总运行日天数
47	K _{折算系数}	计算拟合日前实时偏差的折算系数
48	σ _{日前申报偏差}	最近 D 个已清算运行日各时段日前申报电量偏差绝对值与实用电量比率的算术平均值，非现货运行日以缺省值替代
49	G _{调整系数}	调整系数参考实际负荷增长确定，初始取值见附录 2

附录 2：参数初始取值

序号	参数名称	参数取值
1	S 缴纳标准	0.8 分/千瓦时
2	ρ 信用等级系数	近四次信用等级为 AAA 等级：0.2； 近三次信用等级为 AAA 等级：0.15； 近两次信用等级为 AAA 等级：0.1；近 四次信用等级为 AA 等级及以上：0.1； 近三次信用等级为 AA 等级及以上： 0.08； 近两次信用等级为 AA 等级及以上： 0.05； 近一次信用等级为 B 等级：-0.3； 近一次信用等级为 C：-0.5； 其他评级或无评级：0
3	P 日前缺省值	根据广西报价上限确定
4	P 日前实时差价缺省值	0.1 元/千瓦时
5	σ 日前申报偏差缺省值	10%
6	P 分摊返还缺省值	0.01 元/千瓦时
7	K 折算系数	0.25
8	M 参考月份数	3
9	D 参考运行日数	14
10	G 调整系数	1.05

附录 3：保函范本

见索即付履约保函

保函编号：_____

开立日期：____年____月____日

广西电网有限责任公司（下称“受益人”）：

根据《国家发展改革委 国家能源局关于印发〈售电公司管理办法〉的通知》（发改体改规〔2021〕1595号）、《广西电力市场履约风险管理工作指引》及《_____（结算协议等合同）》（下称“《协议》”）有关要求，应_____公司（售电公司）申请，在此向受益人开立不可撤销、见索即付的独立性履约保函（下称“本保函”），作为售电公司履行电力市场交易义务的担保。

一、保函金额为人民币_____（大写）元整。

二、本保函自____年____月____日起生效，有效期至____年____月____日止。

三、本保函在有效期内的索赔方式采取下列第____项约定：

（一）本保函项下索赔不允许分次进行，一旦发生索赔事项，本保函失效。

（二）本保函项下索赔可分次进行，且以保函金额为限，担保金额随我行已支付的金额自动递减。

四、在本保函有效期内，我行收到受益人提交的符合本保函约定的索赔文件次日起七个工作日内，以保函金额为限，向受益人支付款项。

（一）受益人的索赔通知应以书面形式提出并经电力交易机构盖章确认，须在本保函有效期内送达我行，否则，我行在本保函项下的担保责任自动解除。

（二）索赔通知书须注明本保函编号，无需随附其他任何证据或证据性材料，也无需说明任何理由。

（三）索赔通知书需列明本保函项下要求索赔的金额、收款账号，并声明该款项并未由保函申请人或其代理人直接或间接支付给受益人。

(四) 受益人索赔时可通过本行企业网银或本行已提供的数据接口系统向本行发送索赔通知及所附资料。

五、本保函有效期内，我行如要提前解除、终止本保函项下的任何责任与义务，须征得受益人书面同意。

六、我行特此放弃所有因受益人与申请人之间发生争议或相互索赔款而享有的任何抗辩权。

七、未经本行书面同意，本保函不得转让，并不得将本保函为任何债权债务设定质押、抵押或其他任何形式的担保。

八、受益人将债权转让第三人时需经我行书面同意，否则我行在本保函项下的保函责任自动解除。

九、本保函有效期满或提前终止，应立即将本保函正本原件退回我行。在此情况下，无论本保函是否退回，本保函自失效日起均视为自动失效，我行在本保函项下的保函责任和义务自动解除。

十、本保函适用中华人民共和国法律，受中华人民共和国法律管辖。在本保函履行期间，如发生争议，各当事人首先应协商解决。协商未果的，任何一方可向受益人住所地有管辖权的法院提起诉讼。

银行（公章）：

负责人/授权代理（签字）：

地 址：

联系人：

联系电话：

附录 4：保单范本

售电公司电力交易履约保证保险保单

保单号：_____

一、投保人

名称：_____售电有限公司

统一社会信用代码：_____

联系人：_____ 联系电话：_____

联系地址：__省__市__县（区）_____

二、被保险人

名称：广西电网有限责任公司

统一社会信用代码：_____

联系人：_____ 联系电话：_____

联系地址：__省__市__县（区）_____

邮政编码：_____ 电子邮箱：_____

三、电力交易信息

电力交易协议名称：_____

预计年售电量规模：_____千瓦时

履约保证期：自 202__年__月__日 0 时起，至 202__年__月__日

24 时止。

履约保证金金额（元）：_____

四、主险

保险金额 人民币(大写)：_____ ￥：_____元

含税总保险费 人民币(大写):_____ ¥:_____元

不含税保险费 人民币(大写):_____ ¥:_____元

增值税额 人民币(大写):_____ ¥:_____元

五、附加险

无

六、免赔条件

无

七、保险期限

自 20__年__月__日 0 时起, 至 20__年__月__日 24 时止。

八、保险费交付日期

于 20__年__月__日前交清全部保费

九、保险合同争议解决方式

诉讼

十、司法管辖

中华人民共和国管辖(港、澳、台除外)

十一、特别约定

1. 保险事故发生后, 被保险人可在保单期限内或保单止期后不少于 180 天内书面通知保险公司事故已发生, 启动索赔程序。

2. 保险公司须在索赔资料齐全后 5 个工作日内按照保险合同约定完成赔付, 索赔所需资料包括: 保险单正本、索赔申请书、电力交易机构提供的结算依据、欠费催缴通知书。

3. 非经被保险人同意, 任何一方不得单方面解除合同。

4. 本保险合同适用于售电公司履约保证保险条款。财产保险备案产品自主注册平台产品信息说明，注册编号：_____，
保险公司名称：_____，
保险产品名称：_____，
报送文件号：_____，注册日期：_____，
经营区域：_____。

5. 本保险合同的生效以保险人核保后签发书面保险单为标志。

6. 本保险合同一律采用书面形式，任何口头或其他形式的非书面约定，对本保险合同的当事人没有法律约束力。

7. 除另有书面约定外，投保人未在本保险合同约定的缴费日期前一次性足额缴纳全部保险费或约定的首期保险费的，保险人不承担保险责任。

8. ……………

十二、适用条款

本保单适用主险条款为：《_____售电公司电力交易履约保证保险》，备案号：（_____）（备 保证保险）_____号

出单公司：_____

地址：_____

保险人（签章）：

电话：_____

出单日期：_____

附录 5:

广西电力市场售电公司履约保证保险 规范性条款

1. 履约保证保险适用于按照有关电力交易的法律、法规、规章及行业规定，由电力用户、售电公司、发电企业、电网企业、电力交易机构及电力调度机构通过市场化方式签订的电力交易合同。

2. 因投保人未履行电力交易合同约定的义务，导致发生投保人未按照电力交易机构出具的结算依据按时足额与被保险人完成资金结算，以及投保人损害被保险人利益的其它情形出现，视为保险事故发生，保险公司按照保险合同约定承担赔偿责任。

3. 履约保证保险等待期为 0 天。

4. 履约保证保险免赔率或免赔额均为 0。

5. 保险事故发生后，被保险人可在《保险法》规定的时效内书面通知保险公司事故已发生，启动索赔程序。

6. 保险公司须在索赔资料齐全后 5 个工作日内按照保险合同约定完成赔付，索赔所需资料包括：保险单正本、索赔申请书、电力交易机构提供的结算依据、履约保障凭证执行告知书。

7. 未经被保险人同意，任何一方不得单方面解除合同。投保人申请合同解除时，应提供合同解除申请书、保险单正本、被保险人或其授权代表出具的解除保险合同无异议书面证明。

附录 6:

广西电力市场履约保障凭证业务合作协议

甲方（电力交易机构）：广西电力交易中心有限责任公司，系经国家或政府批准授权的电力交易运营单位，统一社会信用代码：91450000MA5KMDRYXD，法定代表人（企业负责人）：_____。

乙方（银行/保险机构）：_____，所在地为 _____，统一社会信用代码：_____，法定代表人（企业负责人）：_____。

为规范广西电力市场履约保障凭证管理，根据《售电公司管理办法》（发改体改规〔2021〕1595号）等法律、法规和规则，结合广西电力市场建设实际，特制定本协议。

第一条 甲方作为广西电力市场履约保障凭证的唯一管理机构，负责对履约保函（保险）的开立、接收、执行、退还的全生命周期开展管理，组织市场主体对乙方提供的产品、服务质量进行评价及披露。

第二条 乙方自愿成为广西电力市场履约保障凭证的开立单位，满足广西电力市场履约保障凭证管理及履约风险管理等制度文件中的各项要求，并及时根据广西电力交易各项政策、规则的变化及时调整履约保障凭证相关产品及服务。

第三条 乙方开立的履约保函须为不可撤销、见索即付、独立性保函，受益人为广西电网有限责任公司。

第四条 乙方开具的履约保险相关文本须满足责任义务明晰、索赔资料明确等要求，不得设置妨碍被保险人按照政策、规则正常索赔的条款，不得设置等待期、免赔额，不得设置保险相关法律法规强制规定范围之外的免赔条款，被保险人（受益人）为广西电网有限责任公司。

第五条 乙方应严格按照广西电力市场履约保障凭证管理履约风险管理有关要求的履约保函/保险保单范本开立，不得修改。

第六条 乙方应为甲方提供履约保函/保险信息验真服务。乙方应提供但不限于出具保函/保险信息查验说明、查验地址、信息系统操作截图等方式，为甲方提供便捷的履约保函/保险信息验真服务，保证履约保函/保险信息的真实、有效，否则甲方有权拒绝接收履约保函、履约保险保单。

第七条 乙方负责提供履约保函执行、履约保险理赔等所需的各项服务，严格按履约保函、履约保险保单上的要求及时办理资金支付及损失赔付。

第八条 具备条件时，乙方应与甲方建立互认互信的电子信息交互通道，实现履约保函、履约保险开立、修改、执行（理赔）、退还等业务在线办理，开具符合规定的电子履约保函（保险），并在电子履约保函（保险）上加盖电子签章。电子履约保障凭证与纸质履约保障凭证具有同等法律效力，乙方应严格按照有关规

则开展凭证的开立、修改、执行（理赔）、退还。

第九条 甲乙双方要共同维护电子通道的安全、稳定运行，具体如下：

（一）甲方牵头负责电子履约保障凭证交互数据接口模型的设计，乙方结合自身实际深度参与接口的设计。接口设计完成后，各方负责本方接口功能开发、调试。

（二）甲乙双方负责保障本侧业务出口网络安全以及通信正常。乙方负责保证本侧网址的正确、安全、合法，如有变更应当及时通知至甲方。乙方对提供至甲方的业务数据真实性、完整性、有效性负责。

（三）甲乙双方各自负责本侧的接口运行状态，保障数据的正常交互，出现故障时协同开展故障排查和恢复。

（四）甲乙双方各自负责本侧软硬件设备的稳定运行，性能调优和安全保障等工作；乙方负责配合甲方的完成网络安全运行方式管控及网络安全的提升、整改。

第十条 任何一方违反本协议或未能按照本协议提供服务，由此给对方或其他相关第三方造成的损失（包括但不限于直接经济损失、诉讼费、公证费、律师费等）由违约方承担。因台风、地震、海啸、洪水、战争、恐怖袭击等不可抗力，导致甲乙双方不能履行或不能完全履行本协议项下有关义务的，不承担违约责任。凡因执行本协议所发生的与本协议有关的一切争议，双方应协商解决。协商不成的，任何一方可依法提请甲方住所地人民法

院通过诉讼程序解决。

第十一条 本协议有效期为自本协议生效之日起【 】年，未经双方协商一致并书面同意，任何一方不得单方提前终止本协议。协议期满后，如双方均未向对方提出书面异议的，本协议将自动延长一年，延长次数不受限制。在协议期满前 30 个工作日内，如任何一方需终止本协议续期的，须以书面形式向对方出具协议终止延期通知书，通知书自送达对方后本协议期到期即效力终止，双方权力与义务解除。

第十二条 本协议经双方有权签字人签字并加盖公章后生效，本协议一式【 】份，甲乙双方各执【 】份，具有同等法律效力。

甲方：广西电力交易中心有限责任公司

法定代表人（或授权代理人）：

年 月 日

乙方：

法定代表人（或授权代理人）：

年 月 日

附录 7：交接清单

编码：_____

履约保函接收证明（交易中心联）

现有_____公司(主体编号：_____），
于____年__月__日向广西电力交易中心有限责任公司递交履约
保障凭证，凭证编号为：_____。

广西电力交易中心有限责任公司已收取该凭证，特此证明。

提交人：_____ 联系方式：_____

接收人：_____ 联系方式：_____

.....
(广西电力交易中心有限责任公司盖章)
.....

编码：_____

履约保函接收证明（售电公司联）

现有_____公司(主体编号：_____），
于____年__月__日向广西电力交易中心有限责任公司递交履约
保障凭证，凭证编号为：_____。

广西电力交易中心有限责任公司已收取该凭证，特此证明。

提交人：_____ 联系方式：_____

接收人：_____ 联系方式：_____

附录 8：偿付申请

履约保障凭证偿付申请

请组织机构名称		统一信用代码	
联系人		联系电话	
收款银行账户信息	银行账户名		
	银行账号		
	开户银行		
申请偿付金额	小写	_____元	大写
被索偿售电公司信息	企业名称		
	统一社会信用代码		市场主体编号
真实性承诺	本单位（申请组织机构）郑重承诺，本偿付申请填报内容属实，我单位对填报内容及提交资料的真实性、合法性、关联性负责。如有不实之处，我单位愿承担因此导致的一切经济责任、法律责任及法律后果。		
申请偿付理由	(证明材料另附)		
申请企业盖章	年 月 日 (加盖公司公章)		

附录 9：使用申请书

履约保障凭证使用申请书

广西电力交易中心有限责任公司：

_____公司为与我公司签署资金结算协议的售电公司，该公司未在广西电力交易中心有限责任公司正式发布结算单后按时足额支付相关结算费用，经提醒仍未交纳，根据《广西电力市场履约风险管理工作指引》，特向广西电力交易中心有限责任公司申请使用该公司提交的履约保障凭证（履约保函、保险）。

附：

1. 结算单
2. 催费通知

广西电网有限责任公司

_____年____月____日

附录 10：执行告知书

履约保障凭证执行告知书

____（售电公司名称）：

因贵公司未按时足额缴纳电力市场相关结算费用，欠缴电力市场化交易相关结算费用_____元。依据《广西电力市场履约风险管理工作指引》相关规定，执行由_____（开立单位）_____开立的编号为_____的履约保障凭证，执行金额_____元（大写：_____元整）。

贵公司履约保障凭证额度不足以支付所欠费用，执行后欠缴市场化交易相关结算费用_____元，请于_____年__月__日前完成缴纳。（视履约保障凭证额度情况发布）

特此告知。

广西电力交易中心有限责任公司

_____年____月____日

附录 11：退还申请书

履约保障凭证退还申请书

广西电力交易中心有限责任公司：

按照《广西电力市场履约风险管理工作指引》有关要求，我公司当前应缴履约保障凭证额度_____元，实际缴纳有效履约保障凭证额度_____元，实际缴纳的有效履约保障凭证超过应缴额度，故申请退还多缴的履约保障凭证。退还后我公司实际缴纳的履约保障凭证额度共计_____元，能够满足应缴额度要求。该凭证信息如下：

编 号：_____；

金 额：_____；

有效期：____年____月____日至____年____月____日止；

开立单位：_____；

开立时间：_____。

法定代表人（签字/签章）：

单位名称（公章）：

_____年_____月_____日

抄送：广西壮族自治区工业和信息化厅、国家能源局南方监管局、广州电力交易中心有限责任公司。

广西电力交易中心有限责任公司

2023年11月7日印发

