

Questão 1 (Peso 30)

De acordo com a cartilha de gestão de riscos da ABRACEEL, os agentes do mercado de energia são impactados de forma distinta pelos principais fatores de risco, a depender do segmento de mercado em que atuam. Explique como cada segmento abaixo costuma se relacionar com as classes de risco.

- a) Consumidor
- b) Gerador
- c) Comercializador

Questão 2 (Peso 30)

Sobre métricas relacionadas a risco de crédito e de acordo com a cartilha de boas práticas da ABRACEEL, explique os itens abaixo:

- a) Probabilidade de Default (PD)
- b) Exposição ao Default (EAD)
- c) Perda dada o Default (LGD)
- d) Perda Esperada (EL)

Questão 3 (Peso 40)

A metodologia que determina o PLD é operacionalizada pelos modelos computacionais NEWAVE, DECOMP e DESSEM. O encadeamento dos modelos pode ser visualizado na figura abaixo, extraída do site da CCEE.

FLUXOGRAMA



Explique, sucintamente, a finalidade e funcionamento de cada modelo.

- a) NEWAVE
- b) DECOMP
- c) DESSEM