LEILÃO nº 006/2006

DETALHAMENTO DA SISTEMÁTICA

5º LEILÃO DE COMPRA DE ENERGIA ELÉTRICA PROVENIENTE DE EMPREENDIMENTOS DE GERAÇÃO EXISTENTES

ÍNDICE

CAPÍTULO 1. INTRODUÇÃO 3

CAPÍTULO 2. DEFINIÇÕES E ABREVIAÇÕES 4
2. 1. Das definições 4

CAPÍTULO 3. DETALHAMENTO DA SISTEMÁTICA DO LEILÃO 9
3. 1. Organização e auditoria do LEILÃO 9
3. 2. Horário do LEILÃO e duração de suas etapas 9
3. 3. Características Gerais do LEILÃO 10

CAPÍTULO 4. CONFIGURAÇÃO DO SISTEMA 12
4. 1. Configuração de dados 12
4. 2. Validação das informações pelos PROPONENTES VENDEDORES 12
4. 3. Informações Disponíveis 13

CAPÍTULO 5. PRIMEIRA FASE 19
5. 1. Geral 19
5. 2. Submissão de LANCES 19
5. 3. Processamento da RODADA 19
5. 4. Divulgação de dados da RODADA 20
5. 5. DECREMENTO 20

CAPÍTULO 6. SEGUNDA FASE 23
6. 1. Geral 23
6. 2. Submissão de LANCE 23
6. 3. Processamento da segunda fase 24

CAPÍTULO 7. ENCERRAMENTO E DIVULGAÇÃO DOS RESULTADOS 25
7. 1. Quantidades e preços de fechamento 25
7. 2. Atividades após o encerramento das negociações 25
7. 3. Declaração de SUBMERCADO 26

Capítulo 1. INTRODUÇÃO

Este documento, denominado DETALHAMENTO DA SISTEMÁTICA, foi preparado para orientar os interessados em participar do LEILÃO, e tem por finalidade detalhar as regras e o mecanismo do LEILÃO, estabelecidos pela Portaria MME nº 285, de 14 de novembro de 2006.

Capítulo 2. DEFINIÇÕES E ABREVIAÇÕES

2. 1. Das definições

São reproduzidas a seguir algumas definições e abreviações utilizadas neste DETALHAMENTO DA SISTEMÁTICA, sendo que, em alguns casos, tais definições e abreviações foram simplificadas ou estendidas. As eventuais definições e abreviações, existentes neste documento e não relacionadas aqui, têm o significado assinalado no EDITAL e seus Anexos.

A utilização das definições constantes neste documento, no plural ou no singular, no masculino ou no feminino, não altera os significados a elas atribuídos.

I - A – 1: Ano em que se realizam os leilões de compra de energia elétrica. Corresponde, para todos os efeitos, ao ano anterior ao ANO BASE "A";

II - AGENTE CUSTODIANTE: instituição financeira responsável pelo recebimento, custódia e eventual execução das GARANTIAS FINANCEIRAS;

III - ANEEL - Agência Nacional de Energia Elétrica: entidade com atribuição de exercer a coordenação do LEILÃO, conforme o art. 19 do Decreto 5.163, de 30 de julho de 2004;

IV - ANO BASE "A": ano de previsão para o início do suprimento da energia elétrica adquirida pelos agentes de distribuição por meio do LEILÃO;

V - AUDITOR: empresa independente contratada pela CCEE com a responsabilidade de testemunhar e auditar o processo de condução do LEILÃO, de forma a assegurar que ocorra de acordo com as regras estabelecidas no EDITAL, na SISTEMÁTICA e neste DETALHAMENTO DA SISTEMÁTICA;

VI - CCEE – CÂMARA DE COMERCIALIZAÇÃO DE ENERGIA ELÉTRICA: entidade responsável pelo planejamento e execução de procedimentos inerentes ao LEILÃO, por delegação da ANEEL, conforme dispõe a Resolução Normativa ANEEL nº 236, de 20 de novembro de 2006;

VII - CENTRO DE GRAVIDADE: ponto virtual considerado nas REGRAS DE COMERCIALIZAÇÃO relativo ao SUBMERCADO no qual será efetuada a entrega simbólica da ENERGIA CONTRATADA;

VIII - COMISSÃO: comissão especial criada para coordenação das atividades do LEILÃO, estabelecida pela Resolução Normativa ANEEL nº 2364, de 20 de novembro de 2006;

IX - COMPRADOR: agente distribuidor de energia elétrica participante do LEILÃO;

X - DECLARAÇÃO: documento apresentado pelos COMPRADORES, obedecendo à disciplina estabelecida em Portaria especifica, do Ministério de Minas e Energia - MME, definindo os montantes de energia elétrica a serem contratados para início de suprimento no ANO BASE "A";

XI - DECREMENTO: redução automática do PREÇO CORRENTE, calculado pelo SISTEMA valor em reais por megawatt-hora (R$/MWh) calculado mediante parâmetros inseridos pelo MME, que subtraído do PREÇO CORRENTE de uma determinada RODADA, representará o novo PREÇO DE LANCE para a RODADA subseqüente;

XII - DETALHAMENTO DA SISTEMÁTICA: o presente documento, divulgado pela ENTIDADE ORGANIZADORA, com base na SISTEMÁTICA, que esclarece e especifica as regras e o mecanismo do LEILÃO;

XIII - EDITAL: instrumento jurídico que torna público o Edital de Licitação nº 006/2006 da ANEEL e seus documentos correlatos, referente ao 5º Leilão de Compra de Energia Elétrica Proveniente de Empreendimentos de Geração Existentes;

XIV - ENERGIA CONTRATADA: montante de energia, expresso em MWh, contratado pelo COMPRADOR e entregue no CENTRO DE GRAVIDADE do(s) SUBMERCADO(S) do VENDEDOR;

XV - ENERGIA HABILITADA: montante de energia habilitado pela ENTIDADE COORDENADORA, expresso em LOTES, relativo a cada PROPONENTE VENDEDOR para venda no LEILÃO;

XVI - ENTIDADE COORDENADORA: Agência Nacional de Energia Elétrica - ANEEL que terá como função exercer a coordenação do LEILÃO, nos termos do artigo 19 do Decreto 5.163 de 30 de julho de 2004;

XVII - ENTIDADE ORGANIZADORA: entidade responsável pelo planejamento e execução de procedimentos inerentes ao LEILÃO, por delegação da ANEEL;

XVIII - FATOR DE REFERÊNCIA: número racional positivo, expresso com três casas decimais, a ser estabelecido pelo MME para cálculo da OFERTA DE REFERÊNCIA;

XIX - GARANTIAS FINANCEIRAS: valor a ser depositado junto ao AGENTE CUSTODIANTE pelos PARTICIPANTES pré-qualificados, para efeito de HABILITAÇÃO;

XX - HABILITAÇÃO: processo ao qual se submetem os COMPRADORES e os PROPONENTES VENDEDORES pré-qualificados para participação no LEILÃO;

XXI - HORÁRIO DO SISTEMA: hora de referência oficial do SISTEMA, que deverá ser observado pelos PROPONENTES VENDEDORES durante o decorrer do LEILÃO. Será tomada como base a hora oficial de Brasília;

XXII - LANCE: ato praticado pelo PROPONENTE VENDEDOR que consiste:

a) na primeira fase: oferta de quantidades de LOTES, em cada RODADA;

b) na segunda fase: oferta de preço e quantidade de LOTES, abrangendo a totalidade dos LOTES válidos no encerramento da primeira fase;

XXIII - LANCE VÁLIDO: LANCE aceito pelo SISTEMA;

XXIV - LASTRO PARA VENDA: montante de energia disponível, limitado à ENERGIA HABILITADA e à GARANTIA FINANCEIRA aportada, para venda em LEILÃO, expresso em LOTES;

XXV - LEILÃO: modalidade de licitação constituída pelo processo para compra de energia elétrica, regida pelo EDITAL e seus documentos correlatos;

XXVI - LOTE: montante de energia elétrica igual a 1,0 MW médio, que representa a menor parcela do PRODUTO;

XXVII - LOTE ATENDIDO: LOTE classificado pelo SISTEMA como vencedor do certame ao término da segunda fase;

XXVIII - LOTE EXCLUÍDO: LOTE que o PROPONENTE VENDEDOR deixa de submeter retira do LEILÃO ao longo das diversas RODADAS da primeira fase;

XXIX - LOTE NÃO ATENDIDO: LOTE ofertado na segunda fase e não classificado pelo SISTEMA como vencedor do certame ao término da segunda fase;

XXX - OBSERVADORES: COMPRADORES e público em geral, aos quais serão colocadas à disposição determinadas informações durante o LEILÃO por meio do site www.ccee.org.br;

XXXI - OFERTA DE REFERÊNCIA: quantidade de LOTES calculada pelo SISTEMA a partir do FATOR DE REFERÊNCIA aplicado à QUANTIDADE TOTAL DEMANDADA, sendo o resultado dessa multiplicação truncado, desprezando-se as casas decimais;

XXXII - OPERADOR: parte, indicada pela CCEE, responsável por desenvolver e manter o SISTEMA em pleno funcionamento durante o decorrer do LEILÃO;

XXXIII - PARTICIPANTES: COMPRADORES e PROPONENTES VENDEDORES;

XXXIV - PERCENTUAL PARA VALIDAÇÃO DE LANCE : percentual, definido pela ENTIDADE COORDENADORA, que será aplicado sobre o PREÇO DE LANCE máximo, sendo que o valor obtido desta operação servirá como alerta para confirmação caso o EMPREENDEDOR e/ou PROPONENTE VENDEDOR venha a submeter LANCE na segunda fase com PREÇO DE LANCE inferior a este valor;

XXXV - PLD_min: Valor mínimo do Preço de Liquidação de Diferenças – PLD, estabelecido pela Resolução ANEEL nº 377, de 30 de julho de 2003, e atualizado pelo Despacho ANEEL nº 57, de 12 de janeiro de 2006, que corresponde a R$ 16,92/MWh (dezesseis reais e noventa e dois centavos por Megawatt-hora);

XXXVI - PREÇO CORRENTE: preço atualizado pelo SISTEMA ao final de cada RODADA, para a RODADA seguinte, se a QUANTIDADE TOTAL OFERTADA for maior do que a OFERTA DE REFERÊNCIA;

XXXVII - PREÇO DE LANCE: preço para o qual um LANCE será aceito como válido pelo SISTEMA, disponível na tela do PROPONENTE VENDEDOR no momento de submissão do LANCE;

XXXVIII - PREÇO INICIAL: preço máximo de aquisição do PRODUTO, inserido pelo representante do MME;

XXXIX - PRODUTO: conjunto de LOTES que serão objeto de celebração de CCEARs;

XL - PROPONENTE VENDEDOR: agente titular de concessão, permissão ou autorização para gerar, importar ou comercializar energia elétrica, que participe do LEILÃO;

XLI - QUANTIDADE DECLARADA: montante de energia elétrica expresso em número de LOTES, individualizado por COMPRADOR, nos termos das DECLARAÇÕES;

XLII - QUANTIDADE DEMANDADA: montante de energia elétrica, expresso em números de LOTES com até três casas decimais, individualizado por COMPRADOR, que se pretende adquirir para o PRODUTO, determinado com base na QUANTIDADE DECLARADA;

XLIII - QUANTIDADE TOTAL DEMANDADA: somatório das QUANTIDADES DEMANDADAS, truncado e desprezando-se as casas decimais;

XLIV - QUANTIDADE TOTAL OFERTADA: somatório das quantidades ofertadas de todos os LOTES de LANCES VÁLIDOS para o PRODUTO;

XLV - RATEIO: alocação do total de ENERGIA CONTRATADA, na proporção da QUANTIDADE DEMANDADA dos COMPRADORES, em MWh, para fins da celebração dos CCEARs;

XLVI - REPRESENTANTE DO MME: pessoa indicada pelo MME;

XLVII - RODADA: período para submissão de LANCES pelos PROPONENTES VENDEDORES e processamento pelo SISTEMA.

XLVIII - SISTEMA: sistema eletrônico utilizado para a realização do LEILÃO, mediante o emprego de recursos de tecnologia da informação e disponibilizado pela rede mundial de computadores - Internet;

XLIX - SISTEMÁTICA: regras e mecanismos do LEILÃO, instituídas por meio da Portaria MME no 285, de 14 de novembro de 2006, que se constituem nas diretrizes para os leilões de energia proveniente de empreendimentos de geração existentes, cujas particularidades constam deste DETALHAMENTO DA SISTEMÁTICA;

L - TEMPO PARA INSERÇÃO DE LANCE: período máximo relativo a cada RODADA durante o qual os PROPONENTES VENDEDORES poderão submeter seus LANCES para validação do SISTEMA;

LI - VENDEDOR: PROPONENTE VENDEDOR que tenha energia negociada no LEILÃO.

Capítulo 3. DETALHAMENTO DA SISTEMÁTICA DO LEILÃO

3. 1. Organização e auditoria do LEILÃO

3.1.1. Respeitado o que determina a Portaria MME nº 285, de 2006, o DETALHAMENTO DA SISTEMÁTICA poderá ser alterado pela ENTIDADE COORDENADORA, conforme previsto na Resolução Normativa nº 236, de 2006. A ENTIDADE COORDENADORA deverá notificar os PROPONENTES VENDEDORES e os COMPRADORES de todas as modificações feitas neste documento, por meio do site www.ccee.org.br na seção "Comercialização de Energia /Leilões" .

3.1.2. O LEILÃO será realizado pela CCEE, na condição de ENTIDADE ORGANIZADORA, e supervisionado pela ENTIDADE COORDENADORA, na forma descrita neste documento e conforme EDITAL.

3.1.3. A ENTIDADE ORGANIZADORA designará um OPERADOR do SISTEMA, o qual será responsável pelo desenvolvimento e manutenção do SISTEMA.

3.1.4. A ENTIDADE ORGANIZADORA designará um AUDITOR responsável por assegurar que o LEILÃO seja conduzido de acordo com as regras estabelecidas no EDITAL, na SISTEMÁTICA, neste DETALHAMENTO DA SISTEMÁTICA e nos atos emitidos pela ENTIDADE COORDENADORA.

3.1.5. Todas as informações inseridas no SISTEMA serão passíveis de auditoria ao término do LEILÃO.

3.1.6. Durante o LEILÃO e por um período não inferior a dezoito meses após o encerramento do LEILÃO, a ENTIDADE ORGANIZADORA, o OPERADOR e o AUDITOR deverão tratar todas as informações relacionadas ao LEILÃO de forma confidencial, exceto aquelas especificadas nos itens 4.3.3, 4.3.4 e 4.3.5, ou caso a divulgação vier a ser exigida por determinação legal.

3. 2. Horário do LEILÃO e duração de suas etapas

3.2.1. O horário previsto para início do LEILÃO, bem como o período de duração dos tempos e etapas do LEILÃO, serão informados pela COMISSÃO por meio de publicação de Comunicado Relevante.

3.2.2. Iniciado o LEILÃO, não haverá prazo para seu encerramento.

3.2.3. Todas as referências de horários deverão ser feitas considerando-se o HORÁRIO DO SISTEMA.

3.2.4. O LEILÃO poderá ser temporariamente interrompido por períodos previamente determinados ou suspenso em decorrência de fatos supervenientes a critério da ENTIDADE COORDENADORA.

3.2.5. Durante as suspensões, as informações relativas aos PROPONENTES VENDEDORES permanecerão disponíveis, porém novos LANCES não poderão ser submetidos.

3.2.6. Durante a primeira fase do LEILÃO, a ENTIDADE COORDENADORA poderá a seu critério alterar o TEMPO PARA INSERÇÃO DE LANCE. Para efetuar tal alteração, o LEILÃO será interrompido e o novo TEMPO PARA INSERÇÃO DE LANCE terá validade a partir da RODADA seguinte.

3. 3. Características Gerais do LEILÃO

3.3.1. O LEILÃO será realizado via SISTEMA, mediante o emprego de recursos de tecnologia da informação e comunicação via rede mundial de computadores - Internet.

3.3.2. São de responsabilidade exclusiva dos representantes dos PROPONENTES VENDEDORES a alocação e a manutenção dos meios necessários para a conexão, o acesso ao SISTEMA e a participação no LEILÃO, incluindo, mas não se limitando, meios alternativos de conexão e acesso por diferentes localidades.

3.3.3. O LEILÃO será composto de duas fases, as quais possuem as seguintes características:

(1) Primeira fase: caracterizar-se-á pela negociação em múltiplas RODADAS com um PREÇO CORRENTE e um PREÇO DE LANCE em cada RODADA.

(2) Segunda fase: ocorrerá a negociação em RODADA única a preços discriminatórios.

3.3.4. O SISTEMA disponibilizará um PRODUTO com início de suprimento a partir de 1º de janeiro de 2007 e com prazo de duração de oito anos.

3.3.5. A quantidade de LOTES em um LANCE deverá ser expressa por meio de um número inteiro não negativo.

3.3.6. O LASTRO PARA VENDA será o valor aportado a título de GARANTIAS FINANCEIRAS, dividido por R$ 2.000,00/MW médio, limitado à ENERGIA HABILITADA estabelecida pela ENTIDADE COORDENADORA.

3.3.7. Para cada PROPONENTE VENDEDOR o somatório dos LOTES ofertados deverá respeitar, cumulativamente, o limite máximo correspondente:

(1) ao LASTRO PARA VENDA;

(2) a quantidade de LOTES ofertada no LANCE anterior, a partir do segundo LANCE.

3.3.8. O PROPONENTE VENDEDOR não poderá cancelar ou alterar um LANCE VÁLIDO aceito pelo SISTEMA.

3.3.9. Na segunda fase, em caso de empate de PREÇOS DE LANCE, o desempate será realizado mediante seleção randômica.

3.3.10. Cada PROPONENTE VENDEDOR poderá indicar por meio do Cadastro de Participante até três pessoas para fins de acesso ao SISTEMA e submissão de LANCE no LEILÃO.

3.3.11. Na entrega da documentação de pré-qualificação prevista no EDITAL, os PROPONENTES VENDEDORES receberão o login e a senha de acesso ao SISTEMA para cada uma das pessoas indicadas, conforme estabelecido no item 3.3.10.

Capítulo 4. CONFIGURAÇÃO DO SISTEMA

4. 1. Configuração de dados

4.1.1. A ENTIDADE ORGANIZADORA inserirá no SISTEMA, antes do início do LEILÃO, os seguintes dados:

(1) as GARANTIAS FINANCEIRAS aportadas pelos PARTICIPANTES, com base em informações fornecidas pelo AGENTE CUSTODIANTE;

(2) TEMPO PARA INSERÇÃO DE LANCES;

(3) o tempo entre cada fase;

(4) o tempo da RODADA única da 2ª fase.

(5) relação dos PROPONENTES VENDEDORES; e

(6) relação dos COMPRADORES;

(7) a distribuição do LASTRO PARA VENDA dos PROPONENTES VENDEDORES em percentual por submercado;

(8) o PLD_min;

(9) o PERCENTUAL PARA VALIDAÇÃO DE LANCE;e

(10) parâmetro para conversão de GARANTIAS FINANCEIRAS.

4.1.2. O MME inserirá diretamente no SISTEMA, antes do início das negociações no LEILÃO, as seguintes informações:

(1) O PRODUTO;

(2) o FATOR DE REFERÊNCIA;

(3) o(s) parâmetro(s) para o cálculo do DECREMENTO;

(4) as QUANTIDADES DEMANDADAS; e

(5) o PREÇO INICIAL do PRODUTO.

4.1.3. A ENTIDADE COORDENADORA inserirá no SISTEMA, antes do início das negociações no LEILÃO:

(1) a disponibilidade de LASTRO PARA VENDA de cada PROPONENTE VENDEDOR, expressa em número de LOTES;

4. 2. Validação das informações pelos PROPONENTES VENDEDORES

4.2.1. Durante período previamente definido por meio de Comunicado Relevante, os PROPONENTES VENDEDORES deverão acessar o SISTEMA de forma a validar as respectivas GARANTIAS FINANCEIRAS.

4.2.2. Caso verifique alguma divergência, o PROPONENTE VENDEDOR deverá, em prazo e telefone informado previamente aos PROPONENTES VENDEDORES, entrar em contato com a ENTIDADE ORGANIZADORA para que esta providencie eventuais correções dos dados.

4.2.3. A não manifestação do EMPREENDEDOR, até o prazo estabelecido, implicará sua concordância quanto aos dados referidos no item 4.2.1.

4. 3. Informações Disponíveis

4.3.1. O SISTEMA disponibilizará aos PROPONENTES VENDEDORES:

(1) número da RODADA em andamento;

(2) contador regressivo do TEMPO PARA INSERÇÃO DE LANCE;

(3) sua disponibilidade de LASTRO PARA VENDA, em LOTES;

(4) quantidade de LOTES relativos à sua própria GARANTIA FINANCEIRA;

(5) seus respectivos LOTES disponíveis para oferta na RODADA;

(6) seus respectivos LOTES EXCLUÍDOS até a RODADA anterior;

(7) PREÇO CORRENTE;

(8) PREÇO DE LANCE;

(9) histórico das RODADAS processadas, contendo:

(a) número da RODADA;

(b) PREÇO CORRENTE;

(c) PREÇO DE LANCE;

(10) histórico de seus LANCES VÁLIDOS, até a última RODADA processada, contendo:

(a) RODADA em que o LANCE foi submetido;

(b) quantidade de LOTES e PREÇO DE LANCE associado ao LANCE;

(11) quaisquer mensagens enviadas pela ENTIDADE COORDENADORA a todos os PROPONENTES VENDEDORES; e

(12) mensagens enviadas automaticamente pelo SISTEMA.

4.3.2. Durante o LEILÃO serão disponibilizadas as seguintes informações para a ENTIDADE ORGANIZADORA, o MME, a ENTIDADE COORDENADORA e a COMISSÃO:

(1) ENTIDADE ORGANIZADORA:

(a) descrição do LEILÃO;

(b) data e horário de início do LEILÃO;

(c) fase do LEILÃO;

(d) RODADA do LEILÃO;

(e) LOTES livres para submissão

(f) contador regressivo do TEMPO PARA INSERÇÃO DE LANCE;

(g) LOTES EXCLUÍDOS;

(h) Quantidade de LANCES submetidos;

(i) PROPONENTES VENDEDORES em negociação;

(j) quantidade de PROPONENTES VENDEDORES conectados ao SISTEMA;

(k) situação do LEILÃO;

(l) PROPONENTES VENDEDORES excluídos;

(m) histórico das RODADAS processadas, contendo:

(i) PRODUTO;

(ii) número da RODADA;

(iii) PREÇO CORRENTE;

(iv) PREÇO DE LANCE;

(v) QUANTIDADE TOTAL DEMANDADA;

(vi) QUANTIDADE TOTAL OFERTADA;

(vii) Fator percentual da QUANTIDADE TOTAL OFERTADA em relação à QUANTIDADE TOTAL DEMANDADA;

(n) LANCES processados;

(o) arquivo XML com os resultados consolidados da RODADA;

(p) quaisquer mensagens enviadas pela ENTIDADE COORDENADORA a todos os PROPONENTES VENDEDORES;

(2) o MME:

(a) descrição do LEILÃO;

(b) data e horário de início do LEILÃO;

(c) fase do LEILÃO;

(d) RODADA do LEILÃO;

(e) LOTES livres para submissão;

(f) contador regressivo do TEMPO PARA INSERÇÃO DE LANCE;

(g) LOTES EXCLUÍDOS;

(h) Quantidade de LANCES submetidos;

(i) PROPONENTES VENDEDORES em negociação;

(j) quantidade de PROPONENTES VENDEDORES conectados ao SISTEMA;

(k) situação do LEILÃO;

(l) PROPONENTES VENDEDORES excluídos;

(m) histórico das RODADAS processadas, contendo:

(i) PRODUTO;

(ii) número da RODADA;

(iii) PREÇO CORRENTE;

(iv) PREÇO DE LANCE;

(v) QUANTIDADE TOTAL DEMANDADA;

(vi) QUANTIDADE TOTAL OFERTADA;

(vii) Fator percentual da QUANTIDADE TOTAL OFERTADA em relação à QUANTIDADE TOTAL DEMANDADA;

(viii) LANCES processados;

(n) quaisquer mensagens enviadas pela ENTIDADE COORDENADORA a todos os PROPONENTES VENDEDORES;

(o) parâmetros do Leilão

(b) PRODUTO, contendo:

(i) PREÇO INICIAL;

(ii) Data de início de suprimento;

(iii) Data de término de suprimento;

(iv) FATOR DE REFERÊNCIA;

(v) QUANTIDADE TOTAL DEMANDADA.

(c) QUANTIDADES DEMANDADAS por COMPRADOR;

(d) DECREMENTO, contendo:

(i) Limite superior;

(ii) Limite inferior;

(iii) Degraus.

(e) LASTRO E GARANTIA para cada PARTICIPANTE

(3) A ENTIDADE COORDENADORA e a COMISSÃO:

(a) descrição do LEILÃO;

(b) data e horário de início do LEILÃO;

(c) fase do LEILÃO;

(d) RODADA do LEILÃO;

(e) LOTES livres para submissão

(f) contador regressivo do TEMPO PARA INSERÇÃO DE LANCE;

(g) LOTES EXCLUÍDOS;

(h) Quantidade de LANCES submetidos;

(i) PROPONENTES VENDEDORES em negociação;

(j) quantidade de PROPONENTES VENDEDORES conectados ao SISTEMA;

(k) situação do LEILÃO;

(l) PROPONENTES VENDEDORES excluídos;

(m) histórico das RODADAS processadas, contendo:

(i) PRODUTO;

(ii) número da RODADA;

(iii) PREÇO CORRENTE;

(iv) PREÇO DE LANCE;

(v) QUANTIDADE TOTAL DEMANDADA;

(vi) QUANTIDADE TOTAL OFERTADA;

(vii) Fator percentual da QUANTIDADE TOTAL OFERTADA em relação à QUANTIDADE TOTAL DEMANDADA;

(viii) LANCES processados;

(n) descriptografia de LANCES;

(o) quaisquer mensagens enviadas pela ENTIDADE COORDENADORA a todos os PROPONENTES VENDEDORES;

(p) log de auditoria;

(q) parâmetros com a opção de alteração;

(r) opção de enviar mensagem aos usuários conectados;

(s) parâmetros do LEILÃO;

(t) LASTRO E GARANTIA para cada PARTICIPANTE

4.3.3. Os OBSERVADORES terão acesso às seguintes informações durante o LEILÃO:

(1) data e horário do início do LEILÃO;

(2) PREÇO INICIAL;

(3) fase em andamento;

(4) situação do LEILÃO (Em Andamento, Suspenso ou Encerrado);

(5) PREÇO CORRENTE;

(6) histórico das RODADAS processadas, contendo:

(a) número da RODADA;

(b) PREÇO CORRENTE;

(c) PREÇO DE LANCE e

(7) horário de atualização dos dados.

4.3.4. Ao término do LEILÃO os VENDEDORES terão acesso a um relatório de suas negociações contendo:

(1) ENERGIA CONTRATADA;

(2) identificação dos COMPRADORES;

(3) PREÇO de fechamento associado aos LOTES ATENDIDOS;

(4) GARANTIAS FINANCEIRAS vinculadas à quantidade de LOTES negociados;

4.3.5. Os OBSERVADORES terão acesso ao término do LEILÃO, as seguintes informações:

(1) data e horário de início e término do LEILÃO;

(2) identificação do(s) VENDEDOR(ES);

(3) identificação do(s) COMPRADORE(S);

(4) PREÇOS de fechamento;

(5) Montantes de ENERGIA CONTRATADA por COMPRADOR de cada VENDEDOR;

(6) Montantes totais de ENERGIA CONTRATADA por COMPRADOR; e

(7) Preços médios de venda do LEILÃO, expressos em Reais por megawatt-hora (R$/MWh), e o total transacionado, expresso em megawatts-hora (MWh).

Capítulo 5. PRIMEIRA FASE

5. 1. Geral

5.1.1. A primeira fase caracterizar-se-á pela oferta de LOTES , em múltiplas RODADAS, pelos PROPONENTES VENDEDORES ao PREÇO DE LANCE, definido pelo SISTEMA.

5.1.2. Para cada RODADA, o SISTEMA disponibilizará o PREÇO DE LANCE e dará início ao TEMPO PARA INSERÇÃO DE LANCE, sendo que na abertura da primeira fase o PREÇO CORRENTE e o PREÇO DE LANCE serão iguais ao PREÇO INICIAL.

5. 2. Submissão de LANCES

5.2.1. Cada PROPONENTE VENDEDOR poderá fazer um único LANCE por RODADA, que consiste na oferta de quantidades de LOTES ao PREÇO DE LANCE.

5.2.2. A quantidade de LOTES possíveis de serem alocadas em um LANCE estará limitada:

(1) na primeira RODADA: ao LASTRO PARA VENDA do PROPONENTE VENDEDOR; e

(2) nas RODADAS subseqüentes: ao mínimo entre ao LASTRO PARA VENDA e ao somatório dos LOTES de seu LANCE VÁLIDO na RODADA precedente.

5.2.3. O SISTEMA solicitará ao PROPONENTE VENDEDOR a confirmação da submissão do LANCE.

5.2.4. O LANCE que não satisfizer os critérios mencionados no item 5.2.2, não será considerado como LANCE VÁLIDO. O PROPONENTE VENDEDOR poderá então reformular seu LANCE e proceder à nova submissão, desde que o TEMPO PARA INSERÇÃO DE LANCE não tenha se esgotado.

5.2.5. Cada RODADA será encerrada por decurso do TEMPO PARA INSERÇÃO DE LANCE ou em até 01 (um) minuto após todos PROPONENTES VENDEDORES confirmarem seus LANCES, o que ocorrer primeiro.

5.2.6. O LANCE submetido pelo PROPONENTE VENDEDOR, dentro do TEMPO PARA INSERÇÃO DE LANCE, e classificado como LANCE VÁLIDO pelo SISTEMA em cada RODADA, será irretratável e irrevogável.

5. 3. Processamento da RODADA

5.3.1. Encerrada a RODADA, o SISTEMA comparará a QUANTIDADE TOTAL OFERTADA com a OFERTA DE REFERÊNCIA, resultando em uma das seguintes situações:

(1) Se a QUANTIDADE TOTAL OFERTADA for maior ou igual a OFERTA DE REFERÊNCIA, o SISTEMA iniciará uma nova RODADA, procedendo conforme item 5.3.2; ou

(2) se a QUANTIDADE TOTAL OFERTADA for menor que a OFERTA DE REFERÊNCIA, o SISTEMA concluirá a primeira fase, e dará início a segunda fase, conforme Capítulo 6;

5.3.2. Enquanto perdurar o previsto na hipótese (1) do item 5.3.1 e não for verificada a situação prevista no item 5.5.4, a primeira fase continuará com novas RODADAS, sendo que o novo PREÇO DE LANCE será calculado mediante a aplicação do DECREMENTO sobre o PREÇO DE LANCE da RODADA anterior, e o PREÇO DE LANCE da RODADA anterior será o novo PREÇO CORRENTE;

5.3.3. Na ocorrência da hipótese (2) do item 5.3.1., o SISTEMA retornará à RODADA anterior, resgatando os LANCES VÁLIDOS daquela RODADA, para iniciar a segunda fase.

5.3.4. Caso na primeira RODADA ocorra o estabelecido na hipótese (2) do item 5.3.1, serão passíveis de negociação na segunda fase as quantidades de LOTES dos LANCES VÁLIDOS nessa primeira RODADA.

5. 4. Divulgação de dados da RODADA

5.4.1. O SISTEMA atualizará as informações disponíveis aos PROPONENTES VENDEDORES, COMISSÃO, ENTIDADE ORGANIZADORA, ENTIDADE COORDENADORA e OBSERVADORES.

5.4.2. Os LOTES não vinculados ao LANCE submetido nessa RODADA serão considerados como LOTES EXCLUÍDOS e não mais poderão ser utilizados em um novo LANCE nas RODADAS SEGUINTES.

5. 5. DECREMENTO

5.5.1. O DECREMENTO corresponde à redução, em R$/MWh, calculada pelo SISTEMA ao término de cada RODADA e aplicada sobre o PREÇO DE LANCE vigente, de forma a definir o PREÇO LANCE da RODADA subseqüente.

5.5.2. O DECREMENTO, expresso em reais e com arredondamento na segunda casa decimal, será calculado pelo SISTEMA da seguinte forma:

SE:

(1) $\lambda >$ OR

ENTÃO:

(2) $$\beta = \frac{\theta máx - FR}{n}$$

(3) $$Decremento = \left\{ \left[\frac{\beta * int\left(\frac{\theta - FR}{\beta} \right)}{\theta máx - FR} \right]^2 * (Ls - Li) \right\} + Li$$

SE:

(4) λ = OR

ENTÃO:

(5) Decremento = Li

Onde:
λ = quantidade total ofertada na primeira RODADA pelos vendedores, expressa em LOTES;
OR = OFERTA DE REFERÊNCIA, expressa em LOTES;
$\theta máx$ = Representatividade da somatória do LASTRO PARA VENDA dos PROPONENTES VENDEDORES em relação à QUANTIDADE DEMANDADA no PRODUTO;
FR = FATOR DE REFERÊNCIA;
n = quantidade de patamares desejados para o DECREMENTO, expresso em número inteiro positivo;
θ = Representatividade da quantidade ofertada no PRODUTO em relação à QUANTIDADE DEMANDADA;
Ls = valor máximo para o DECREMENTO, expresso em Reais, maior do que Li; e
Li = valor mínimo para o DECREMENTO, expresso em Reais, menor do que Ls.

5.5.3. Durante a primeira fase do LEILÃO, a ENTIDADE COORDENADORA poderá a seu critério alterar o(s) parâmetro(s) para cálculo do DECREMENTO. Para tal alteração, o LEILÃO será interrompido e o(s) novo(s) parâmetro(s) terá(ão) validade a partir da RODADA seguinte.

5.5.4. Caso, em virtude de sucessivas aplicações de DECREMENTO, o PREÇO DE LANCE atinja valor inferior ao PLD_min, o SISTEMA desconsiderará esse novo PREÇO DE LANCE, concluirá a primeira fase do LEILÃO e iniciará a 2ª fase, onde serão passíveis de negociação os LOTES associados ao PREÇO DE LANCE da última RODADA.

Capítulo 6. SEGUNDA FASE

6. 1. Geral

6.1.1. Serão classificados para a Segunda Fase os LOTES associados ao LANCE ao PREÇO CORRENTE da última RODADA da Primeira Fase, ou seja, será passível de negociação a quantidade de LOTES dos LANCES VÁLIDOS na penúltima RODADA da Primeira Fase, exceto quando ocorrer o disposto nos itens 5.3.4 e 5.5.4;

6.1.2. Caso o PROPONENTE VENDEDOR não tenha mais LOTE em negociação, ou seja, se todos os seus LOTES forem considerados como LOTES EXCLUÍDOS, esse ficará impossibilitado de submeter um LANCE na segunda fase.

6. 2. Submissão de LANCE

6.2.1. Nessa fase, cada PROPONENTE VENDEDOR deverá submeter seu LANCE ao preço pelo qual está disposto e apto a ofertar a totalidade de seus LOTES, conforme previsto no item 6.1.1., a qual poderá ser segregada em até duas quantidades a preços distintos.

6.2.2. A cada quantidade de LOTES contida no LANCE da segunda fase, o PROPONENTE VENDEDOR deverá associar um preço igual ou inferior ao último PREÇO CORRENTE, ou seja, PREÇO DE LANCE da penúltima RODADA e superior ou igual ao PLD_min, respeitada as exceções estabelecidas nos itens 6.2.3 e 6.2.4.

6.2.3. Caso a primeira fase se encerre na primeira RODADA, o PROPONENTE VENDEDOR deverá para cada quantidade de LOTES contida no LANCE da segunda fase, associar um preço igual ou inferior ao PREÇO INICIAL e limitado ao PLD_min.

6.2.4. Caso a primeira fase tenha se encerrado devido ocorrência do previsto no item 5.5.4, o PROPONENTE VENDEDOR deverá para cada quantidade de LOTES contida no LANCE da segunda fase, associar um preço igual ou inferior ao PREÇO DE LANCE da última RODADA e limitado ao PLD_min.

6.2.5. O SISTEMA solicitará ao PROPONENTE VENDEDOR a confirmação da submissão do LANCE.

6.2.6. Caso um PROPONENTE VENDEDOR não insira preço ou não oferte a totalidade de LOTES classificados para a segunda fase, o SISTEMA considerará o PREÇO CORRENTE oriundo da primeira fase para toda a quantidade de LOTES, exceto na situação em que a segunda fase tenha se iniciado devido à ocorrência do estabelecido no item 5.5.4, na qual o SISTEMA considerará o PREÇO DE LANCE da última RODADA da primeira fase.

6.2.7. Caso o PROPONENTE VENDEDOR submeta um LANCE com valor inferior ao PREÇO DE LANCE máximo subtraído do PERCENTUAL PARA VALIDAÇÃO DE LANCE, o SISTEMA solicitará ao PROPONENTE VENDEDOR que a confirmação da submissão do LANCE referida no item 6.2.5 seja feita por meio da reinserção do valor submetido.

6.2.8. A segunda fase será encerrada por decurso do TEMPO PARA INSERÇÃO DE LANCE ou em até 01 (um) minuto após todos PROPONENTES VENDEDORES confirmarem seus LANCES, o que ocorrer primeiro.

6.2.9. O LANCE submetido pelo PROPONENTE VENDEDOR, dentro do TEMPO PARA INSERÇÃO DE LANCE, e classificado como LANCE VÁLIDO pelo SISTEMA, será irretratável e irrevogável ao preço definido pelo PROPONENTE VENDEDOR.

6. 3. Processamento da segunda fase

6.3.1. Após o término da Segunda Fase, o SISTEMA ordenará os LANCES por ordem crescente de PREÇO DE LANCE e classificará os LOTES associados como LOTES ATENDIDOS ou LOTES NÃO ATENDIDOS, com base na QUANTIDADE TOTAL DEMANDADA.

6.3.2. Em caso de empate no PREÇO DE LANCE o critério de desempate será randômico e aplicado automaticamente pelo SISTEMA.

6.3.3. Serão consideradas vencedoras, total ou parcialmente, somente as propostas relativas às quantidades de LOTES que atenderem até a QUANTIDADE TOTAL DEMANDADA.

Capítulo 7. ENCERRAMENTO E DIVULGAÇÃO DOS RESULTADOS

7. 1. Quantidades e preços de fechamento

7.1.1. As quantidades de LOTES negociadas serão as relacionadas aos menores preços que atenderem à QUANTIDADE TOTAL DEMANDADA do PRODUTO.

7.1.2. Os preços de fechamento serão discriminatórios, ou seja, corresponderão aos valores ofertados, na segunda fase, por cada PROPONENTE VENDEDOR que tiver sua(s) quantidade(s) de LOTES, total ou parcialmente atendida(s).

7.1.3. Na hipótese de um VENDEDOR realizar negócios relativos ao PRODUTO, a preços distintos, o preço de venda a ser considerado para efeito de celebração do CCEAR será o resultante da média ponderada dos LOTES ATENDIDOS nos respectivos negócios realizados.

7. 2. Atividades após o encerramento das negociações

7.2.1. Após o fechamento do LEILÃO, de forma a calcular a ENERGIA CONTRATADA, deverá ser executado o rateio pelo SISTEMA do PRODUTO para fins de celebração dos respectivos CCEARs entre cada VENDEDOR e todos os COMPRADORES na proporção dos LOTES ATENDIDOS e das QUANTIDADES DEMANDADAS, respectivamente.

7.2.2. O SISTEMA realizará o RATEIO, em MWh, com três casas decimais e considerando os seguintes critérios:

(1) multiplica-se a QUANTIDADE DEMANDADA por COMPRADOR, a QUANTIDADE TOTAL DEMANDADA e o total de LOTES ATENDIDOS pelo número de horas de um ano convencional e pelo número de horas de um ano bissexto.

(2) obtêm-se a representatividade do total de energia atendida em MWh (LOTES ATENDIDOS multiplicado pelo número de horas do ano) em relação a energia total demandada em MWh (QUANTIDADE TOTAL DEMANDADA multiplicado pelo número de horas do ano), para um ano convencional e para um ano bissexto.

(3) multiplica-se o resultado obtido em (2) pela energia demandada em MWh por cada COMPRADOR, para um ano convencional e para um ano bissexto;

(4) multiplica-se o resultado obtido em (3) pelo resultado da divisão da energia atendida em MWh por VENDEDOR sobre a energia atendida total em MWh, para um ano convencional e para um ano bissexto.

7.2.3. Os eventuais arredondamentos do rateio estabelecido no item 7.2.2, que se fizerem necessários serão alocados aos VENDEDORES ou COMPRADORES, conforme o caso, obedecendo a ordem da maior quantidade para a menor quantidade de LOTES negociados, no valor de 0,001.

7.2.4. Os valores da energia resultante do RATEIO constituem uma obrigação incondicional de celebração do respectivo CCEAR, entre cada um dos COMPRADORES e o VENDEDOR e, ao respectivo preço de fechamento.

7. 3. Declaração de SUBMERCADO

7.3.1. Após o encerramento do LEILÃO, no período a ser divulgado, conforme o item 3.2.1, o VENDEDOR que possuir ENERGIA HABILITADA em mais de um SUBMERCADO deverá indicar o percentual das quantidades de energia vendidas relativas a cada SUBMERCADO.

7.3.2. Após o encerramento do período para definição do SUBMERCADO, o SISTEMA aplicará os percentuais relativos a cada SUBMERCADO sobre da quantidade de energia resultante do RATEIO e determinará a ENERGIA CONTRATADA em cada SUBMERCADO.

7.3.3. Os preços de fechamento não serão modificados, permanecendo os mesmos obtidos ao término da segunda fase, conforme itens 7.1.2 e 7.1.3.

7.3.4. A ENTIDADE ORGANIZADORA divulgará o resultado do certame após o encerramento do LEILÃO.

Controle de Atualizações do Detalhamento da Sistemática

1. Alterações no Detalhamento da Sistemática, da versão publicada em 12/12/2006 em relação à versão publicada em 05/12/2006:

   - Item 5.5.2;

2. Alterações no Detalhamento da Sistemática, da versão publicada em 05/12/2006 em relação à versão publicada em 29/11/2006:

   - Definição XLII;
   - Definição XLIII;
   - Item 4.3.2;
   - Item 4.3.4;
   - Item 4.3.5;
   - Item 5.5.2;
   - Item 6.2.3;
   - Item 6.2.6; e
   - Item 6.2.7.