



Caminhos para a evolução da Segurança de Mercado

13º ENCONTRO ANUAL DO MERCADO LIVRE

ROSEANE SANTOS
Conselheira de Administração





Cenário do mercado de energia



Propostas de aprimoramentos de Segurança



Monitoramento CCEE – Indicadores Integrados



Considerações Finais

The background of the right side of the slide features a close-up of a spiral-bound calendar with a white cover and orange spine. A silver pen lies diagonally across the calendar. The word 'AGENDA' is printed in large, bold, black capital letters, oriented diagonally to match the pen's position.

AGENDA

CENÁRIO

12 MIL
agentes

26 MIL
Unidades consumidoras

0,45 MW
Carga das novas Ucs (out/21)

70 MIL

Unidades consumidoras do grupo A
com potencial de migração

11,3 MILHÕES

Unidades consumidoras do grupo B,
não incluindo os residenciais

59%

do consumo do País

32,4 BILHÕES

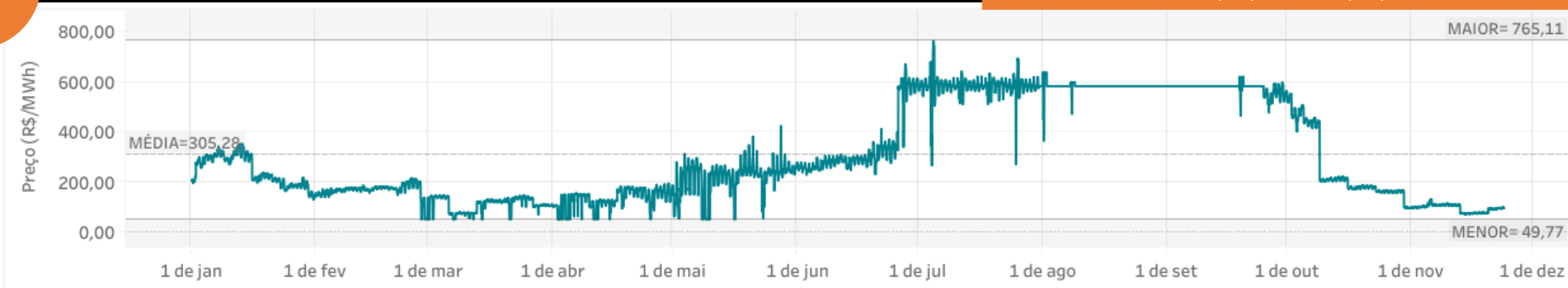
liquidados no Mercado de
Curto Prazo (jan a set/21)

84 MIL

Contratos registrados
na CCEE (set/21)

SE/CO

01/01/2021 a 23/11/2021



Análises

Preço Médio por Dia



1

Critérios de entrada,
manutenção e saída
do mercado

Consulta pública encerrada

Contribuições dos agentes
enviadas até 17/09

2

Metodologia de
Garantia Financeira
para o MVE

Consulta pública encerrada

Contribuições dos agentes
enviadas até 10/09

3.1

Evolução do
Monitoramento
(prudencial)

Aguardando consulta pública

Nota Técnica enviada à Aneel em 27/08

-  Exemplificação de condutas anômalas
-  Sugestões de sanção e gradações
-  Procedimento administrativo estruturado
-  Incentivos ao registro (duplo flag)
-  Governança da segurança de mercado
-  Soluções tecnológicas
-  Nova metodologia cálculo de risco

MONITORAMENTO PRUDENCIAL

INSPEÇÃO REGULATÓRIA

DIVULGAÇÃO AMPLA DE INFORMAÇÕES

REQUERIMENTOS MÍNIMOS DE CAPITAL

VISÃO CONCEITUAL



BLINDAGEM

estruturação de garantias para o MCP conforme mecanismo de distribuição de riscos, seguindo as melhores práticas do mercado financeiro e dos operadores de mercados internacionais



SUSTENTABILIDADE

exigência de garantias preservando a competitividade e liquidez do mercado



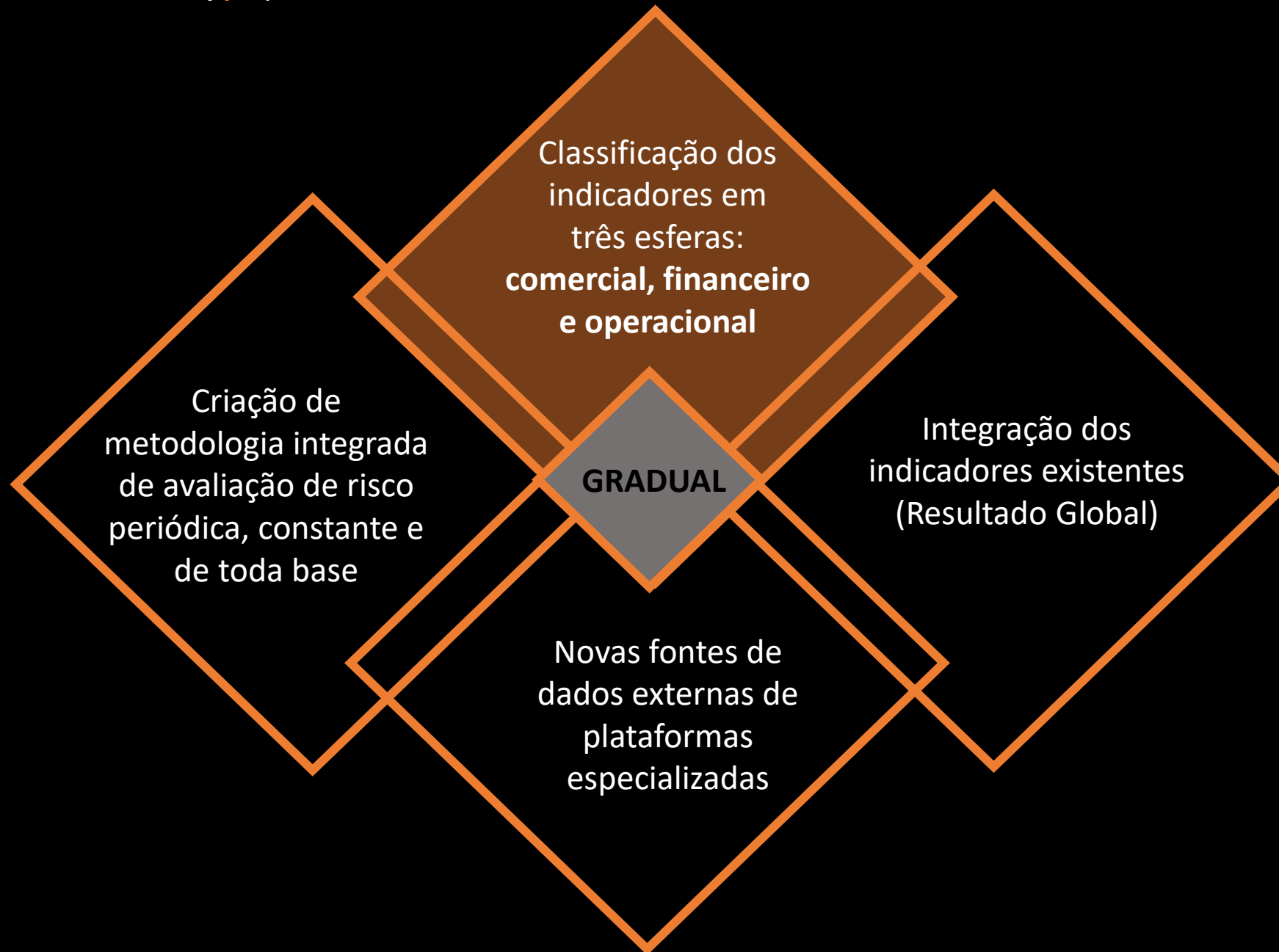
'DEFAULTERS PAY'

O causador de perdas é o primeiro a suportar as consequências por mecanismos de constituição de garantias e salvaguardas



MONITORAMENTO PRUDENCIAL

garantias sensíveis ao risco representado pelo agente



CLASSIFICAÇÃO DOS INDICADORES || Três pilares

COMERCIAL

 Métricas de Operação

 Appetite de Risco

 Risco Sistêmico

 Portfólio

 MVE

 BBCE



FINANCEIRO

 Análise de Crédito

 Auditoria

 Balanço Financeiro



OPERACIONAL

 Processos Judiciais

 Regularidade Fiscal

 Estrutura



CONSIDERAÇÕES FINAIS

2024

2023

2022

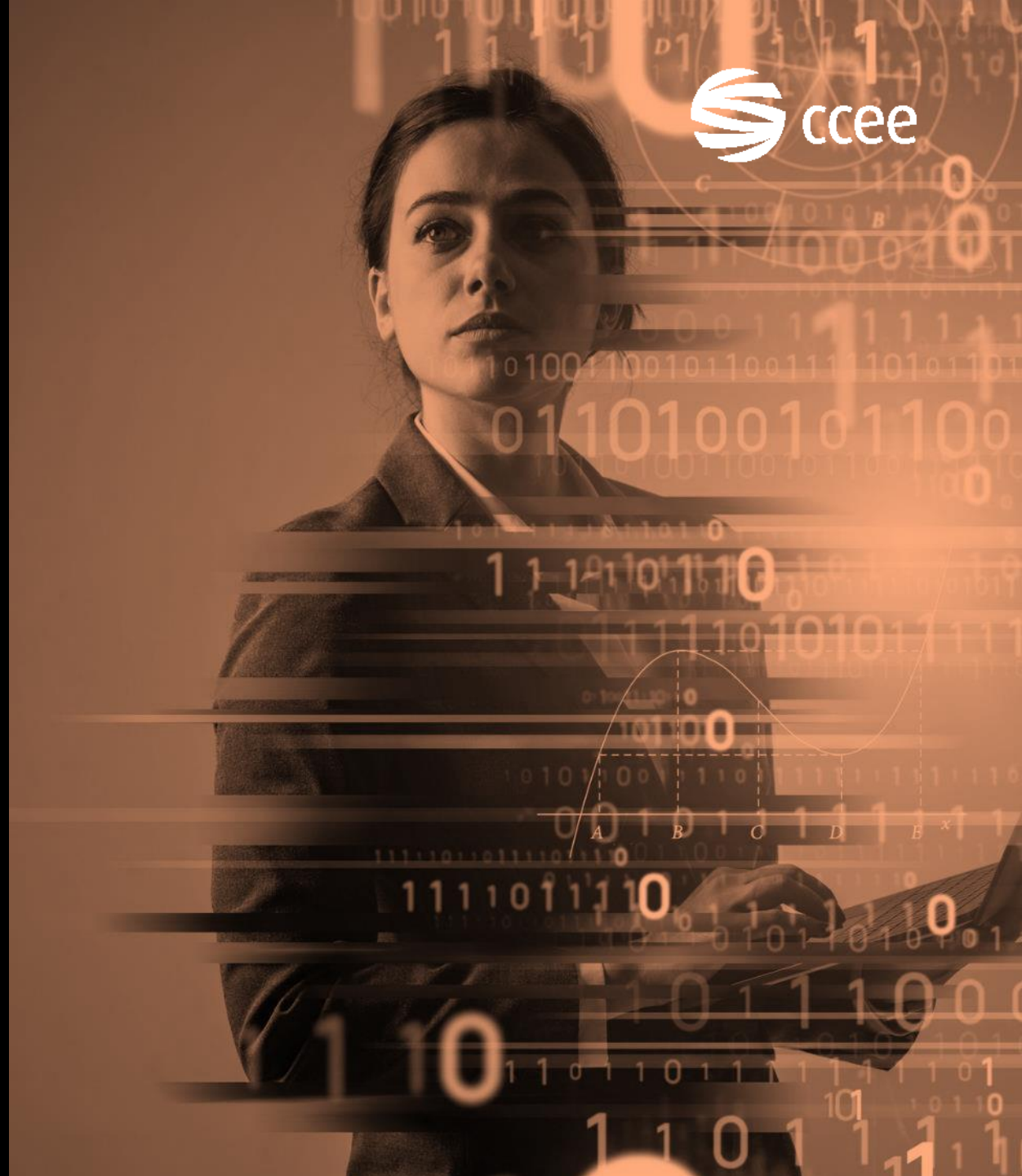
2021

2020

CONSIDERAÇÕES FINAIS



- ❗ Envio de nota técnica sobre garantias financeiras à Aneel até dezembro/21
- ❗ Expectativa da publicação das resoluções da Aneel a respeito das propostas no primeiro semestre de 2022
- ❗ Definição do período de transição para adequação dos agentes à nova dinâmica do mercado
- ❗ Desenvolvimento e implementação dos indicadores integrados de forma gradual ao longo de 2022



OBRIGADA!

ROSEANE SANTOS
Conselheira de Administração