

ENCONTRO CCEE

Segurança de Mercado

Painel 1: Apresentação das propostas
da Nota Técnica 3.1

Roseane Santos
Conselheira de Administração

16/03/2023

HISTÓRICO



Apresentação da proposta de chamada de margem semanal

MAI

2019

Lançamento da fase 2 dos Indicadores

JAN

2020

NT 55/2020
CCEE entrega proposta à Aneel sobre garantia financeira do MVE

JUL

NT 62/2020
Proposta para os critérios de participação no mercado

AGO

CCEE e BBCE firmam acordo para troca de conhecimento

JUN

2021

NT 6735/2021
Proposta de salvaguardas financeiras para o MCP

NOV

Início do processo de reestruturação interna

MAI

2022

Proposta ao mercado de manual algébrico para monitoramento prudencial

OUT

2023

JUL

Lançamento da fase 1 dos Indicadores de Segurança

JUL

CCEE retira a proposta da chamada de margem

AGO

Sponsor inicia roadshow nas associações

NOV

NT 86/2020
propostas de duplo flag, condutas atípicas e gradações de sanções, *stress test*

AGO

NT 4925/2021
Propõe evolução no monitoramento com os conceitos do prudencial

MAR

Novos critérios de participação e garantias do MVE

AGO

Implantação do SAS

JAN

Testes da plataforma de monitoramento prudencial com o mercado



REESTRUTURAÇÃO DA EQUIPE

Contratação de especialistas com experiência em avaliação de risco no mercado



IMPLANTAÇÃO S.A.S

Adoção de ferramenta para sistematização de dados, utilizada pelo mercado financeiro, B3, BBCE

Solução reconhecida internacionalmente



ARI – ANÁLISE DE RISCO INTEGRADA

Interpretação de dados e reunião com agentes para análise preventiva

93% dos agentes convidados enviaram voluntariamente o portfólio *(estabelecendo confiança e parceria)*

CP 11/22

Abr/22 a Mai/22

Primeira Fase

Fev/23 a Abr/23

Segunda Fase

Relator

Hélvio Guerra



Receita decorrente de **CONTRATAÇÕES** do mercado regulado (CCEAR-D, CER, CCGF, CCEN e de Itaipu).

EXPOSIÇÃO DAS 5 MAIORES CONTRAPARTES, de forma individual, considerando as próximas três contabilizações do MCP

TOTAL DE EXPOSIÇÃO, vendida ou comprada, por tipo de contrato (preço fixo, preço variável e derivativos) em MWmédios por submercado e por tipo de energia (M+0 a M+6)



Total de **RECURSO** em MWm, por tipo de contrato (preço fixo, preço variável e derivativos) aberto por meses para o horizonte de M+0 a M+6 e seu respectivo preço médio

Total de **REQUISITO** em MWm, por tipo de contrato (preço fixo, preço variável e derivativos) aberto por meses para o de M+0 a M+6 e seu respectivo preço médio

PATRIMÔNIO Líquido Ajustado



Informações criptografadas utilizadas no processamento do Fator de Alavancagem



O dados são recebidos e processados em **ambiente de computação confidencial**



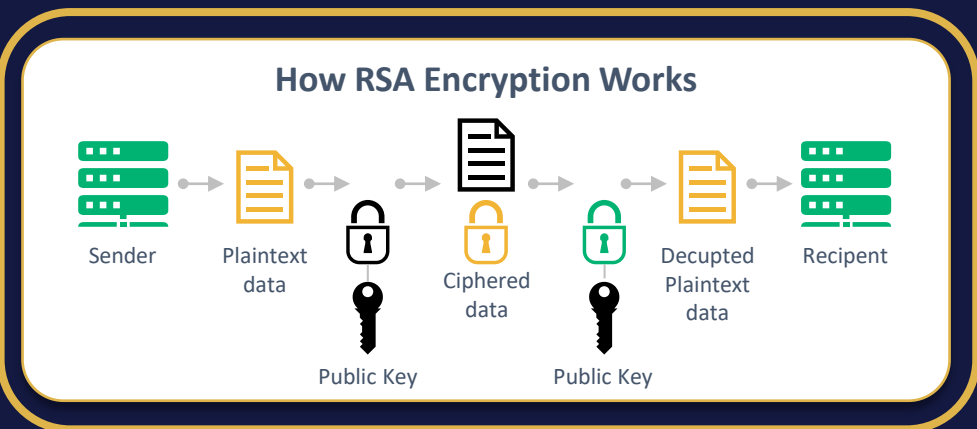
A CCEE não visualiza os **dados** e/ou **processamento** do FA



O time de monitoramento CCEE visualiza apenas o FA (**validado e enviado pelo Agente**) e *outros indicadores*



A exposição das 5 maiores contrapartes será utilizada para avaliação de risco de contágio. A CCEE está estruturando, neste momento, tal avaliação para encaminhamento à Aneel, conforme determina a NT nº 167/22



Dados confidenciais criptografados pelo cliente antes mesmo do envio à CCEE

Contratação de uma consultoria especializada para realização de *Pentest*

Processo de criptografia assimétrica RSA, com uso de chave pública e chave privada

Os dados criptografados são armazenados em banco de dados criptografado

Os dados são transmitidos através de canal criptografado de comunicação

Chaves são guardadas por um Módulo de Segurança em Hardware (HSM)



A criação da comissão de implementação com o objetivo de aproximar o mercado das novas práticas de monitoramento através de contribuições sobre a metodologia e validação dos sistemas



A avaliação constante dos resultados, sem aplicação de sanções, para validação dos parâmetros de cálculo



O envio obrigatório pelos agentes, para garantir que o período de teste seja realizado com abrangência e confiabilidade



O preenchimento em lote das informações no sistema de computação confidencial, conforme contribuição do mercado

Dialogando e remando
juntos, construiremos
o mercado do futuro!





OBRIGADA!

ROSEANE SANTOS