NORUS SUMMIT

Monitoramento Prudencial

Período Sombra

monitoramento prudencial – período sombra

- **MONITORAMENTO PRUDENCIAL – PERÍODO SOMBRA** teve início em novembro de 2023 e será realizado até publicação do normativo pela Aneel

- O monitoramento prudencial se mostrou **EFICAZ E PROPORCIONANDO AO MERCADO UMA FERRAMENTA DE VALOR,** que contribuiu significativamente para o aumento da transparência no ambiente de negociações e para a mitigação de riscos

- **COLABORAÇÃO DOS AGENTES** no envio das informações, que possibilitaram uma série de análises neste período

Indicadores e Capacitação

98%
de participação
dos agentes

626
Agentes verificados
- 532 verificação aleatória
- 92 prevenção

120
Reuniões com agentes
- 12 verificação aleatória
- 108 prevenção

9,6 mil
Atendimentos
- 4,5 mil ligações
- 5,1 mil e-mails

9h
Capacitação
- 6h em 5 Momentos Capacita
- 3h na trilha de conhecimento

verificação amostral aleatória e repescagem

Aumentar o percentual de convocações na
VERIFICAÇÃO AMOSTRAL ALEATÓRIA
de agentes declarantes de

10% → 15%

Flexibilidade para ajustar o percentual conforme a classe dos agentes, permitindo uma **ABORDAGEM MAIS PERSONALIZADA E EFICAZ**

REPESCAGEM

agentes com inconformidades serão convocados, após avaliação de risco, a enviar informações de nova declaração, assegurando a aplicação das correções solicitadas pela CCEE

principais aprendizados do período sombra

- MODELO VALIDADO NA PRÁTICA - Antecipação de riscos com maior granularidade; Atuação preventiva e tempestiva.

- ENGAJAMENTO - Diálogo técnico com agentes; Alto índice de participação

- NECESSIDADE DE APRIMORAMENTOS - Calibração dos parâmetros; Evoluções metodológicas

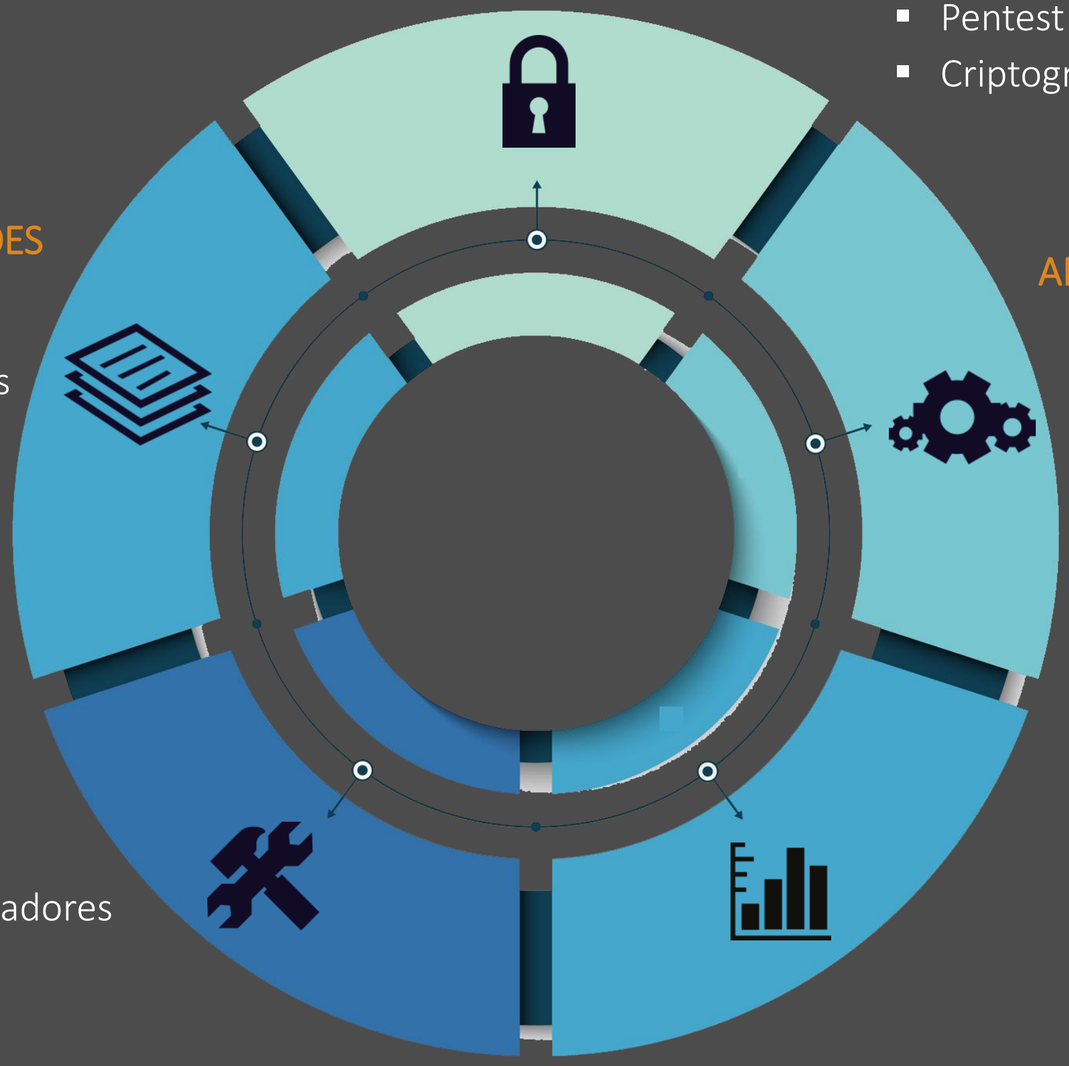
aprimoramentos

SEGURANÇA DE DADOS

- Pentest
- Criptografia

INDICADORES E INFORMAÇÕES

- Repescagem
- Demonstrações Financeiras



APRIMORAMENTO METODOLÓGICO

- Precificação de Geração
- Contrapartes Exposição
- Patrimônio Líquido Ajustado

SIMPLIFICAÇÃO

- Definição de participantes
- Divulgação do FA em site
- Classificação dos Comercializadores

EVOLUÇÃO INDICADORES DE RISCOS

- RWA crédito (Atacadista e Varejista)
- Parâmetros de Cálculos
- Horizonte de Declarações

participação dos agentes

Comercializadoras e Geradoras: seguem com a declaração completa
Distribuidoras: isenta da declaração, apenas apuração de Fator de Alavancagem pela CCEE

Consumidores: ~~declaração mensal~~

12.512 agentes

97,1%

Isenção de declaração para consumidores com demanda abaixo de **9MWm**

340 agentes

2,7%

Envio semestral para consumidores intermediários com demanda entre **9MWm e 80MWm**

30 agentes

0,2%

Envio mensal da declaração completa para consumidores com demanda **acima de 80 MWm**

Inadimplência: consumidores intermediários inadimplentes no MCP devem ser monitorados como maior porte por 12 meses.

declaração das contrapartes

Cálculo realizado pelo **AGENTE**
(informação com maior índice de erro)

horizonte de exposição de

3 meses
(M+0 a M+2)

análise de exposição para

5 maiores contrapartes

Cálculo automatizado no ambiente de
COMPUTAÇÃO CONFIDENCIAL
(CCEE seguirá sem saber quem são as contrapartes, apenas terá o montante da exposição)

horizonte de exposição de

7 meses
(M+0 a M+6)

análise de exposição para

100% todas contrapartes
de forma individual

risco de crédito

risco de crédito – RWA_CRED

No monitoramento atual, as parcelas de risco de crédito e risco operacional estão sendo definidas como zero, o que acaba por subestimar a real exposição ao risco dos agentes.

$$\text{Risco total} = \text{Risco de mercado} + \text{Risco de crédito} + \text{Risco operacional}$$

$$\text{Risco crédito} = \text{Risco de crédito contrapartes} + \text{Risco de crédito varejista}$$

A proposta da CCEE considera dois tratamentos distintos para **risco de crédito**:

1) Probabilidade de inadimplência das CONTRAPARTES
2) Risco de crédito para agente VAREJISTA

próximos passos

APRIMORAMENTOS E IMPLEMENTAÇÃO

- ✓ regra definitiva
- ✓ implementação
- ✓ aprimoramento constante de fluxos de informação e rotinas de análise
- ✓ diálogo contínuo com agentes para garantir transparência e alinhamento de expectativas

obrigada!