

Contribuição da ABRAGE à CP nº 111/21 do MME

Inicialmente a ABRAGE cumprimenta esse Ministério pela iniciativa de submeter à Consulta Pública tema de grande relevância para os agentes do setor elétrico nessa CP 111/21 (segunda fase da Consulta Pública Nº 109), com o objetivo de colher subsídios para o endereçamento do problema identificado no cálculo da FCF.

Ressaltamos a seriedade com que foi tratada a identificação e a publicação da informação a respeito do problema no cálculo da FCF em conjunto com o PARP(A), ainda que isso tenha ocorrido apenas após o encerramento da primeira fase da Consulta Pública nº 109/21.

É de conhecimento de todos que os resultados dos modelos não estiveram adequados à percepção de risco do ONS nos últimos anos. Até recentemente, não havia sido precificada a situação energética crítica pela qual o Sistema Interligado Nacional passa, o que torna claro para todos os *players* do setor que os modelos necessitam de ajustes, o que tem provocado um elevado despacho de térmicas fora da ordem de mérito. Nesse contexto, nenhuma etapa da cadeia de planejamento foi capaz de identificar e precificar a atual condição do Sistema.

Em contribuições anteriores, a ABRAGE elencou diversas oportunidades de melhoria na modelagem matemática do processo estocástico, onde acreditamos que reside em grande medida o problema metodológico da cadeia de modelos do setor. Nesse sentido, reiteramos que a participação das empresas no processo de tomada de decisão da CPAMP é fundamental.

Entre os pontos de melhoria, podemos elencar a utilização do Newave híbrido, o problema de reversão à média das séries geradas no Gevazp e a modelagem de maneira determinística de variáveis que são estocásticas como a carga, a geração das pequenas usinas e eólicas. Nesse sentido, o PARP(A) é uma iniciativa muito bem-vinda e consideramos uma grande perda a desistência de sua utilização em 2022.

O fato de os agentes não participarem ativamente da CPAMP impede que a percepção das empresas ajude a contribuir com a formulação das pautas da comissão.

Com relação ao endereçamento da não utilização do PARP(A) e da recalibração dos parâmetros de aversão ao risco, a ABRAGE já havia chamado atenção para a inadequada utilização de α e λ como variáveis de folga a serem calibradas de maneira a compensar algum viés indesejado introduzido nos modelos por variáveis cuja modelagem matemática é simplificada.

Neste sentido, ressaltamos a importância de uma governança bem definida que conte com uma metodologia consistente de definição dos valores de α e λ e demais variáveis sensíveis como a taxa de desconto, e ainda com cronograma que comporte as necessidades dos desenvolvedores e dos demais participantes dos fóruns que avaliam e validam as novas implementações aos modelos.

Com relação à recomendação dos parâmetros de aversão ao risco, o relatório apresentado não demonstrou de forma contundente que os parâmetros recomendados são de fato a melhor opção, visto que, apesar de explorar um maior número de possibilidades, não utilizou uma metodologia que abarcasse grande parte dos possíveis impactos da adoção da recomendação. Por exemplo, o período simulado, como diz o próprio relatório, é um período de hidrologia desfavorável, o que pode introduzir algum tipo de viés. Seria importante a avaliação também em períodos com hidrologia favorável e hidrologia normal, isto é, nem favorável e nem desfavorável.

Dessa maneira, não foi possível construir um consenso a respeito dos valores a serem utilizados nos parâmetros de aversão ao risco.