



7. GRUPOS DE TRABALHO E COMITÊS TÉCNICOS

Secretaria Executiva do CNPE



Comissão Permanente para Análise de Metodologias e Programas Computacionais – CPAMP

Resolução CNPE nº 3/2013

Brasília, 17 de dezembro de 2013



O Histórico

- Em 2008, o Ministério de Minas e Energia, em cumprimento à determinação do Conselho Nacional de Política Energética - CNPE, instituiu a Comissão Permanente para Análise de Metodologias e Programas Computacionais do Setor Elétrico – CPAMP, composta por representantes das seguintes entidades:
 - Ministério de Minas e Energia – MME;
 - Agência Nacional de Energia Elétrica – ANEEL;
 - Empresa de Pesquisa Energética – EPE;
 - Operador Nacional do Sistema Elétrico – ONS;
 - Câmara de Comercialização de Energia Elétrica – CCEE; e
 - Centro de Pesquisas de Energia Elétrica – CEPEL.
- Desde 2009, a CPAMP realizou estudos e discussões sobre a internalização dos mecanismos de aversão a risco nos modelos computacionais utilizados no planejamento, operação e comercialização do setor elétrico.
- Esses estudos resultaram na publicação da Resolução CNPE nº 3, de 6 de março de 2013.



A Resolução CNPE nº 3/2013

- A Resolução CNPE nº 3/2013 determinou que a CPAMP desenvolvesse e implementasse metodologia para a incorporação de mecanismos de aversão a risco internamente aos programas computacionais de estudos energéticos e de formação de preço.
- Nesse sentido, o CEPEL em cumprimento ao disposto no §1º, art. 1º da resolução, disponibilizou, tempestivamente, em 31 de maio, à CPAMP a nova versão do Programa NEWAVE. O CEPEL também promoveu adaptações no Programa DECOMP.
- Na versão do NEWAVE, foram internalizadas duas metodologias de aversão a risco: “Superfície de Aversão a Risco – SAR” e “Valor Condicionado a um dado Risco – CVaR”.
- A CPAMP, em cumprimento ao §2º, art. 1º da resolução, realizou, antes do prazo previsto, os testes de validação das metodologias, concluindo que o mecanismo de aversão a risco que apresentou o melhor resultado entre o aumento da segurança e os impactos nos custos do sistema e que, conseqüentemente, deveria ser adotado era o CVaR.
- A CPAMP, buscando divulgar a metodologia escolhida, realizou, no dia 24 de julho de 2013, um workshop, com a participação de diversos agentes do setor.



A Resolução CNPE nº 3/2013

- A ANEEL, em cumprimento ao disposto no §3º, art. 1º da resolução, por meio do Despacho nº 2.978/2013, aprovou o uso das novas versões dos programas NEWAVE e DECOMP, com internalização do CVaR, pelo ONS e pela CCEE, a partir do Programa Mensal da Operação Eletroenergética – PMO do mês de setembro de 2013.
- Em outubro, finalizando o processo de internalização de mecanismos de aversão a risco nos programas computacionais, a CPAMP emitiu o relatório com os testes de validação da metodologia CVaR no DECOMP.
- A ANEEL, por meio do Despacho nº 4025/2013, aprovou a utilização do DECOMP CVaR a partir do PMO de dezembro de 2013.



Os Benefícios Resolução CNPE nº 3/2013

- Com a internalização da metodologia de aversão a risco CVaR nos programas NEWAVE e DECOMP:
 - haverá um aumento da segurança energética e uma sinalização econômica mais realista com relação à formação do preço de liquidação no mercado de curto prazo, além de maior coerência entre as atividades de planejamento e operação; e
 - o despacho de usinas termelétricas acionadas fora da ordem de mérito será reduzido a eventos muito raros e, conseqüentemente, o custo adicional com esse despacho será muito baixo.