

FAQ do Monitoramento Prudencial: verificação mensal com amostragem aleatória

Versão 2.0.
05/07/2024.

Sumário

1. Objetivo	3
2. Principais Questionamentos	3
2.1. Introdução	3
2.2. Amostragem e Convocação	4
2.3. Envio de Informações e Análises Realizadas	5
2.4. Resultado das Análises	8
2.5. Sanções	9

1. Objetivo

O presente documento tem por objetivo agrupar os principais questionamentos dos agentes relacionados à verificação mensal das informações encaminhadas no âmbito do Monitoramento Prudencial. O conteúdo também estará disponível no site da Câmara de Comercialização de Energia Elétrica - CCEE para consulta (<https://www.ccee.org.br/ajuda/faq>), e será atualizado durante o período sombra estipulado pela ANEEL, conforme art. 135-A da Resolução Normativa ANEEL – REN nº 957/2021.

2. Principais Questionamentos

2.1. Introdução

2.1.1. Qual a previsão regulatória para a verificação mensal com amostragem aleatória das informações encaminhadas no âmbito do Monitoramento Prudencial?

A REN nº 957/2021, publicada em 07 de dezembro de 2021, alterada pela REN nº 1.072/2023, publicada em 06 de setembro de 2023, determina o período sombra a partir de 1º de novembro de 2023¹. Em seu art. 135-D determina que, durante o período sombra, a CCEE iniciará a verificação mensal das informações encaminhadas no âmbito do Monitoramento Prudencial de até 10% dos agentes, escolhidos aleatoriamente por classe de agente (com tratamento diferenciado à classe dos consumidores, detalhada no tópico de Amostragem desse material).

Nesse período, é obrigatório o envio de informações, conforme art. 135-B, e os agentes que não encaminharem as informações conforme o disposto nesta Resolução, inclusive para cumprimento do disposto no art. 135-D, estarão sujeitos ao disposto nos incisos XIII e XIV do art. 17 da REN nº 957/2021, sem prejuízo de demais penalidades eventualmente aplicáveis.

2.1.2. Qual o objetivo do processo de verificação mensal com amostragem aleatória das informações encaminhadas no âmbito do Monitoramento Prudencial?

Durante o período sombra do monitoramento prudencial a CCEE realizará a verificação mensal com o objetivo de avaliar a conformidade dos dados declarados no sistema de

¹ Para maiores informações, a CCEE publicou em seu site um guia interativo sobre o tema. Acesse: <https://www.ccee.org.br/en/-/co-monitoramento-prudencial-tudo-o-que-voce-precisa-saber-para-operar>

monitoramento prudencial com os parâmetros requisitados pela REN nº 957/2021 e pelo Manual do Monitoramento Prudencial, além de outras orientações da CCEE.

É importante ressaltar que o processo de verificação aleatória adotado pela CCEE se baseia em uma abordagem orientativa e imparcial, visando não apenas garantir a conformidade regulatória, mas também promover uma cultura de transparência, integridade e colaboração entre todos os agentes envolvidos.

2.1.3. Qual a previsão de início da verificação mensal das informações?

A CCEE iniciará a verificação mensal das informações encaminhadas em dezembro/2023, considerando as informações declaradas ao longo do primeiro mês de operação do mecanismo.

Os pedidos de informações aos agentes serão realizados mensalmente, considerando as declarações pretéritas efetuadas durante todo o período sombra.

2.2. Amostragem e Convocação

2.2.1. Como será realizada a escolha dos agentes participantes?

Conforme comando da regulação (§ 1º, art. 135-D, da REN nº 957/2021), durante o período sombra, a CCEE iniciará a verificação mensal das informações encaminhadas no âmbito do Monitoramento Prudencial de até 10% dos agentes, escolhidos aleatoriamente por classe de agente. No caso dos consumidores livres e especiais, a verificação se dará para: (i) 10% dos agentes que possuem maior montante comercializado, até a representação de 80% do total comercializado por consumidores livres e especiais; e (ii) 1% dos agentes que possuem menor montante comercializado, que representam os demais 20% do total comercializado por consumidores livres e especiais.

A realização do sorteio, de forma aleatória, será feita por *software* de análise de dados, em que será armazenado o log de execução das instruções ao *software*, de modo a garantir a transparência, auditabilidade e reperformance dos resultados, além de realizar a revisão desde o processo amostral, dos requerimentos regulatórios e testes por ventura necessários.

Os agentes, quando sorteados no processo de amostragem, serão notificados para o envio das informações à CCEE.

Os agentes deverão encaminhar as informações acerca das apurações do fator de alavancagem e informações declaradas, com o objetivo de validar as premissas utilizadas e os conceitos aplicados, de modo que a CCEE possa replicar os cálculos realizados.

2.2.2. Como se dará a comunicação aos agentes sorteados?

O agente receberá a comunicação, via e-mail específico do monitoramento (monitoramento@ccee.org.br), com o pedido de informações para verificação mensal com amostragem aleatória no âmbito do Monitoramento Prudencial, endereçada diretamente aos contatos cadastrados como representantes legais, CCEE ou de Monitoramento e, em caso de cadastro de representação operacional, aos contatos cadastrados de representantes CCEE, em razão da natureza confidencial das tratativas.

A CCEE reforça que todos os agentes devem manter seus cadastros atualizados. A medida é importante para que a Câmara entre em contato com o profissional mais adequado, uma vez que poderá tratar de dados operacionais e financeiros sensíveis junto aos associados.

2.3. Envio de Informações e Análises Realizadas

2.3.1. Qual o prazo do agente para envio das informações e/ou documentação solicitadas pela CCEE?

As informações solicitadas no âmbito do monitoramento prudencial aleatório deverão ser apresentadas pelo agente no prazo de 5 (cinco) dias úteis a contar do recebimento do e-mail de pedido de informações.

2.3.2. Qual a referência do Fator de Alavancagem que será solicitada para análise do monitoramento?

Será comunicado ao agente, quando solicitadas as informações para verificação mensal, qual a apuração do Fator de Alavancagem que será objeto de análise (mês e/ou semana da declaração).

Conforme REN nº 957/2021, os agentes deverão manter registro das informações que foram utilizadas como base para as declarações realizadas no Monitoramento Prudencial, passíveis de solicitação pela CCEE durante o processo de verificação das informações. Assim, a análise poderá ocorrer para qualquer declaração realizada durante o período sombra, não existindo restrição temporal para essa análise.

2.3.3. Quais são os documentos que o agente deverá encaminhar à CCEE?

A CCEE irá solicitar as informações necessárias para validação e reprodução do cálculo do fator de alavancagem do agente, para uma declaração específica a ser indicada na comunicação. Apresentamos a seguir as principais informações que poderão ser solicitadas e analisadas pela CCEE:

- i. Previsão de Consumo com racional e/ou considerações utilizadas para a definição dos dados;
- ii. Previsões da Geração com racional e/ou considerações utilizadas para a definição dos dados;
- iii. Relação das contratações do ambiente livre e regulado, consideradas em sua declaração (serão solicitadas, amostralmente, as comprovações das negociações indicadas);
- iv. Patrimônio Líquido e identificação das possíveis deduções aplicadas, bem como documentação utilizada como referência;
- v. Resultado do cálculo das exposições com as 5 (cinco) maiores contrapartes, com racional e/ou considerações utilizadas para a definição dos dados;
- vi. Arquivo de *upload* utilizado pelo agente em sua declaração, para que se possa replicar o cálculo do fator de alavancagem.

Ao comunicar o agente de sua participação na verificação mensal, a CCEE indicará as informações necessárias a serem encaminhadas, bem como modelo de preenchimento, se cabível. A depender das operações que o agente apresentar, e das informações declaradas no monitoramento prudencial, a CCEE poderá solicitar outras informações que forem necessárias para a validação e reprodutibilidade do cálculo.

2.3.4. Como o agente deverá encaminhar as informações solicitadas? Como a CCEE vai garantir a segurança das informações?

O encaminhamento dos arquivos se dará por meio de plataforma tecnológica protegida em nuvem, criptografada, com visualização restrita apenas aos profissionais da CCEE envolvidos na verificação mensal. Os acessos serão controlados, para garantir a rastreabilidade das operações, e o armazenamento das informações nesse ambiente será limitado a até 5 (cinco) dias, sendo automaticamente expurgado após esse período.

O acesso será autorizado inicialmente aos contatos do agente comunicados no e-mail de convocação, conforme detalhamento apresentado no item 2.2.2. Para a permissão de acesso a outras pessoas, não autorizadas inicialmente, o agente deverá encaminhar solicitação para monitoramento@ccee.org.br, listando os contatos adicionais (informar nome e e-mail). Este pedido deve ser realizado pelos contatos do agente cadastrados como representantes Legais, CCEE ou de Monitoramento e, em caso de cadastro de representação operacional, pelos contatos cadastros como representantes CCEE.

As permissões de acesso possuem prazo limitado e, a depender do tempo demandado pelo processo, podem expirar antes de sua conclusão. Caso a permissão de acesso expire, o agente deverá solicitar renovação do acesso através do e-mail de monitoramento.

2.3.5. Quais as análises realizadas pela CCEE a partir das informações disponibilizadas?

De forma geral, a CCEE realiza a análise das informações declaradas em 3 (três) etapas, considerando a aplicação de uma metodologia de análise reversa:

- i. Inicialmente realiza-se a reprodução do cálculo do fator de alavancagem e fator de alavancagem de risco, para o evento indicado ao agente no momento da convocação, para garantir a correta referência das informações. Para isso, são solicitadas as informações no formato de declaração do sistema de monitoramento prudencial (Excel ou json);
- ii. Em sequência, avalia-se a consolidação das informações para o arquivo de declaração do sistema de monitoramento prudencial, considerando as declarações do agente das previsões de consumo, geração, contratos do ambiente livre e regulado, patrimônio líquido ajustado, além do cálculo das exposições com as 5 (cinco) maiores contrapartes realizado;
- iii. Por fim, avaliam-se as metodologias de estimativa aplicadas, bem como comparação das previsões com relação aos resultados históricos. Nessa etapa também será solicitada a comprovação das contratações bilaterais declaradas, amostralmente, para que sejam validadas as informações de vigência, preço, montante, tipo de energia, contraparte etc.

Durante esse processo, a depender do modelo de operação e dos tipos de contratações que o agente apresenta, a CCEE poderá solicitar esclarecimentos e outras informações que permitam garantir o objetivo da verificação mensal do monitoramento prudencial.

2.3.6. Caso seja verificado um erro de declaração ao disponibilizar as informações para a CCEE, como proceder? Devem ser enviados os dados preenchidos à época, ou os dados corrigidos?

Nessas condições orienta-se ao agente que (i) encaminhe as informações declaradas à época, mesmo que identificada uma inconsistência, para permitir a reprodutibilidade do fator de alavancagem e (ii) indique, nos campos de observação do arquivo modelo de declaração disponibilizado, ou em arquivo complementar, as inconsistências verificadas e os corretos valores que deveriam ter sido declarados.

2.3.7. A CCEE poderá solicitar as formalizações dos contratos bilaterais, ainda que exista(m) cláusula(s) de confidencialidade?

Em relação ao envio de amostragem de contratos no âmbito do monitoramento, que possam conter cláusula(s) de confidencialidade, esclarecemos que:

- i. A apresentação do contrato decorre de obrigação regulatória, não cabendo a alegação da existência de cláusula de confidencialidade bilateral para a sua não entrega;
- ii. De acordo com o art. 56, parágrafo único, do Decreto nº 5.163/2004, e com o art. 8º, § 2º, da REN nº 957/2021, a CCEE poderá exigir a comprovação da existência e validade dos contratos de compra e venda de energia elétrica firmados pelos agentes, seja no ACR ou no ACL;
- iii. No âmbito das atividades do Monitoramento Prudencial, a regulação vigente (em especial, o art. 135-B, § 2º, da REN nº 957/2021 e o item 2.3 do Manual do Monitoramento Prudencial), prevê que todos os agentes devem manter registro das informações utilizadas como base para as declarações no Monitoramento Prudencial, sendo que, para a realização de suas análises, a CCEE poderá solicitar o envio de informações e esclarecimentos adicionais aos agentes.

Deste modo, não há óbices ao envio das informações e/ou dos documentos solicitados no âmbito do Monitoramento Prudencial em razão de cláusula(s) de confidencialidade em contratos.

2.3.8. Será possível um NDA com a CCEE para garantia da confidencialidade dos dados?

A assinatura de Acordo de Confidencialidade não é aplicável à CCEE, tendo em vista que: (i) o envio das informações demandadas no âmbito das atividades de monitoramento prudencial decorre de obrigação legal e regulatória; e (ii) que a CCEE deve dar tratamento confidencial e sigiloso ao conteúdo de todos os documentos recebidos e informações prestadas pelos agentes, como se identifica da regulação vigente, em especial o item 3.7 do Submódulo 1.7 dos Procedimentos de Comercialização - PdC.

2.4. Resultado das Análises

2.4.1. Como a CCEE comunicará aos agentes o resultado das análises das informações solicitadas por meio da verificação mensal?

A CCEE emitirá um parecer e encaminhará por meio do e-mail do monitoramento (monitoramento@ccee.org.br) informando ao agente o resultado de sua análise. O agente será comunicado da (i) validação e aprovação dos documentos encaminhados no âmbito do monitoramento prudencial, e (ii) será orientado de possíveis adequações em suas declarações futuras, que poderão ser acompanhadas pela CCEE para garantir a correta participação no mecanismo. De modo a garantir a confidencialidade, os participantes e os resultados da verificação mensal serão restritas aos participantes do processo.

2.4.2. *O parecer da minha participação na verificação mensal indicou uma ressalva, com orientações para a correta declaração. Devo realizar alguma correção para as declarações já realizadas?*

Informamos que, atualmente, não existe processo de reapuração dos fatores de alavancagem já calculados e divulgados. Assim, o agente deverá adequar suas informações para as declarações subsequentes ao recebimento do parecer, considerando as não conformidades apontadas e as devidas orientações para sua correção.

2.5. Sanções

2.5.1. *O que acontecerá quando o agente não encaminhar as informações requisitadas?*

O não envio das informações para os fins do monitoramento prudencial no âmbito do processo de verificação mensal, conforme deliberação 0408 da Reunião do Conselho de Administração da CCEE nº 1390ª, realizada em 15/04/2024, e os arts. 17, XIII, 135-B, 135-C e 135-D, da REN nº 957/2021, sujeitará o agente com o descumprimento ao que segue: (i) impedimento automático de novos registros de contratos no Sistema de Contabilização e Liquidação - SCL; (ii) novos registros, ajustes e validações de operações de compra e venda de energia elétrica dos agentes enquadrados no item “i” somente poderão ser realizados de forma balanceada, com a prévia verificação do balanço energético a fim de evitar exposição financeira negativa, com base especialmente no art. 114, da REN nº 957/2021, e mediante solicitação do agente, nos termos do Procedimento de Comercialização, Módulo 1, Submódulo 1.4 – Entradas de Dados por Contingência; e (iii) as condições dos itens “i” e “ii” perdurarão até a confirmação da adimplência, mediante o envio pelo agente das informações solicitadas no âmbito da Verificação Mensal Aleatória.

Ocorrendo o impedimento de registro de novos contratos no SCL de agentes inadimplentes quanto à obrigação de envio das informações no âmbito da verificação mensal, a operação de registro de contrato ocorre em modo balanceado, isto é, quaisquer ações devem ser solicitadas para a CCEE, conforme Submódulo 1.4 – Atendimento, do PdC, que irá avaliar a possibilidade de aprovação ou não do seu pedido. Apenas serão aceitos pedidos que não gerem uma exposição financeira negativa em seu balanço energético, semelhante ao aplicado aos agentes com procedimento de desligamento com descumprimento não regularizado (§ 1º, do art. 51, da REN nº 957/2021).