

Regras comerciais para o máximo acoplamento entre formação de preço e operação

Considerações iniciais

É importante reforçar de antemão o quão importante é a iniciativa do MME e EPE em dar continuidade ao diálogo no tema da aproximação entre os processos de formação de preços e de definição da operação do sistema elétrico. Trata-se de um tema central, que repercute nas diversas esferas de planejamento das entidades setoriais, na definição de soluções e políticas públicas, e dos agentes, na determinação de estratégias individuais e rotas de investimento e atuação no setor.

Observa-se que desde a instalação do Comitê de Revitalização do Setor Elétrico, em 2001, o tema da credibilidade na formação do preço da energia foi motivo de tensão entre órgãos planejadores e agentes. Este conflito é particularmente mais intenso em momentos de reversão de expectativas e quando a atribuição das responsabilidades individuais e cumprimento dos compromissos contratuais dos agentes são ditados pela precificação sob gerência de um agente externo, parafraseando conclusões do Relatório de Progresso nº 2 deste mesmo comitê, publicado em fevereiro de 2002.

De certa forma, a determinação dos preços por meio de um órgão centralizador faz com que todos os agentes participantes do mercado se comportem como *price-takers*, condição cujo embasamento teórico pressupõe as seguintes características básicas:

- (i) competição perfeita;
- (ii) baixa capacidade individual de influência na precificação;
- (iii) homogeneidade do produto ofertado;
- (iv) reduzidas barreiras para participação no mercado;
- (v) informação completa e transversal a todos os participantes do mercado.

Dentre os atributos aplicáveis à discussão nota-se que a dificuldade de aceitação dos mecanismos de formação de preços no Brasil, no sentido de reconhecimento formal da conformidade da cadeia processual, recai especificamente no questionamento aos itens (ii) baixa capacidade individual de influência na precificação e (v) informação completa e transversal entre todos os participantes do mercado.

Não obstante os esforços despendidos na ampliação da transparência dos processos atuais, ainda há uma percepção dos agentes de que parte sensível dos dados de entrada está sob a prerrogativa individual de cada um e podem efetivamente influenciar o resultado final das simulações com os modelos energéticos, como por exemplo alterações na disponibilidade e inflexibilidade declarada para usinas térmicas, alterações na disponibilidade e restrições operativas de usinas hidráulicas, determinação da curva de carga da ANDE, entre outros.

Acredita-se que um dos principais fatores que corroboram com a continuidade desta percepção reside na ingerência e imprevisibilidade destas informações dispersas entre agentes. Uma solução seria exigir dos próprios agentes declarações públicas e antecipadas destes conjuntos de dados de entrada, com devido período de carência, para fins de cálculo do PLD. Desta forma os valores dos parâmetros formadores de preço sob prerrogativa dos próprios agentes seriam de total conhecimento de todos com suficiente antecedência para assegurar maior previsibilidade à precificação. O procedimento vigente permaneceria válido para fins de determinação da operação ótima e do CMO, com a utilização da melhor informação disponível semanalmente durante cada revisão do PMO.

A proposta direciona para um relativo distanciamento entre a otimização da operação e a precificação da energia, mas vai ao encontro da compilação de contribuições da Consulta Pública MME 02/2016, quando se formou um consenso da necessidade de uma carência mínima para que mudanças nos modelos energéticos de precificação sejam promovidas. Ademais, a publicidade e antecipação da declaração dos conjuntos de dados de entrada sob prerrogativa dos agentes satisfaria também o atributo (v), que trata da transversalidade da informação disponível ao mercado. Desse modo, possibilita-se que as melhores informações sejam utilizadas para fins de operação e se garante a estabilidade necessária para a formação de preço no mercado.

Compromisso de utilização de preços com intervalo máximo horário até 2020

Entende-se que a implementação de preços por modelagem centralizada com intervalo temporal máximo horário e sem o devido cuidado aos atributos (ii) baixa capacidade individual de influência na precificação e (v) informação completa e transversal entre todos os participantes do mercado, não conferirá maior credibilidade ao processo de formação de preços.

Não há dúvidas de que o uso de modelos em base temporal mais discretizada traria um acoplamento mais forte entre planejamento, operação e precificação. Mas as condições para a credibilidade e aceitação dos resultados pelos agentes *price-takers* dependem da publicidade, transparência e transversalidade das informações utilizadas nestas simulações. A implementação sem a devida atenção a estes critérios só acrescentaria mais uma camada de complexidade e de questionamentos sobre o procedimento de formação de preços.

Para que seja possível o atendimento das condições supracitadas em consonância com a aplicação do modelo em base horária será necessária agilização de grande parte dos processos de disponibilização das informações diárias, horárias e em tempo real por parte do ONS e CCEE. Investimentos em redes de monitoramento e comunicação também serão imprescindíveis. Tais despesas hoje não figuram como parte do orçamento das instituições e não há um mecanismo de recolhimento específico previsto para sua viabilização. Visto que as informações disponibilizadas teriam carácter público, é justo que toda a sociedade contribua para a sua realização; sugere-se em prol do carácter social destes investimentos que as empresas possam direcionar os recursos de P&D para tal fim.

Abertura de códigos e algoritmos de ferramentas computacionais de suporte à formação de preço, ao planejamento e à operação

A dificuldade de acesso aos códigos-fonte e aos algoritmos implementados nos modelos energéticos, associada ao seu alto grau de complexidade técnica e reduzido material explicativo foi certamente um forte empecilho para a promoção da credibilidade dos procedimentos de formação de preço e planejamento no setor elétrico brasileiro. A publicidade dos códigos é um fator importante para a transparência dos procedimentos, mas vale lembrar que sua implementação isolada não será suficiente para sanar todos os questionamentos por parte dos agentes referentes ao atributo (v) informação completa e transversal entre todos os participantes do mercado.

Síntese de recomendações

- Acredita-se que baixa capacidade individual de influência na precificação e transversalidade da informação completa entre todos os agentes de mercado são as condições básicas para a credibilidade da formação de preços por modelo centralizado no setor elétrico brasileiro;

- Aprova-se a abertura de códigos e algoritmos de ferramentas computacionais de suporte à formação de preço, ao planejamento e à operação;
- Aprova-se a implementação de modelos de preços com intervalo máximo horário até 2020 desde que respeitadas as condições básicas para a credibilidade supracitadas;
- Sugere-se que a implementação de um cronograma antecipado de declaração do conjunto de dados de entrada aos modelos energéticos sob prerrogativa dos agentes, como disponibilidades, inflexibilidades, restrições, entre outros; para fins de publicação do preço. Para fins de otimização da operação e cálculo do CMO permanece o procedimento vigente de uso da melhor informação;
- Sugere-se que os agentes possam direcionar recursos destinados a P&D à aquisição de equipamentos de monitoramento e comunicação necessários para a agilização das informações públicas a serem disponibilizadas em caráter diário, horário e em tempo real para fins de implementação com sucesso de modelos de precificação com maior discretização temporal.