

DEFINIÇÕES DE PARÂMETROS DE NEGOCIAÇÃO EM OPERAÇÕES DE SWAP E PRECIFICAÇÃO DE CONTRATOS CONTENDO CLÁUSULA DE FLEXIBILIDADE COM SUPORTE DE MODELO DE OTIMIZAÇÃO ESTOCÁSTICA E ANÁLISE DE RISCO VERSUS RETORNO

GCR

Luiz Armando Steinle Camargo

Dorel Soares Ramos

Ewerton Guarnier

Matheus Balan

Parâmetros Usina/Modelo	Cenários de Geração	Cenários de PLD	Contratos Existente	Contratos Candidatos
-------------------------	---------------------	-----------------	---------------------	----------------------

- Xpress

- Regras de Contabilização no MCP
- Regras de Contabilização Contratual
- *Maximização da Função Objetivo*
- Restrição ao Risco: CVaR
- *Variáveis de Decisão para Alocação*

Txt/Excel

- Expectativa de Receita e CVaR
- Volume Ótimo Alocado em Contratos
- Composição Ótima da Carteira

O Modelo conceitual foi customizado de acordo com os objetivos específicos deste trabalho.

4º passo: Precificação

Agradecimentos:



Projeto de P&D “Metodologia e ferramental para previsão de energias afluentes e precificação de contratos aplicados à definição de estratégia ótima de contratação para empresas geradoras, incluindo energia existente e novos empreendimentos”; código ANEEL PD-0061-0017/2011; CESP, USP, MRTS.

Luiz Armando Steinle Camargo, Eng. Dr.



(11) 9 9486-7723



luiz@mrticonsultoria.com



www.mrticonsultoria.com

