



T0981

### **IDENTIFICAÇÃO DE PARÂMETROS DE PRECIFICAÇÃO E RISCO PARA CONTRATOS DE ENERGIA ELÉTRICA**

Thaís Barbosa dos Santos (Bolsista PIBIC/CNPq), MSc. Leticia Takahashi e Prof. Dr. Paulo de Barros Correia (Orientador), Faculdade de Engenharia Mecânica - FEM, UNICAMP

Este trabalho tem por objetivo realizar pesquisas que dêem suporte aos processos de negociação de contratos de energia elétrica. As estratégias de negociação de contratos eficientes a serem avaliadas nos diversos ramos de mercados possíveis são realizadas por meio de leilões, contratos bilaterais, entre outros. Os agentes do setor elétrico estão interessados em ferramentas que permitam a busca da eficiência em seus contratos, ou seja, maximizar lucro e gerenciar o risco. Desta forma, neste trabalho, pretende-se estudar os métodos de mensuração de risco, tais como a teoria do portfólio. Os principais materiais utilizados foram livros, periódicos artigos publicados em congressos e internet. Como o projeto foi elaborado em conjunto com outros iniciandos, mestrandos e doutorandos, alguns conhecimentos são compartilhados por meio de aulas e seminários.

Mercado de energia - Contratos de energia elétrica - Teoria do portfólio