



E301

GERAÇÃO DE CENÁRIOS USANDO ALGORITMO DE AGRUPAMENTO PARA GESTÃO DE RISCOS NA COMERCIALIZAÇÃO DE ENERGIA ELÉTRICA

Elton Mário de Lima (Bolsista FAPESP) e Profa. Dra. Rosângela Ballini (Orientadora), Instituto de Economia - IE, UNICAMP

O novo ambiente regulatório e de mercado do setor elétrico brasileiro vem demandando por novas formas de mensuração, análise e desenvolvimento de instrumentos de gestão de riscos. As empresas atuantes no setor necessitam investir esforços de pesquisa e desenvolvimento que dêem suporte à avaliação e gestão de riscos, permitindo subsidiar os processos decisórios sobre negociação de energia elétrica. Este trabalho visa desenvolvimento de uma metodologia de geração de cenários, a ser construído com base nos fatores de risco mais relevantes aos quais estão expostas as empresas e que formam um substrato consistente para avaliação de riscos decorrentes das negociações de energia elétrica. Para a identificação das variáveis mais relevantes na formação do risco, este trabalho propõe o uso de métodos de agrupamento de dados baseados na teoria de lógica nebulosa como uma técnica para exploração dos dados e para determinar as relações e padrões correlacionados. Os resultados obtidos na operação de agrupamento de dados são usados para verificar as características de uma base de dados, como dados de entrada para os modelos estocásticos que permitirão a geração de cenários das respectivas variáveis de risco ao longo do horizonte de análise.

Mercado de energia elétrica - Método de agrupamento - Geração de cenários