



Campinas, 27 de fevereiro de 2024

Comunicado - Monitoramento Prudencial

Durante as primeiras seis semanas de 2024, observamos pequenas diferenças entre as volatilidades fornecidas pela Dcide e os valores teóricos especificados na metodologia do processo sombra de Monitoramento Prudencial da CCEE. Reconhecemos que essas divergências foram resultado de um erro operacional por parte da DCIDE, o qual foi prontamente corrigido assim que detectado.

Essas diferenças limitaram-se às volatilidades e resultaram em um valor a menor nos produtos que compõem o Monitoramento Prudencial (M+0 até M+6) de, em média, dois e meio pontos percentuais, (vide planilha em anexo) o que, unido ao fato que os respectivos preços estavam virtualmente no mínimo regulatório, não devem ter potencial de gerar desvios materiais.

Essas divergências ocorreram por um erro operacional por parte da Dcide devido a mudanças de produtos na virada de ano e assim que detectado foi prontamente corrigido de maneira que os eventos de Monitoramento Prudencial subsequentes, a partir da semana 07 deste ano, já refletem os valores corretos definidos na metodologia.

Pretendemos então com esse comunicado informar formalmente a CCEE e os fóruns de governança do processo de Monitoramento Prudencial sobre o ocorrido e dar transparência aos agentes participantes e demais usuários da informação para que possam ponderar em suas análises eventuais efeitos adicionais que possam disso inferir.

A Dcide se desculpa por eventuais desconfortos que essa circunstância possa causar e afirmamos nosso compromisso de seguir implementando mecanismos de controles mais robustos nesse processo específico, a exemplo do que fazemos nos demais processos de divulgação de informação, ressoando o elevado padrão de confiabilidade que imputamos a nós como um importante valor da empresa.

Destacamos ainda que os demais processos de divulgação de informação não foram afetados pela ocorrência descrita e reforçamos nossa intenção de gerar informação de qualidade ao mercado, colocando-nos à disposição para eventuais quaisquer esclarecimentos que possam vir a ser necessários.

Patrick Martin Hansen
Diretor-Geral

Henrique Leme Felizatti
Diretor

Anexo

Análise de Diferenças nas Volatilidade para Monitoramento Prudencial (Valores em %)								
S01	M+0	M+1	M+2	M+3	M+4	M+5	M+6	
Enviada pela Dcide	0	1,108	0,662	0,623	0,146	0,268	0,052	
Valor Teórico (Metodologia)	0	3,648	4,151	3,474	3,774	3,742	3,687	
Diferença	0	2,54	3,489	2,851	3,628	3,474	3,635	
								MÉDIA
								2,80

Não ocorreram diferença nos preços e nos demais parâmetros e informações

S02	M+0	M+1	M+2	M+3	M+4	M+5	M+6	
Enviada pela Dcide	0	1,148	0,646	0,609	0,176	0,321	0,127	
Valor Teórico (Metodologia)	0	4,046	3,386	3,68	3,652	3,596	3,827	
Diferença	0	2,898	2,74	3,071	3,476	3,275	3,7	
								MÉDIA
								2,74

Não ocorreram diferença nos preços e nos demais parâmetros e informações

S03	M+0	M+1	M+2	M+3	M+4	M+5	M+6	
Enviada pela Dcide	1,516	0,879	0,709	0,248	0,33	0,432	1,166	
Valor Teórico (Metodologia)	3,633	3,991	3,323	3,591	3,561	3,529	3,732	
Diferença	2,117	3,112	2,614	3,343	3,231	3,097	2,566	
								MÉDIA
								2,87

Não ocorreram diferença nos preços e nos demais parâmetros e informações

S04	M+0	M+1	M+2	M+3	M+4	M+5	M+6	
Enviada pela Dcide	1,628	1,263	1,018	0,506	0,511	0,764	1,293	
Valor Teórico (Metodologia)	3,606	3,999	3,324	3,528	3,493	3,498	3,689	
Diferença	1,978	2,736	2,306	3,022	2,982	2,734	2,396	
								MÉDIA
								2,59

Não ocorreram diferença nos preços e nos demais parâmetros e informações

S05	M+0	M+1	M+2	M+3	M+4	M+5	M+6	
Enviada pela Dcide	1,617	1,239	0,994	0,576	0,727	1,662	3,381	
Valor Teórico (Metodologia)	3,528	3,9	3,24	3,451	3,445	3,719	4,772	
Diferença	1,911	2,661	2,246	2,875	2,718	2,057	1,391	
								MÉDIA
								2,27

Não ocorreram diferença nos preços e nos demais parâmetros e informações

S06	M+0	M+1	M+2	M+3	M+4	M+5	M+6	
Enviada pela Dcide	0	1,637	1,227	1,062	0,827	0,836	6,839	
Valor Teórico (Metodologia)	0	3,467	3,807	3,188	3,418	3,387	7,569	
Diferença	0	1,83	2,58	2,126	2,591	2,551	0,73	
								MÉDIA
								1,77

Não ocorreram diferença nos preços e nos demais parâmetros e informações

Média Geral Diferenças	2,51
-------------------------------	------