

Curso de aprofundamento

Gestão de Riscos em Comercialização

Sobre o Curso

Este curso tem por objetivo principal fornecer aos participantes um conhecimento aprofundado sobre as principais técnicas e estratégias utilizadas para gerenciar os riscos associados à comercialização de energia elétrica.

Ofertado por Alexandre Lafranque – entenda os principais riscos relacionados à comercialização de energia



[Inscreva-se aqui](#)

Ementa

Aula 1 - Introdução e conceitos básicos

- Política de riscos
- Identificação e análise dos principais riscos relacionados à comercialização de energia
- Riscos de mercado
- Riscos de crédito
- Riscos de liquidez
- Riscos operacionais

Aula 2 - Marcação à mercado e gestão dos riscos volumétricos com o VaR

- Preços de mercado (BBCE, DCIDE, Curvas internas, Consultorias)
- Marcação à mercado
- Construção das métricas de riscos de mercado: Value-at-Risk (VaR)
- Estudo de caso: Volatilidade dos preços em Q2/25

Aula 3 - Mensuração dos riscos ilíquidos com o PaR e gestão do risco de crédito

- O Profit-at-Risk (PaR) para mensurar os riscos não líquidos
- Estudo de caso: Avaliação do risco horário de geração de um projeto solar
- A gestão das exposições com as contrapartes: onboarding, atribuição de limites de crédito e metodologias para mensurar o risco de crédito

3. Construção das métricas de riscos de mercado

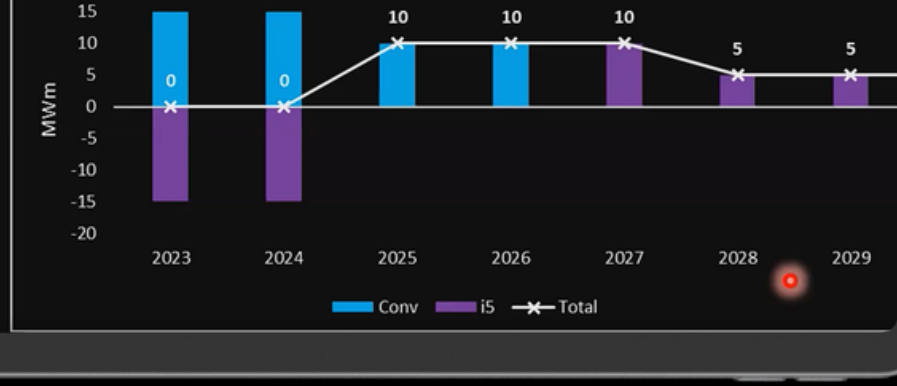
Elaboração do balanço energético das posições

O conhecimento das exposições da carteira é fundamental | associados e adequar as métricas aos produtos que estão ex

Tipo de Produto Submercado Convencional, Incentivada 50%/0%/100%, INES, IRECS Sudeste, Sul, Nordeste, Norte

Cláusulas Contratuais Sazonalização, Flexibilidade, Modulação Horária

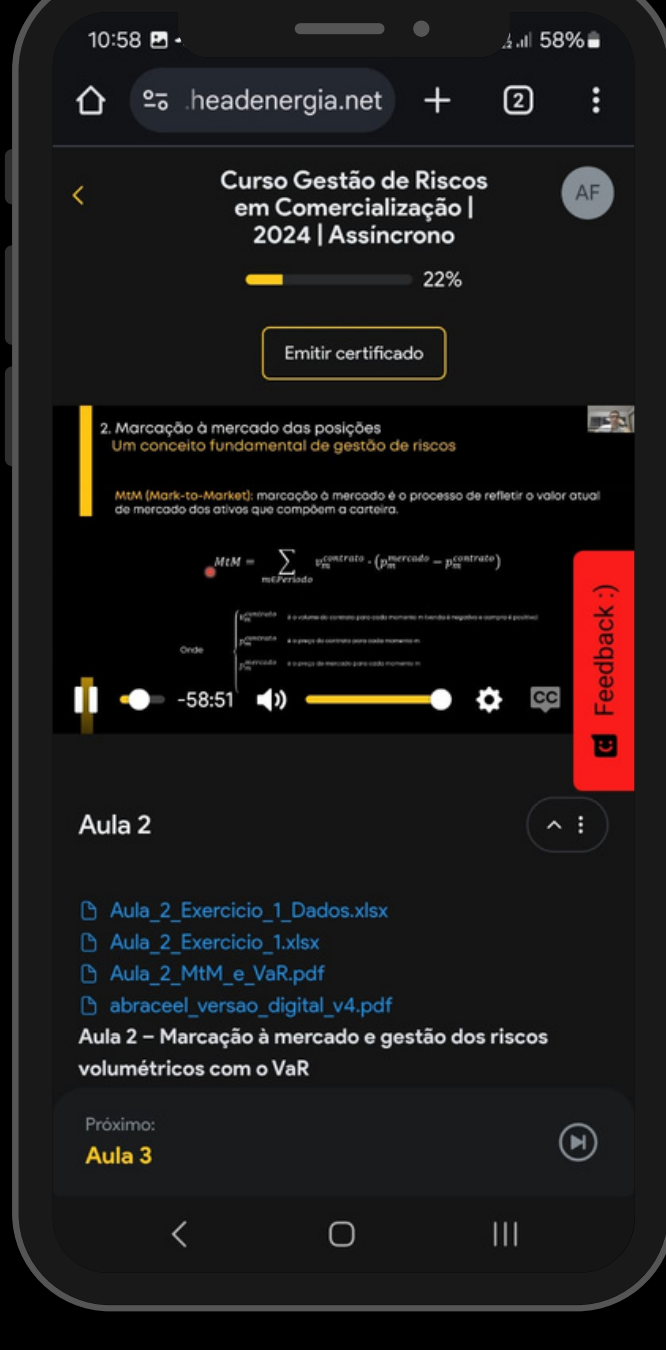
Parâmetros da planta Garantia Física, P50, Taxa de Disponibilidade, Perdas In



Aula 4 - Uso de garantias para mitigar as exposições com as contrapartes e noções sobre o apetite ao risco

- Mitigação do risco de crédito com a implantação de garantias
- Estudo de caso: Mensuração dos impactos de um encerramento contratual
- Introdução sobre a relação risco-retorno
- O Risk Capital, uma metodologia para mensurar o apetite ao risco do investidor

- Estudo de caso: Antecipação e proteção da carteira contra potenciais default em momentos de alta volatilidade no mercado



Aula 5 – Estudo de caso final: Contratação de um PPA solar e hedge das exposições

- Avaliação dos riscos do PPA e dos hedges
- Mensuração dos diversos riscos evidenciados
- Cálculo do P&L da operação e capital em risco na operação
- Tomada de decisão sobre a contratação do PPA e dos hedges propostos

[Garanta a sua vaga!](#)

Conheça o professor

Alexandre Cafure Lafranque possui mais de 7 anos de experiência como gerente de riscos. Formado em engenharia elétrica e de automação pela ENSEEIHT (França), tenho mestrado em políticas públicas, estratégias e desenvolvimento (PPED) pelo instituto de economia da UFRJ e possui um doutorado em planejamento energético pela COPPE/UFRJ. Trabalho há mais de 10 anos no setor elétrico nos ramos de consultoria e de gestão de riscos. Tenho bastante experiência no desenvolvimento de modelos quantitativos para o planejamento energético, a modelagem de riscos ligados à comercialização de energia e para a regulação do setor elétrico



Alexandre Lafranque

Bônus

para os inscritos nessa edição

Bônus 1: Aula Gestão de riscos em comercialização

Bônus 2: Aula Riscos em comercialização: um case sobre crise hídrica e ondas de calor

Bônus 3: Contato do professor para tirar dúvidas sobre os conceitos aprendidos

Bônus 4: vários descontos privilegiados

25% de desconto para os assinantes da Head Energia

50% de desconto para renovar o acesso por mais um ano

50% de desconto para ex-alunos do curso

10% de desconto para assinar a Head Energia

10% de desconto para associados de Associações que divulgarem o curso e membros do Taças e Turbinas

Algumas empresas que já compraram esse curso



Demais informações:



Datas: 29 de setembro, 01, 06, 08 e 13 de outubro , às 19h



Formato: Online ao vivo no zoom e gravada



Carga horária: 10 horas



Prazo de acesso à gravação : 6 meses



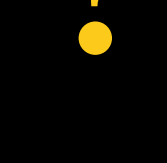
Certificado de conclusão



Desconto de 25% para assinantes Head Energia



Desconto de 5% para empresas com mais de 10 inscritos



contato@headenergia.net

[Realize sua inscrição aqui](#)