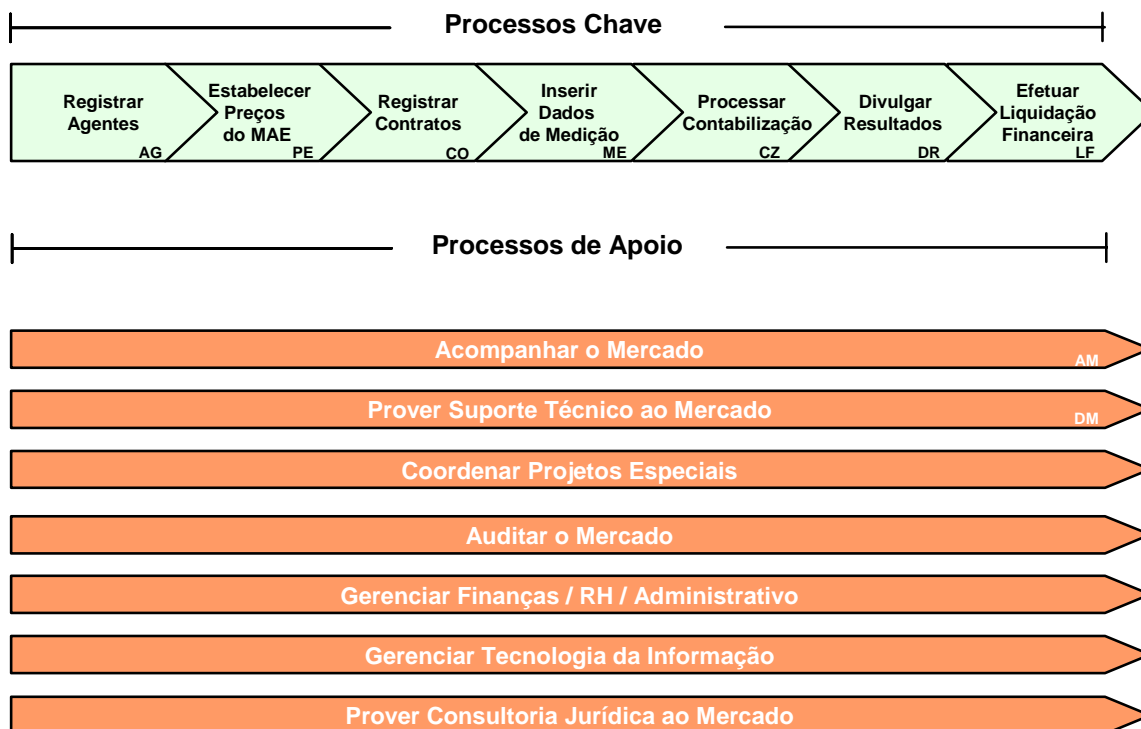


PROCEDIMENTO DE MERCADO – LF.02
Liquidação Financeira – Sem Garantias –
Período de Set/2000 até Dez/2002
(Art. 11 da Resolução ANEEL nº 552/2002)

Responsável pelo PM: Gerência de Liquidação Financeira				
CONTROLE DE ALTERAÇÕES				
Versão	Data	Descrição da Alteração	Elaborada por	Aprovada por

1. PROCESSO ORIGEM

Cadeia de Valor do MAE



Macro Processo: Efetuar Liquidação Financeira

2. NOME E CÓDIGO DO PROCEDIMENTO DE MERCADO

Liquidação Financeira – LF.02

3. PÚBLICO ALVO

- 3.1. Agentes de Mercado
- 3.2. Agente de Liquidação
- 3.3. Superintendência do MAE

4. OBJETIVO

Estabelecer os procedimentos para a execução da Liquidação Financeira sem aporte de garantias, relativamente às operações de compra e venda de energia elétrica realizadas no âmbito do MAE no período compreendido entre setembro de 2000 e dezembro de 2002, nos termos do art. 11 da Resolução ANEEL nº 552/2002, modificada pela Resolução ANEEL nº 610/2002.

5. ASPECTOS REGULATÓRIOS ENVOLVIDOS

- 5.1. Lei nº 10.433, de 24 de abril de 2002 - Dispõe sobre a autorização para a criação do Mercado Atacadista de Energia Elétrica - MAE, pessoa jurídica de direito privado, e dá outras providências.
- 5.2. Resolução ANEEL nº 102, de 1º de Março de 2002 – Institui a Convenção do Mercado Atacadista de Energia Elétrica (MAE).
- 5.3. Resolução ANEEL nº 103, de 1º de Março de 2002 – Autoriza o MAE a atuar segundo Regras e Procedimentos de Mercado estabelecidos pela ANEEL.
- 5.4. Resolução ANEEL nº 552, de 14 de Outubro de 2002 – Estabelece os procedimentos relativos à liquidação das operações de compra e venda de energia elétrica, no mercado de curto prazo, no âmbito do Mercado Atacadista de Energia Elétrica - MAE e trata das garantias financeiras e penalidades.
- 5.5. Resolução ANEEL nº 610, de 6 de Novembro de 2002 – Altera os artigos 6º e 12 e revoga o inciso III do art. 11 da Resolução nº 552, de 14 de outubro de 2002.
- 5.6. Resolução ANEEL nº 635, de 21 de novembro de 2002 – Autoriza o Mercado Atacadista de Energia Elétrica – MAE a criar mecanismos para efetuar a Liquidação Financeira de que trata o Artigo 11 da Resolução nº 552, de 14 de outubro de 2002.
- 5.7. Resolução ANEEL nº 278, de 19 de julho de 2000 - Estabelece limites e condições para participação dos agentes econômicos nas atividades do setor de energia elétrica.
- 5.8. Estatuto Social do MAE. Artigo 4º, II. Artigo 9º, III. Artigo 10, III. Artigo 23, XIV, § 1º, § 2º. Artigo 33, II, VII, VIII, XII.

6. DEFINIÇÕES

- 6.1. **Agente de Liquidação:** Instituição Financeira contratada pelo Mercado Atacadista de Energia Elétrica - MAE para proceder à Liquidação Financeira das operações realizadas no Mercado de Curto Prazo no Período Não Garantido.
- 6.2. **Agente de Mercado:** Abrange os geradores, distribuidores, comercializadores, importadores, exportadores e consumidores livres que participam do Mercado nos termos da Convenção do Mercado instituída pela Resolução ANEEL nº 102/2002.
- 6.3. **Agente de Mercado Representante:** Agente de Mercado que represente outros Agentes de Mercado integrantes do mesmo Grupo de Agentes.
- 6.4. **Agente de Mercado Credor Líquido:** Agente de Mercado ou Agente de Mercado Representante que apresente saldo credor na Liquidação Principal, embora possua saldo devedor em pelo menos um dos meses do período considerado.
- 6.5. **Agente de Mercado Devedor Líquido:** Agente de Mercado ou Agente de Mercado Representante que apresente saldo devedor na Liquidação Principal, embora possua saldo credor em pelo menos um dos meses do período considerado.
- 6.6. **Ajuste de Rateio da Inadimplência:** Diferença a ser debitada aos Agentes de Mercado Devedores Líquidos ou eventualmente ao Agente de Mercado Credor Líquido, na Liquidação Residual, apurada com base nos percentuais para rateio de eventual Inadimplência ocorrida na Liquidação Principal e nos valores dos créditos dos respectivos Agentes de Mercado Devedores Líquidos no Período Não Garantido. O Ajuste é calculado para considerar a real participação do Agente de Mercado no Rateio da Inadimplência, conforme previsto no art.7º, § 2º da Convenção de Mercado e do art. 7º da Resolução ANEEL 552/2002 e na Resolução ANEEL 635/2002.
- 6.7. **Conta Corrente Específica:** Conta Corrente Específica a ser aberta pelo Agente de Mercado junto ao Agente de Liquidação especificamente para fins de Liquidação Financeira das operações realizadas no mercado de curto prazo.

- 6.8. **Autorização de Débito:** Termo de Autorização outorgada ao Agente de Liquidação pelo Agente de Mercado para débito em conta-corrente específica e para fins de cumprimento de obrigação na Liquidação Financeira.
- 6.9. **Declaração de Grupo de Agentes:** Declaração obrigatória a ser apresentada à Superintendência do MAE pelos Agentes de Mercado que optem pela participação na Liquidação Financeira por intermédio de Grupo de Agentes.
- 6.10. **Grupo de Agentes:** Forma de agrupamento de Agentes de Mercado, para fins de realização da Liquidação Financeira do Período Não Garantido, a qual deve atender às disposições da Resolução ANEEL nº 278 de 19 de julho de 2000.
- 6.11. **Inadimplência:** Descumprimento de obrigações financeiras de responsabilidade do Agente de Mercado, seja na Liquidação Principal, seja na Liquidação Residual.
- 6.12. **Liquidação Financeira:** Processo de pagamento e recebimento de obrigações e direitos apurados no âmbito do MAE, referentes à compra e venda de energia elétrica no mercado de curto prazo, excluídos os eventuais valores *sub judice*, em atendimento aos arts. 9º e 10 da Resolução ANEEL 552/2002.
- 6.13. **Liquidação Principal:** Primeira etapa da Liquidação Financeira, na qual será: i) levado a débito o Valor Líquido de Débito apurado para o Agente de Mercado devedor; e ii) levado a crédito o Valor Líquido de Crédito correspondente a cada Agente de Mercado credor, subtraídos os montantes relativos à sua participação no Rateio da Inadimplência.
- 6.14. **Liquidação Residual:** Segunda etapa da Liquidação Financeira, na qual será debitado ao Agente de Mercado Devedor Líquido e, eventualmente, ao Agente de Mercado Credor Líquido, o Ajuste de Rateio da Inadimplência. Nesta etapa, não há alteração do montante da Inadimplência eventualmente ocorrida na Liquidação Principal, mas apenas acerto financeiro para fins do correto compartilhamento dos valores inadimplidos entre todos os Agentes, nos termos do art. 7º, § 2º, da Convenção do Mercado, e do art. 7º da Resolução ANEEL 552/2002.
- 6.15. **Rateio da Inadimplência:** Compartilhamento das repercussões financeiras relativas aos valores não liquidados pelos Agentes de Mercado devedores entre todos os Agentes de Mercado credores, implicando a redução de seus valores líquidos a receber. O montante do Rateio da Inadimplência aplicável a cada Agente de Mercado credor será definido pelo rateio do valor total das Inadimplências entre os Agentes de Mercado na proporção de seu Valor Líquido de Crédito.
- 6.16. **Mapa de Liquidação Financeira:** Documento eletrônico emitido pela Superintendência do MAE que informa todos os valores a serem movimentados pelo Agente de Liquidação no dia da Liquidação Financeira, detalhado de acordo com débitos e créditos relativos a cada Agente de Mercado, excluídos os eventuais valores *sub judice*, em atendimento aos arts. 9º e 10 da Resolução ANEEL 552/2002.
- 6.17. **Nota de Liquidação da Contabilização (NLC):** Documento a ser emitido pelo Agente de Liquidação para cada Agente de Mercado, após a execução da Liquidação Financeira, refletindo os valores efetivamente liquidados.
- 6.18. **Período Não Garantido:** Período durante o qual as Liquidações Financeiras das operações de compra e venda de energia elétrica no mercado de curto prazo serão realizadas sem garantia, compreendendo o período de 1º de setembro/2000 até 31 de dezembro de 2002.
- 6.19. **Regulamento de Operações e Procedimentos Operacionais:** Documento que estabelece as atividades a serem desenvolvidas para fins de realização da Liquidação Financeira do Período Não Garantido e de cumprimento obrigatório pelo Agente de Liquidação, pelos Agentes de Mercado e pela Superintendência do MAE.
- 6.20. **Relatórios de Liquidação Financeira:** Relatórios a serem emitidos pela Superintendência do MAE contendo os resultados da Liquidação Financeira e os valores e nomes dos Agentes de Mercado que tenham incorrido em Inadimplência, para efeito de faturamento bilateral, nos termos do art. 11, inciso V, da Resolução ANEEL 552/2002.

- 6.21. **Valor Líquido de Crédito:** Valor a ser levado a crédito ao Agente de Mercado na Liquidação Financeira, considerando suas operações de compra e venda de energia elétrica no Período Não Garantido.
- 6.22. **Valor Líquido de Débito:** Valor a ser levado a débito ao Agente de Mercado na Liquidação Financeira, considerando suas operações de compra e venda de energia elétrica no Período Não Garantido.
- 6.23. **Superintendência do MAE** – É a Superintendência do MAE e/ou seus órgãos internos de assessoria.
- 6.24. **du** – Dias Úteis

7. FERRAMENTAS DE SUPORTE

FERRAMENTA	DESCRIÇÃO
Mapa de Liquidação Provisório	<ul style="list-style-type: none"> Arquivo eletrônico a ser enviado antecipadamente ao Agente de Liquidação com os valores a serem liquidados na Liquidação Principal, para análise de eventuais inconsistência de dados. (CNPJ, nº de Conta Corrente Específica, etc).
Mapa de Liquidação Financeira Principal	<ul style="list-style-type: none"> Arquivo eletrônico a ser enviado ao Agente de Liquidação contendo os valores a serem liquidados na Liquidação Principal.
Mapa de Liquidação Financeira Residual	<ul style="list-style-type: none"> Arquivo eletrônico a ser enviado ao Agente de Liquidação contendo os valores a serem liquidados na Liquidação Residual.
Conta Corrente Específica Específica	<ul style="list-style-type: none"> Conta Corrente Específica a ser aberta pelo Agente de Mercado junto ao Agente de liquidação especificamente para fins de Liquidação Financeira das operações realizadas no mercado de curto prazo.
NLC	<ul style="list-style-type: none"> Documento a ser emitido pelo Agente de Liquidação após a execução da Liquidação Financeira, refletindo os valores efetivamente liquidados.
Relatório de Liquidação Financeira	<ul style="list-style-type: none"> Relatório que detalha o resultado da Liquidação Financeira do período de Contabilização apurado. Apresenta pagamentos e recebimentos realizados pelos Agentes de Mercado e identifica possíveis Inadimplências e ajustes relativos ao Rateio da Inadimplência, bem como os montantes e as contrapartes dos valores inadimplidos, para efeito de faturamento bilateral entre as partes.
Manual de Acesso aos Relatórios	<ul style="list-style-type: none"> Manual desenvolvido pela Superintendência do MAE para os Agentes de Mercado, fornece todas as orientações para o acesso aos Relatórios
Sistema SCL	<ul style="list-style-type: none"> Sistema de Contabilização e Liquidação do MAE (Sistema SCL) - é o Sistema Computacional no qual serão viabilizados o download dos relatórios

8. PREMISSAS

8.1. Premissas Gerais

- 8.1.1. Este Procedimento de Mercado é restrito à Liquidação Financeira das operações de compra e venda de energia realizadas no Período Não Garantido, nos termos do art. 11 da Resolução ANEEL nº 552/2002, alterada pela Resolução ANEEL nº 610/2002 e da Resolução ANEEL 635/2002.
- 8.1.2. Excepcionalmente para o Período Não Garantido, a Liquidação Financeira poderá ser realizada considerando:
- i) o valor líquido acumulado no Período, para o que a Superintendência do MAE agregará os valores mensais contabilizados de cada Agente de Mercado em um único valor líquido, a débito ou a crédito, conforme o caso;
 - ii) a formação de Grupos de Agentes de Mercado; e
 - iii) a divisão em duas etapas: Etapa 1 - Liquidação Principal e Etapa 2 - Liquidação Residual.
- 8.1.3. Os Agentes de Mercado deverão responder pelas respectivas obrigações tributárias e outras assumidas perante terceiros.
- 8.1.4. No Período Não Garantido, o Agente de Liquidação será uma instituição financeira contratada pelo MAE, responsável por operacionalizar o processo de Liquidação Financeira.
- 8.1.5. Todo Agente de Mercado deverá abrir conta-corrente junto ao Agente de Liquidação, para o fim específico da Liquidação Financeira, cujos dados deverão ser informados à Superintendência do MAE.
- 8.1.6. O Agente de Mercado deverá encaminhar à Superintendência do MAE a Autorização de Débito na referida Conta Corrente Específica aberta junto ao Agente de Liquidação (Vide Seção 12 deste Procedimento de Mercado – Anexos).
- 8.1.7. A Superintendência do MAE calculará e informará previamente aos Agentes de Mercado seu respectivo percentual de participação no Rateio da Inadimplência, no caso de eventual Inadimplência, tanto para a Liquidação Principal quanto para a Liquidação Residual.
- 8.1.8. Caso ocorra Inadimplência, o Agente de Liquidação alocará tal inadimplência aos Agentes de Mercado credores, considerando os percentuais de participação do Rateio da Inadimplência informados pela Superintendência do MAE.
- 8.1.9. O Agente de Liquidação terá a responsabilidade de emitir a NLC aos Agentes de Mercado.
- 8.1.10. No caso de Agentes de Mercado desligados do MAE ou que tenham passado por processos de reestruturação societária durante o Período Não Garantido, os valores a liquidar serão lançados a débito ou a crédito dos Agentes de Mercado sucessores.
- 8.1.11. A Superintendência do MAE disponibilizará aos Agentes de Mercado relatório específico com os resultados do processo de Liquidação Financeira.
- 8.1.12. Conforme Resolução ANEEL nº 552, de 14 de Outubro de 2002, eventuais Inadimplências ocorridas após a realização da Liquidação Residual deverão ser liquidadas bilateralmente entre os Agentes de Mercado, com base em Relatório de Liquidação Financeira a ser disponibilizado pela Superintendência do MAE para cada Agente de Mercado.
- 8.1.13. Os Agentes de Mercado inadimplentes estarão sujeitos às penalidades previstas na Resolução ANEEL nº 552/2002.
- 8.1.14. O valor a ser disponibilizado em Conta Corrente Específica para cumprimento das obrigações pelo Agente de Mercado, deverá ser acrescido do valor referente à Contribuição Provisória Sobre a Movimentação Financeira – CPMF, para fins de

provisionamento e futuro recolhimento dos tributos devidos a esse título, pelo Agente de Liquidação.

8.1.15. Os prazos constantes neste Procedimento de Mercado estão apresentados em dias úteis.

8.2. Premissas referentes à constituição de Grupos de Agentes de Mercado

8.2.1. Será permitida a constituição de Grupos de Agentes de Mercado, nos termos da Resolução ANEEL 635/2002, que deverão ser representados por um Agente de Mercado integrante do Grupo.

8.2.2. O reconhecimento da constituição do Grupo de Agentes, dar-se-á mediante a apresentação de declaração à Superintendência do MAE, no máximo em até 3 (quatro) dias úteis antes da data designada para a realização da Liquidação Financeira.

8.2.3. A declaração de constituição de Grupo de Agentes deverá ser firmada em documento único, por todos os Agentes de Mercado integrantes do Grupo de Agentes, com assinatura de seus respectivos representantes legais e reconhecimento das respectivas firmas.

8.2.4. A Superintendência do MAE encaminhará à ANEEL a Declaração de Constituição de Grupos de Agentes, para análise de sua conformidade com as disposições da Resolução ANEEL 278/2000.

8.2.5. No caso de formação de Grupo de Agentes, além dos documentos mencionados no Regulamento De Operações e Procedimentos Operacionais, deverá ser apresentada à Superintendência do MAE a declaração tratada neste item, em até 3 (quatro) dias úteis antes da Liquidação Financeira.

8.2.6. No âmbito do Grupo de Agentes, os valores dos débitos e créditos resultantes da Contabilização do MAE serão objeto de negociação entre os mesmos, os quais, respeitada a legislação tributária, poderão compensar seus respectivos créditos e débitos tomando-se como base os valores históricos mensais contabilizados.

8.2.7. A negociação tratada no item anterior deverá ser objeto de instrumentos jurídicos firmados entre os Agentes de Mercado integrantes do Grupo de Agentes, os quais deverão adotar os mecanismos legais que entenderem pertinentes, bem como estabelecer as condições aplicáveis à sua realização.

8.2.8. A declaração de constituição de Grupo de Agentes deverá conter, obrigatoriamente:

- i) informações sobre a composição do Grupo, incluindo os nomes dos Agentes de Mercado e qualificação completa, identificação dos representantes legais, endereço e número de inscrição no CNPJ;
- ii) indicação do Agente de Mercado Representante e seus respectivos dados, o qual deverá ter plenos poderes para a prática de todos os atos necessários à Liquidação Financeira;
- iii) cláusula de responsabilidade pela assunção das obrigações decorrentes da Inadimplência, em especial pelos Agentes de Mercado devedores, contra os quais serão emitidas as faturas bilaterais por parte dos Agentes de Mercado credores;
- iv) cláusula de responsabilidade pelas obrigações de natureza tributária, em especial pelo depósito dos valores relativos à Contribuição Provisória sobre Movimentação Financeira – CPMF incidentes sobre os valores depositados junto ao Agente de Liquidação para a Liquidação Financeira;
- v) cláusula de responsabilidade pelas obrigações assumidas pelos Agentes de Mercado perante terceiros, incluindo, mas não se limitando, aos terceiros cessionários de direitos, sejam ou não de conhecimento dos respectivos Agentes;
- vi) cláusula expressa de que a negociação efetuada representa a plena realização de seus respectivos créditos e débitos apurados na Contabilização do MAE, implicando a

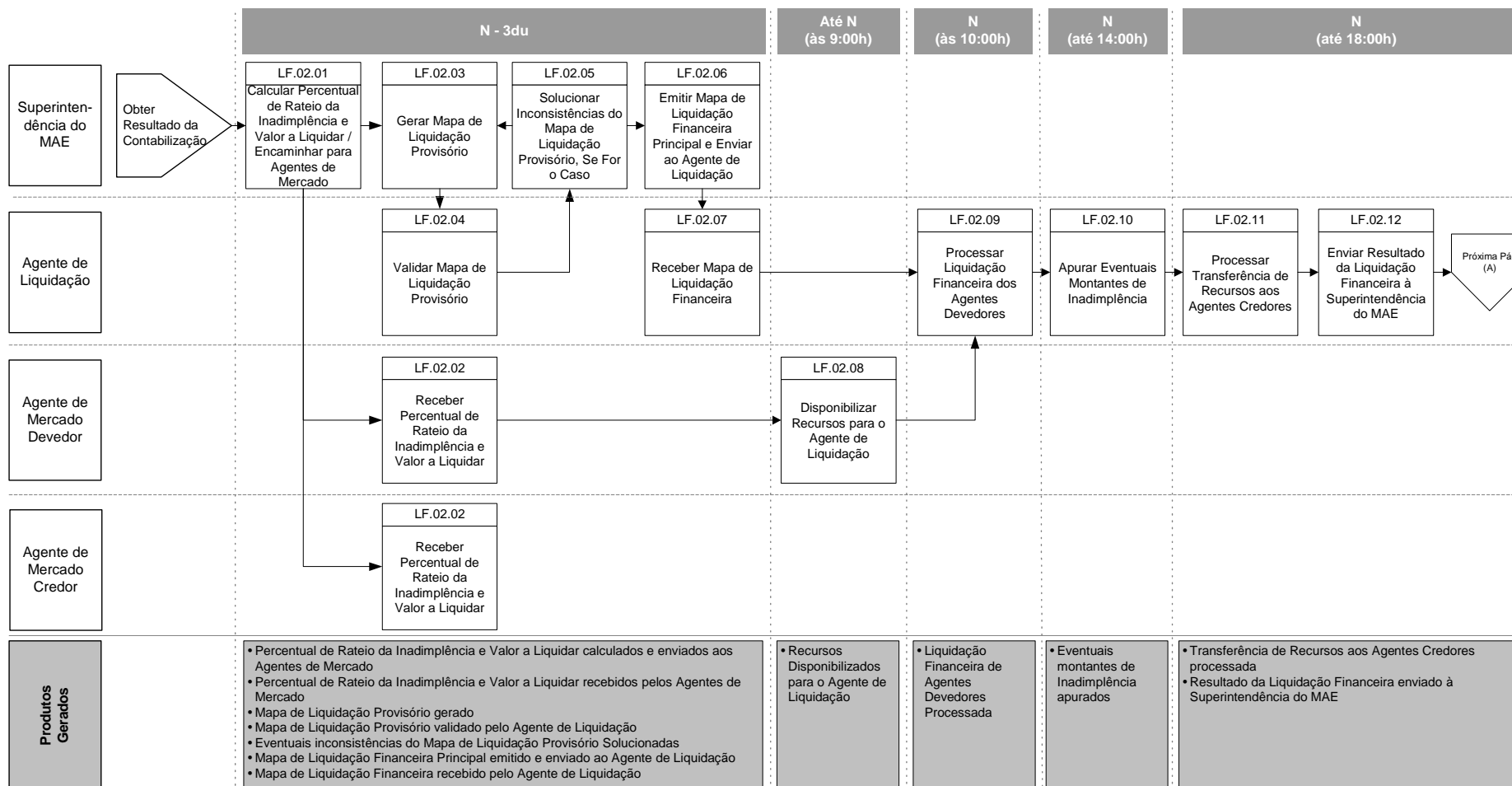
quitação no que diz respeito aos valores efetivamente compensados, para o que haverá irrevogabilidade e irretratabilidade, para todos os fins e efeitos;

- vii) cláusula exonerativa em relação ao MAE quanto a quaisquer implicações decorrentes da prática dos atos inerentes à negociação havida, com indicação expressa de que os mesmos são de total e exclusiva responsabilidade dos Agentes de Mercado envolvidos;
 - viii) cláusula de ciência de que os negócios jurídicos realizados entre os Agentes de Mercado declarantes não obrigam o MAE, a qualquer título e sob qualquer condição.
- 8.2.9. O Agente de Mercado Representante será responsável, perante o Agente de Liquidação e a Superintendência do MAE, pela prática dos atos relativos à Liquidação Financeira:
- i) apresentação da Autorização de Débito (Vide Seção 12 deste Procedimento de Mercado – Anexos);
 - ii) apresentação de informe de abertura de Conta Corrente Específica;
 - iii) realização do depósito relativo ao Valor Líquido de Débito;
 - iv) recebimento do Valor Líquido de Crédito;
 - v) recebimento das informações relativas ao Rateio da Inadimplência e dos eventuais Ajustes para Liquidação Residual. Em se tratando de um Grupo de Agentes de Mercado, os percentuais serão informados ao Representante do Grupo;
 - vi) aporte dos recursos necessários na Liquidação Residual;
 - vii) recebimento da NLC.
- 8.2.10. Eventuais Inadimplências ocorridas após a realização da Liquidação Residual deverão ser liquidadas bilateralmente entre os Agentes de Mercado, com base em Relatório de Liquidação Financeira a ser disponibilizado pela Superintendência do MAE para cada Agente de Mercado.
- 8.2.11. Para os fins do previsto no item 8.2.10, o Relatório de Liquidação Financeira será elaborado considerando o Valor Líquido de Débito de cada Agente de Mercado integrante do Grupo de Agentes em relação ao somatório dos Valores Líquidos de Débito do Grupo.
- 8.2.12. O Relatório de Liquidação Financeira será disponibilizado somente para o Agente de Mercado Representante.

8.3. Premissas referentes à existência de medida liminar ou tutela antecipada

- 8.3.1. Nos termos dos arts. 9º e 10 da Resolução ANEEL nº 552/2002, na hipótese de concessão de medida liminar ou tutela antecipada que determine, de forma expressa, a suspensão da obrigação de pagar eventual débito apurado na contabilização mensal realizada pelo MAE, os valores sub judice serão:
- i) excluídos dos montantes totais a serem liquidados;
 - ii) calculados e lançados em registro escritural especial a ser mantido pela Superintendência do MAE.

9. FLUXOGRAMA



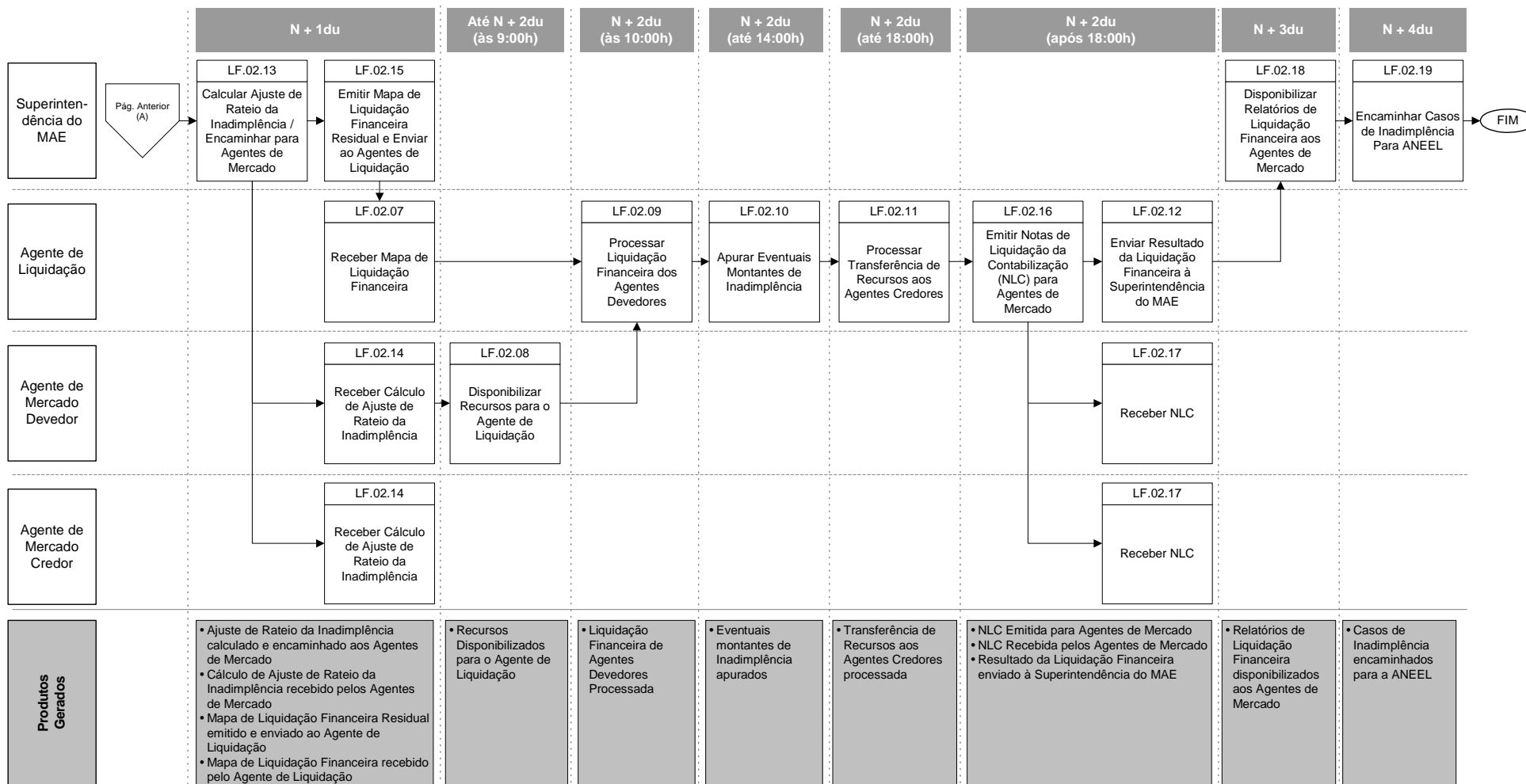
Legenda:

N – Data da Liquidação Financeira Principal

du – Dias Úteis

PROCEDIMENTO DE MERCADO – 3.0
“LIQUIDAÇÃO FINANCEIRA – SEM GARANTIAS – PERÍODO DE SET/00 ATÉ
DEZ/02- ”
(Art. 11 da Resolução ANEEL nº 552/2002)
PM – LF.02

Versão 1



Legenda:

N – Data da Liquidação Financeira Principal

du – Dias Úteis

10. MATRIZ DE OPERACIONALIZAÇÃO

ATIVIDADE	CÓDIGO	RESPONSÁVEL	DETALHAMENTO	FERRAMENTA	PRODUTOS GERADOS	PRAZO
Calcular Percentual de Rateio da Inadimplência / Encaminhar para Agentes de Mercado	LF.02.01	Superintendência do MAE	<ul style="list-style-type: none"> Calcular percentual de Rateio da Inadimplência para execução pelo Agente de Liquidação, caso sejam identificados valores pendentes de liquidação. O percentual de Rateio da Inadimplência para a Liquidação Principal baseia-se no Valor Líquido de Crédito de cada Agente de Mercado verificado no Período Não Garantido. 		Percentual de Rateio da Inadimplência calculado e enviado aos Agentes de Mercado	N – 3 du
Receber Percentual de Rateio da Inadimplência	LF.02.02	Agente de Mercado Credor	<ul style="list-style-type: none"> Receber o percentual de compartilhamento de eventuais Inadimplências ocorridas na Liquidação Principal. 		Percentual de Rateio da Inadimplência recebido pelos Agentes de Mercado	N – 3 du
Gerar Arquivo de Liquidação Provisório	LF.02.03	Superintendência do MAE	<ul style="list-style-type: none"> Obter resultado da contabilização do período apurado, com valores de pagamentos e recebimentos a serem realizados por/para os Agentes de Mercado. Gerar Arquivo de Liquidação Provisório a ser validado pelo Agente de Liquidação. O Arquivo de Liquidação contém o valor de crédito ou débito de cada Agente de Mercado. Enviar Arquivo de Liquidação Provisório ao Agente de Liquidação para validação de dados cadastrais dos Agentes de Mercado. 	Arquivo de Liquidação Provisório	Arquivo de Liquidação Provisório gerado	N – 3 du
Validar Arquivo de Liquidação Provisório	LF.02.04	Agente de Liquidação	<ul style="list-style-type: none"> Identificar possíveis inconsistências de informações do Arquivo de Liquidação enviado pela Superintendência do MAE. Enviar Arquivo de Liquidação validado para a Superintendência do MAE. 	Arquivo de Liquidação Provisório	Arquivo de Liquidação Provisório validado pelo Agente de Liquidação	N – 3 du

PROCEDIMENTO DE MERCADO – 3.0
“LIQUIDAÇÃO FINANCEIRA – SEM GARANTIAS – PERÍODO DE SET/00 ATÉ
DEZ/02- ”
(Art. 11 da Resolução ANEEL nº 552/2002)
PM – LF.02

Versão 1

ATIVIDADE	CÓDIGO	RESPONSÁVEL	DETALHAMENTO	FERRAMENTA	PRODUTOS GERADOS	PRAZO
Solucionar Inconsistências do Arquivo de Liquidação, Se For o Caso	LF.02.05	Superintendência do MAE	<ul style="list-style-type: none"> Receber Arquivo de Liquidação validado pelo Agente de Liquidação. Solucionar possíveis inconsistências de informações do Arquivo de Liquidação, se for o caso. Gerar e reenviar Arquivo de Liquidação Provisório para validação Agente de Liquidação até a solução das inconsistências. 	Arquivo de Liquidação Provisório	Eventuais inconsistências do Arquivo de Liquidação Provisório Solucionadas	N – 3 du
Emitir Mapa de Liquidação Financeira Principal e Enviar ao Agente de Liquidação	LF.02.06	Superintendência do MAE	<ul style="list-style-type: none"> Gerar e emitir Mapa de Liquidação Financeira Principal. O Mapa de Liquidação Financeira Principal contém o valor de crédito ou débito de cada Agente de Mercado. Enviar Mapa de Liquidação Financeira Principal ao Agente de Liquidação 	Mapa de Liquidação Financeira Principal	Mapa de Liquidação Financeira Principal emitido e enviado ao Agente de Liquidação	N – 3 du
Receber Mapa de Liquidação Financeira	LF.02.07	Agente de Liquidação	<ul style="list-style-type: none"> Receber Mapa de Liquidação Financeira com o valor de crédito ou débito de cada Agente de Mercado. 	Mapa de Liquidação Financeira Principal	Mapa de Liquidação Financeira recebido pelo Agente de Liquidação	N – 3 du
Disponibilizar Recursos para o Agente de Liquidação	LF.02.08	Agente de Mercado Devedor	<ul style="list-style-type: none"> Disponibilizar os recursos financeiros a serem liquidados no âmbito do MAE, acrescidos de CPMF, para o Agente de liquidação. 	Conta Corrente Específica Específica	Recursos Disponibilizados para o Agente de Liquidação	Até N (às 9:00h)
Processar Liquidação Financeira dos Agentes Devedores	LF.02.09	Agente de Liquidação	<ul style="list-style-type: none"> Processar a Liquidação Financeira dos valores disponibilizados pelos Agentes de Mercado Devedores. 	Conta Corrente Específica Específica	Liquidação Financeira de Agentes Devedores Processada	Até N (às 10:00h)
Apurar Eventuais Montantes de Inadimplência	LF.02.10	Agente de Liquidação	<ul style="list-style-type: none"> Apurar a diferença entre a expectativa de recebimentos e o total de valores efetivamente recebidos. 		Eventuais montantes de Inadimplência apurados	Até N (até 14:00h)
Processar Transferência de Recursos aos Agentes Credores	LF.02.11	Agente de Liquidação	<ul style="list-style-type: none"> Processar a transferência dos recursos financeiros recebidos dos Agentes devedores aos Agentes credores, considerando os percentuais de Rateio da Inadimplência informados pela Superintendência do MAE. 	Conta Corrente Específica Específica	Transferência de Recursos aos Agentes Credores processada	N (até 18:00h)

Minuta para Avaliação, Sujeita a Alteração

PROCEDIMENTO DE MERCADO – 3.0
“LIQUIDAÇÃO FINANCEIRA – SEM GARANTIAS – PERÍODO DE SET/00 ATÉ
DEZ/02- ”
(Art. 11 da Resolução ANEEL nº 552/2002)
PM – LF.02

Versão 1

ATIVIDADE	CÓDIGO	RESPONSÁVEL	DETALHAMENTO	FERRAMENTA	PRODUTOS GERADOS	PRAZO
Enviar Resultado da Liquidação Financeira à Superintendência do MAE	LF.02.12	Agente de Liquidação	<ul style="list-style-type: none"> Gerar arquivo com o Resultado da Liquidação Financeira, detalhando pagamentos e recebimentos realizados e os ajustes referentes ao Rateio da Inadimplência, caso existam. Enviar arquivo com o Resultado da Liquidação Financeira à Superintendência do MAE. 		Resultado da Liquidação Financeira enviado à Superintendência do MAE	N (até 18:00h)
Calcular Ajuste de Rateio da Inadimplência / Encaminhar para Agentes de Mercado	LF.02.13	Superintendência do MAE	<ul style="list-style-type: none"> Calcular Ajuste de Rateio da Inadimplência, a fim de compor os valores a serem liquidados na Liquidação Residual. 		Ajuste de Rateio da Inadimplência calculado e encaminhado aos Agentes de Mercado	N + 1du
Receber Cálculo de Ajuste de Rateio da Inadimplência	LF.02.14	Agente de Mercado Devedor e Agente de Mercado Credor	<ul style="list-style-type: none"> Receber informação do montante a ser liquidado na Liquidação Residual em virtude do cálculo do Ajuste de Rateio da Inadimplência. 		Cálculo de Ajuste de Rateio da Inadimplência recebido pelos Agentes de Mercado	N + 1du
Emitir Mapa de Liquidação Financeira Residual e Enviar ao Agentes de Liquidação	LF.02.15	Superintendência do MAE	<ul style="list-style-type: none"> Emitir Mapa de Liquidação Financeira Residual, contemplando os resultados obtidos no cálculo de Ajuste de Rateio da Inadimplência. 	Mapa de Liquidação Financeira Residual	Mapa de Liquidação Financeira Residual emitido e enviado ao Agente de Liquidação	N + 1du
Receber Mapa de Liquidação Financeira Residual	LF.02.07	Agente de Liquidação	<ul style="list-style-type: none"> Receber Mapa de Liquidação Financeira com o valor de crédito ou débito de cada Agente de Mercado. 	Mapa de Liquidação Financeira Residual	Mapa de Liquidação Financeira Residual recebido pelo Agente de Liquidação	N + 1du
Disponibilizar Recursos para o Agente de Liquidação	LF.02.08	Agente de Mercado Devedor	<ul style="list-style-type: none"> Disponibilizar os recursos financeiros a serem liquidados no âmbito do MAE, acrescidos de CPMF, para o Agente de liquidação. 	Conta Corrente Específica Específica	Recursos Disponibilizados para o Agente de Liquidação	Até N + 2 du (às 9:00)
Processar Liquidação Financeira dos Agentes Devedores	LF.02.09	Agente de Liquidação	<ul style="list-style-type: none"> Processar a Liquidação Financeira dos valores disponibilizados pelos Agentes de Mercado Devedores 	Conta Corrente Específica Específica	Liquidação Financeira de Agentes Devedores Processada	N + 2 du (às 10:00)

Minuta para Avaliação, Sujeita a Alteração

PROCEDIMENTO DE MERCADO – 3.0
“LIQUIDAÇÃO FINANCEIRA – SEM GARANTIAS – PERÍODO DE SET/00 ATÉ
DEZ/02- ”
(Art. 11 da Resolução ANEEL nº 552/2002)
PM – LF.02

Versão 1

ATIVIDADE	CÓDIGO	RESPONSÁVEL	DETALHAMENTO	FERRAMENTA	PRODUTOS GERADOS	PRAZO
Apurar Eventuais Montantes de Inadimplência	LF.02.10	Agente de Liquidação	<ul style="list-style-type: none"> Apurar a diferença entre a expectativa de recebimentos e o total de valores efetivamente recebidos. 		Eventuais montantes de Inadimplência apurados	N + 2du (até 14:00h)
Processar Transferência de Recursos aos Agentes Credores	LF.02.11	Agente de Liquidação	<ul style="list-style-type: none"> Processar a transferência dos recursos financeiros recebidos dos Agentes devedores aos Agentes credores, considerando os percentuais de Rateio da Inadimplência informados pela Superintendência do MAE. 	Conta Corrente Específica Específica	Transferência de Recursos aos Agentes Credores processada	N + 2du (até 18:00h)
Emitir Notas de Liquidação da Contabilização (NLC) para Agentes de Mercado	LF.02.16	Agente de Liquidação	<ul style="list-style-type: none"> Emitir as NLCs de acordo com os valores efetivamente liquidados. Enviar NLCs aos Agentes de Mercado. 	NLC	NLC Emitida para Agentes de Mercado	N + 2du (após 18:00h)
Receber NLC	LF.02.17	Agente de Mercado Devedor e Agente de Mercado Credor	<ul style="list-style-type: none"> Receber a NLC na agência em que o Agente de Mercado procedeu à abertura da Conta Corrente Específica específica. 	NLC	NLC Recebida pelos Agentes de Mercado	N + 2du (após 18:00h)
Enviar Resultado da Liquidação Financeira à Superintendência do MAE	LF.02.12	Agente de Liquidação	<ul style="list-style-type: none"> Gerar arquivo com o Resultado da Liquidação Financeira, detalhando pagamentos e recebimentos realizados e eventuais Inadimplências ocorridas. Enviar arquivo com o Resultado da Liquidação Financeira à Superintendência do MAE. 		Resultado da Liquidação Financeira enviado à Superintendência do MAE	N + 2du (após 18:00h)
Disponibilizar Relatórios de Liquidação Financeira aos Agentes de Mercado	LF.02.18	Superintendência do MAE	<ul style="list-style-type: none"> Gerar relatórios dos resultados da Liquidação Financeira. Disponibilizar relatórios dos resultados da Liquidação Financeira aos Agentes de Mercado através do sistema SCL. 	SCL Manual de Acesso aos Relatórios	Relatórios de Liquidação Financeira disponibilizados aos Agentes de Mercado	N + 3du
Encaminhar Casos de Inadimplência Para ANEEL	LF.02.19	Superintendência do MAE	<ul style="list-style-type: none"> Comunicar Inadimplências a ANEEL para aplicação de penalidades cabíveis previstas. 		Casos de Inadimplência encaminhados para a ANEEL	N + 4du

Legenda:

Minuta para Avaliação, Sujeita a Alteração

PROCEDIMENTO DE MERCADO – 3.0
“LIQUIDAÇÃO FINANCEIRA – SEM GARANTIAS – PERÍODO DE SET/00 ATÉ
DEZ/02- ”
(Art. 11 da Resolução ANEEL nº 552/2002)
PM – LF.02

Versão 1

N – Data da Liquidação Financeira Principal

du – Dias Úteis

11. CRONOGRAMA GERAL

PRODUTO GERADO	CRONOGRAMA												
Percentual de Rateio da Inadimplência calculado e enviado aos Agentes de Mercado	N – 3 du												
Percentual de Rateio da Inadimplência recebido pelos Agentes de Mercado	N – 3 du												
Arquivo de Liquidação Provisório gerado	N – 3 du												
Arquivo de Liquidação Provisório validado pelo Agente de Liquidação	N – 3 du												
Eventuais inconsistências do Arquivo de Liquidação Provisório Solucionadas	N – 3 du												
Mapa de Liquidação Financeira Principal emitido e enviado ao Agente de Liquidação	N – 3 du												
Mapa de Liquidação Financeira recebido pelo Agente de Liquidação	N – 3 du												
Recursos Disponibilizados para o Agente de Liquidação		Até N (às 9:00h)											
Liquidação Financeira de Agentes Devedores Processada			N (às 10:00h)										
Eventuais montantes de Inadimplência apurados				N (até 14:00h)									

PRODUTO GERADO	CRONOGRAMA											
Transferência de Recursos aos Agentes Credores processada					N (até 18:00h)							
Resultado da Liquidação Financeira enviado à Superintendência do MAE					N (até 18:00h)							
Ajuste de Rateio da Inadimplência calculado e encaminhado aos Agentes de Mercado						N + 1du						
Cálculo de Ajuste de Rateio da Inadimplência recebido pelos Agentes de Mercado						N + 1du						
Mapa de Liquidação Financeira Residual emitido e enviado ao Agente de Liquidação						N + 1du						
Mapa de Liquidação Financeira recebido pelo Agente de Liquidação						N + 1du						
Recursos Disponibilizados para o Agente de Liquidação							Até N + 2du (às 9:00h)					
Liquidação Financeira de Agentes Devedores Processada								N + 2du (às 10:00h)				
Eventuais montantes de Inadimplência apurados									N + 2du (até 14:00h)			
Transferência de Recursos aos Agentes Credores processada										N + 2du (até 18:00h)		
NLC Emitida para Agentes de Mercado											N + 2du (após 18:00h)	

PROCEDIMENTO DE MERCADO – 3.0
“LIQUIDAÇÃO FINANCEIRA – SEM GARANTIAS – PERÍODO DE SET/00 ATÉ
DEZ/02- ”
(Art. 11 da Resolução ANEEL nº 552/2002)
PM – LF.02

Versão 1

PRODUTO GERADO	CRONOGRAMA													
NLC Recebida pelos Agentes de Mercado												N + 2du (após 18:00h)		
Resultado da Liquidação Financeira enviado à Superintendência do MAE												N + 2du (após 18:00h)		
Relatórios de Liquidação Financeira disponibilizados aos Agentes de Mercado													N + 3du	
Casos de Inadimplência encaminhados para a ANEEL														N + 4du

Legenda:

N – Data da Liquidação Financeira Principal

du – Dias Úteis

12. ANEXOS

**INFORME CONTA CORRENTE ESPECÍFICA
(apresentação obrigatória por todos os Agentes)**

Razão Social:
CNPJ/MF:
Endereço:
Município - UF:
Inscrição no SINERCOM – MAE nº:
Nome do representante para Liquidação Financeira:
Fone: (.....)
Fax: (.....)
E-mail:
Número da conta-corrente junto ao Banco do Brasil:
Agência nº:

Por meio deste INFORME, comunicamos ao MERCADO ATACADISTA DE ENERGIA ELÉTRICA – MAE, o número de nossa conta-corrente e respectiva agência bancária, o qual fica autorizado a apresentá-lo e indicá-lo ao AGENTE DE LIQUIDAÇÃO, para fins de efetivação de débito e/ou crédito em meu nome e realização da Liquidação Financeira dos valores referentes às operações realizadas no mercado de curto prazo do MAE, no período de setembro/2000 a dezembro/2002, nos termos da Convenção de Mercado instituída pela Resolução ANEEL nº 102, de 1º/03/2002, da Resolução ANEEL nº 552, de 14/10/2002, do Procedimento de Mercado PM LF 02 e do Regulamento de Operações e Procedimentos Operacionais, cujos termos declaro ter pleno conhecimento.

.....(local e data).....

Identificação do nome do subscritor e assinatura com firma reconhecida
(responsável pela abertura/movimentação da conta-corrente)
CPF/MF nº:
Carteira de Identidade RG nº:

Identificação do nome do subscritor e assinatura com firma reconhecida
(responsável pela abertura/movimentação da conta-corrente)
CPF/MF nº:
Carteira de Identidade RG nº:

(*) O nome e a qualificação do Agente de Liquidação será informado oportunamente.

AUTORIZAÇÃO DE DÉBITO

Pelo presente instrumento, AUTORIZO desde já, de forma expressa e irrevogável, o(nome do Agente de Liquidação).....,(endereço e qualificação do Agente de Liquidação)..... (*), a efetuar débito na Conta-Corrente nº, Agência nº, de minha titularidade, para fins de Liquidação Financeira, total ou parcial, dos valores referentes à compra e venda de energia elétrica no mercado de curto prazo, conforme apuração realizada pelo MERCADO ATACADISTA DE ENERGIA ELÉTRICA – MAE, nos termos da Convenção de Mercado instituída pela Resolução ANEEL nº 102, de 1º/03/2002, da Resolução ANEEL nº 552, de 14/10/2002, do Procedimento de Mercado PM LF 02 e do Regulamento de Operações e Procedimentos Operacionais, cujos termos declaro ter pleno conhecimento.

O débito ora autorizado deverá ser realizado na data programada para a Liquidação Financeira e fica limitado aos valores depositados em minha conta-corrente e aos montantes informados pelo MAE no Mapa de Liquidação Financeira a ser encaminhado ao Agente de Liquidação, conforme a Liquidação Financeira do período considerado, ressalvado o devido provisionamento para efeito de recolhimento da Contribuição Provisória para Movimentação Financeira – CPMF, de minha integral responsabilidade.

.....(local e data).....

Nome completo do Agente de Mercado:.....
Inscrição no CNPJ/MF nº:
Inscrição no SINERCOM – MAE nº:.....
Endereço:
Nome do representante para contato:
Fone: (.....)
Fax: (.....)
E-mail:
Número da conta-corrente junto ao Banco do Brasil:
Agência nº:

Identificação do nome do subscritor e assinatura com firma reconhecida (representante do Agente de Mercado ou do Agente de Mercado Representante do Grupo de Agentes)
(responsável pela abertura/movimentação da conta-corrente)
CPF/MF nº:
Carteira de Identidade RG nº:

Identificação do nome do subscritor e assinatura com firma reconhecida (representante do Agente de Mercado ou do Agente de Mercado Representante do Grupo de Agentes)
(responsável pela abertura/movimentação da conta-corrente)
CPF/MF nº:
Carteira de Identidade RG nº:

(*) O nome e a qualificação do Agente de Liquidação será informado oportunamente.

DECLARAÇÃO DE CONSTITUIÇÃO DE GRUPO DE AGENTES

Pelo presente instrumento, os AGENTES DE MERCADO ao final identificados e representados por seus representantes legais, DECLARAM ao MERCADO ATACADISTA DE ENERGIA ELÉTRICA – MAE, associação civil sem fins lucrativos, com endereço na Alameda Santos, nº 745 - 11º andar, São Paulo, Estado de São Paulo, como de fato declarado está, que constituíram GRUPO DE AGENTES para fins de participação na LIQUIDAÇÃO FINANCEIRA dos valores referentes à compra e venda de energia elétrica no mercado de curto prazo, relativamente ao período de setembro/2000 a setembro/2002, nos termos da Convenção de Mercado instituída pela Resolução ANEEL nº 102, de 1º/03/2002, da Resolução ANEEL nº 552, de 14/10/2002, da Resolução ANEEL nº 610, de 06/11/2002, do Procedimento de Mercado PM LF 02 e do Regulamento de Operações e Procedimentos Operacionais, cujos termos declaram ter pleno conhecimento, utilizando na presente os mesmos termos e significados constantes do PM LF 02.

Os signatários também DECLARAM expressamente que nomearam como seu AGENTE DE MERCADO REPRESENTANTE a(nome da empresa)....., com endereço na,(cidade e Estado)....., inscrita no CNPJ/MF sob nº, número de registro no SINERCOM-MAE:, ao qual outorgaram os poderes para a prática dos seguintes atos e de outros eventualmente necessários à realização da LIQUIDAÇÃO FINANCEIRA:

- i) responsabilizar-se perante o AGENTE DE LIQUIDAÇÃO e a SUPERINTENDÊNCIA DO MAE pela prática dos atos necessários à LIQUIDAÇÃO FINANCEIRA, por si e em nome e por conta dos AGENTES DE MERCADO representados;
- ii) apresentação da AUTORIZAÇÃO DE DÉBITO;
- iii) apresentação de INFORME DE ABERTURA DE CONTA CORRENTE ESPECÍFICA;
- iv) realização do depósito relativo ao VALOR LÍQUIDO DE DÉBITO;
- v) recebimento do VALOR LÍQUIDO DE CRÉDITO;
- vi) recebimento das informações relativas ao RATEIO DA INADIMPLÊNCIA e dos eventuais AJUSTES PARA LIQUIDAÇÃO RESIDUAL;
- vii) aporte dos recursos necessários à realização da LIQUIDAÇÃO RESIDUAL;
- viii) recebimento da NLC.

Os signatários também DECLARAM expressamente que:

- i) possuem integral responsabilidade pela assunção das obrigações decorrentes da INADIMPLÊNCIA, em especial pelos AGENTES DE MERCADO devedores, contra os quais serão emitidas as faturas bilaterais por parte dos AGENTES DE MERCADO credores, autorizando o MAE, desde já, a fornecer seus dados aos AGENTES DE MERCADO credores afetados pela INADIMPLÊNCIA, para fins de emissão das respectivas faturas bilaterais;
- ii) assumem total responsabilidade pelas obrigações de natureza tributária, em especial pelo depósito dos valores relativos à Contribuição Provisória sobre Movimentação Financeira – CPMF incidentes sobre os valores depositados junto ao Agente de Liquidação para a Liquidação Financeira;
- iii) assumem integral responsabilidade pelas obrigações assumidas pelos AGENTES DE MERCADO perante terceiros, incluindo, mas não se limitando, aos terceiros cessionários de direitos, sejam ou não de conhecimento dos respectivos Agentes;

PROCEDIMENTO DE MERCADO – 3.0 “LIQUIDAÇÃO FINANCEIRA – SEM GARANTIAS – PERÍODO DE SET/00 ATÉ DEZ/02- ” (Art. 11 da Resolução ANEEL nº 552/2002) PM – LF.02	Versão 1
---	-----------------

- iv) têm pleno conhecimento e concordam expressamente que a negociação efetuada entre os integrantes do GRUPO DE AGENTES representa a plena realização de seus respectivos créditos e débitos apurados na Contabilização do MAE, implicando a quitação no que diz respeito aos valores efetivamente compensados, para o que haverá irrevogabilidade e irretratabilidade, para todos os fins e efeitos;
- v) sob qualquer condição e qualquer tempo, exoneram o MAE quanto a quaisquer implicações decorrentes da prática dos atos inerentes à negociação havida, com indicação expressa de que os mesmos são de total e exclusiva responsabilidade dos AGENTES DE MERCADO envolvidos;
- vi) têm plena ciência de que os negócios jurídicos realizados entre os AGENTES DE MERCADO declarantes não obrigam o MAE, a qualquer título e sob qualquer condição.

Eventuais Inadimplências ocorridas após a realização da Liquidação Residual deverão ser liquidadas bilateralmente entre os AGENTES DE MERCADO, com base em Relatório de Liquidação Financeira a ser disponibilizado pela Superintendência do MAE para cada AGENTE DE MERCADO.

.....(local e data).....

Nome completo do AGENTE DE MERCADO:.....
Inscrição no CNPJ/MF nº:
Inscrição no SINERCOM – MAE nº:.....
Endereço:
Nome do representante para contato:
Fone: (.....)
Fax: (.....)
E-mail:

Identificação do nome do subscritor e assinatura com firma reconhecida
(responsável pela abertura/movimentação da conta-corrente)
CPF/MF nº:
Carteira de Identidade RG nº:

(A Declaração deverá ser assinada por todos os integrantes do Grupo de Agentes)

PROCEDIMENTO DE MERCADO – 3.0 “LIQUIDAÇÃO FINANCEIRA – SEM GARANTIAS – PERÍODO DE SET/00 ATÉ DEZ/02- ” (Art. 11 da Resolução ANEEL nº 552/2002) PM – LF.02	Versão 1
---	-----------------

Relatório do Resultado de Liquidação Financeira

Documento em elaboração pelo MAE a ser disponibilizado futuramente.

Metodologia de Cálculo de Rateio da Inadimplência

CÁLCULO DO PERCENTUAL DE RATEIO DA INADIMPLÊNCIA PARA A LIQUIDAÇÃO PRINCIPAL.

Crédito Líquido de cada de Agente de Mercado (período)

= Percentual de Rateio da Inadimplência para
Liquidação Principal

Σ Valores a receber pelos credores líquidos e plenos (período)

CÁLCULO DO RATEIO DA INADIMPLÊNCIA PARA A LIQUIDAÇÃO RESIDUAL.

Valor a ser debitado dos Agentes Devedores Líquidos e eventualmente de Agentes Credores e repassados proporcionalmente aos credores:

Σ créditos do Agente de Mercado ou Grupo de Agentes (período) – MRE (período)

X Total de Inadimplência

Σ créditos de todas as parcelas credoras de todos os Agentes de Mercado (período) – MRE (período)