

AGÊNCIA NACIONAL DE ENERGIA ELÉTRICA – ANEEL

RESOLUÇÃO Nº , DE DE JANEIRO DE 2003

Estabelece critérios para a definição, de forma transitória, das garantias financeiras a que se refere o art. 2º da Convenção do Mercado Atacadista de Energia Elétrica - MAE e dá outras providências.

O DIRETOR-GERAL DA AGÊNCIA NACIONAL DE ENERGIA ELÉTRICA - ANEEL, no uso de suas atribuições regimentais, de acordo com deliberação da Diretoria; considerando-se o que determina os incisos I e VIII do art. 3º da Lei nº 9.427, de 26 de dezembro de 1996; em conformidade com o que consta no Processo nº 48500.003843/02-52; em cumprimento ao disposto no art. 1º da Lei nº 10.433, de 23 de abril de 2002 e no art. 3º da Convenção do Mercado Atacadista de Energia Elétrica – MAE, aprovada pela resolução ANEEL nº 102, de 1º de março de 2002; e considerando que:

nos termos da Convenção do Mercado Atacadista de Energia Elétrica, instituída pela Resolução ANEEL nº 102, de 1º de março de 2002, o MAE tem a atribuição de proceder à liquidação das operações realizadas no âmbito do aludido mercado;

a mesma convenção estabelece, no caput e no § 1º do art. 7º, a obrigatoriedade da constituição de garantias e que é atribuição da ANEEL a fixação das mesmas, bem como das penalidades vinculadas à sistemática de liquidação e garantias financeiras do MAE; e

a Audiência Pública por intercâmbio documental AP 33/2002, realizada entre 19 dezembro de 2002 e 8 de janeiro de 2003, resolve:

Art. 1º Estabelecer, de forma transitória, que, para as transações de compra e de venda de energia elétrica realizadas a partir de 1º janeiro de 2003 no âmbito do Mercado e até que o Regulamento da Liquidação Financeira seja aprovado pela ANEEL, as garantias financeiras de que trata o art. 2º da Convenção do Mercado Atacadista de Energia Elétrica - MAE, serão definidas a partir dos seguintes critérios, limites, condições e prazos:

§1º – o montante das garantias de que trata o caput serão calculadas da seguinte forma:

I – para os Agentes da Categoria Produção: na proporção de 5% de suas respectivas energias asseguradas ou volume contratual de importação, em MWh mensais, multiplicada pelo Preço de Mercado (PMAE) da última semana do mês anterior ao mês de referência, definido no Procedimento de Mercado PM – CZ.01 ‘Cronograma Geral de Contabilização’, aprovado pelo Despacho ANEEL nº 724, de 13 de novembro de 2002;

II – para os Agentes da Categoria Consumo: na proporção de 5% do volume de demanda, em MWh mensais, registrado no “Sistema SIMPLES, Formulário 11: Carga Própria, Sistema Interligado”, publicado em conjunto por CTEM, CCPE, ELETROBRÁS e MME, multiplicado pelo Preço de Mercado (PMAE) referenciado no inciso I;

III - para os Agentes Comercializadores: na proporção da média mensal do valor econômico das transações dos últimos três meses em que o agente foi comprador no mercado de curto prazo, ou, no caso de não haver histórico de compra e venda para o agente, na proporção de 5% dos montantes (em MWh) em contratos de venda de energia registrados no MAE.

§2º O montante das garantias de que trata o caput deve ser representado pelos seguintes ativos financeiros, observada a seguinte ordem de preferência:

I - recursos em moeda corrente nacional;

II - títulos públicos de emissão do Tesouro Nacional ou do Banco Central do Brasil;

III - créditos securitizados pelo Tesouro Nacional;

IV - demais valores mobiliários de renda fixa de emissão ou coobrigação de instituição financeira ou outra instituição autorizada a funcionar pelo Banco Central do Brasil que possuam classificação de risco efetuada por agência classificadora de risco em funcionamento no País igual ou superior a obtida pelos títulos referidos nos incisos II e III desse parágrafo;

V - depósitos de poupança em instituição financeira enquadrável na condição referida no inciso IV;

VI - debêntures, certificados de recebíveis e outros valores mobiliários de renda fixa de emissão de sociedades anônimas, inclusive as de objeto exclusivo, que possuam classificação de risco efetuada por agência classificadora de risco em funcionamento no País igual ou superior a obtida pelos títulos referidos nos incisos II a III desse parágrafo; e

VII- carta de fiança ou de crédito emitida por instituição financeira ou outra instituição autorizada a funcionar pelo Banco Central do Brasil

§ 3º Para cada mês, a data limite para a apresentação das garantias financeiras não poderá ultrapassar o último dia útil do mês anterior ao mês de referência definido no Procedimento de Mercado PM – CZ.01 ‘Cronograma Geral de Contabilização’, aprovado pelo Despacho ANEEL nº 724, de 13 de novembro de 2002.

§ 4º Para o mês de referência janeiro de 2003, em caráter excepcional, a data limite para a apresentação das garantias financeiras é 24 de janeiro de 2003.

§ 5º O montante das garantias referidas no caput deverá ser calculado a cada mês pelo MAE, de forma a atualizá-lo ou corrigir eventuais distorções e comunicado aos agentes com antecedência mínima de cinco dias úteis à data limite.

§ 6º a insuficiência do montante das garantias referidas no caput implica a renovação ou complementação das mesmas até cinco dias úteis contados a partir da data de sua verificação.

§ 7º - será considerada infração a não apresentação de garantias na forma, condições, limites e prazos previstos nesta Resolução.

Art. 2º Até que sejam definidos os critérios para contratação do agente custodiante e liquidante pelo MAE, os ativos financeiros estabelecidos nos incisos I a VI do § 3º do artigo anterior devem:

I - ser registrados no Sistema Especial de Liquidação e de Custódia (SELIC) ou em sistema de registro e de liquidação financeira administrado pela Central de Custódia e de Liquidação Financeira de Títulos - CETIP;

II - ser custodiados ou mantidos em conta de depósito em instituições ou entidades autorizadas a prestação desses serviços pelo Banco Central do Brasil ou pela Comissão de Valores Mobiliários.

Parágrafo único. Os recursos, quando em moeda corrente nacional, devem permanecer obrigatoriamente depositados em instituições financeiras bancárias em conta remunerada.

Art. 3º As garantias financeiras apresentadas serão sujeitas à fiscalização da ANEEL e devem ser:

I- aprovadas pelo MAE, discriminadas, controladas e contabilizadas individualmente para cada agente;

II- seguir os critérios adotados pelas instituições referidas no artigo anterior.

Art. 4º É vedado ao agente:

I- prestar fiança, aval, aceite ou coobrigar-se sob qualquer outra forma utilizando o montante de garantias de que trata esta Resolução; ou

II- locar, emprestar ou caucionar títulos e valores mobiliários integrantes dos ativos financeiros que compõem o montante de garantias de que trata esta Resolução.

Art. 5º O MAE deverá manter contratada pessoa jurídica credenciada na Comissão de Valores Mobiliários para prestação do serviço de Auditoria Independente, a qual ficará incumbida, adicionalmente às atribuições de auditoria que lhe são próprias, de avaliar a pertinência dos procedimentos técnicos, operacionais e de controle utilizados na gestão das garantias de que trata esta Resolução.

Art.6º A não observância das disposições desta Resolução sujeitará os agentes participantes do MAE e seus administradores às sanções previstas na Resolução ANEEL nº 318, de 6 de outubro de 1998, ou outro instrumento que a substitua.

Art. 7º Esta Resolução entra em vigor na data de sua publicação.

JOSÉ MÁRIO MIRANDA ABDO