



Seminários PPGE - Programa de Pós-Graduação em Estatística

Quanto dói um choque de eletricidade? Modelagem e estimação do risco de mercado de energia no Brasil

Henrique Leme

DCIDE

30/05/2025 - sexta-feira

11h - Sala 253

Resumo: O mercado de energia elétrica no Brasil vem amadurecendo e exigindo maior sofisticação, especialmente na gestão do risco de mercado — ou risco de preços — associado a portfólios energéticos. Embora pouco explorado academicamente, esse tema é crucial para evitar perdas financeiras expressivas.

Este seminário aborda, a partir do contexto do setor, técnicas estatísticas para modelar a distribuição conjunta de preços de mercado, incorporando características empíricas relevantes. Também explora métodos para estimar métricas clássicas de risco, como o VaR e o CVaR, e discute desafios acadêmicos, oportunidades de pesquisa e o perfil profissional necessário para atuar nessa área estratégica.