



Model wyceny aukcji day-ahead dla rynku niemieckiego energii elektrycznej z uwzględnieniem mechanizmu Flow Based Market Coupling.

Zadanie nr 8

Forma prezentacji	1. Analiza/ opracowanie. 2. Prezentacja PowerPoint.
Wymagania	Budowa modelu ekonometrycznego wyceny produktu Day Ahead Auction (EPEX) z uwzględnieniem mechanizmu Flow Based Market Coupling.
Opis zadania <i>(wymagania podstawowe)</i>	Budowa modelu ekonometrycznego do wyceny produktu Day Ahead Auction (EPEX) w oparciu o dostępne dane. Implementacja do modelu mechanizmu Flow Based Market Coupling. Opis zależności jakie zachodzą pomiędzy FBMC a poziomem cen na DAM. Przeprowadzenie analizy wrażliwości ceny DAM na zmianę poziomu ubytków wybranych technologii wytwarzania energii elektrycznej. Przeprowadzenie analizy wrażliwości CENY DAM na poziom generacji wiatrowej i fotowoltaicznej. Zbadanie sezonowości poziomu cen w ujęciu tygodniowym w zależności od okresu (kwartał, miesiąc) Zbadanie prawdopodobieństwa wystąpienia serii n dni wzrostowych/spadkowych.
Dodatkowe punkty <i>(wymagania dodatkowe)</i>	Zestawienie stosu cenowego w oparciu o dostępne moce wytwórcze wybranych technologii wytwarzania energii elektrycznej. Przeanalizowanie progów opłacalności produkcji wybranych technologii.
Cel zadania	Budowa modelu ekonometrycznego (xls, Java lub R), o możliwie najmniejszym błędzie prognozy.
Osoba do kontaktu w GK ENEA	Departament Prop-Tradingu Tomasz Pianka tel. 61 884 53 49
Minimalny czas na realizację zadania	3,5 miesięcy
Rekomendowana liczba uczestników realizująca zadanie	4
Uwagi	Możliwość połączenia zadania z: Analiza scenariuszowa rozwoju rynku węgla kamiennego do 2050 roku na świecie i w Europie. Analiza scenariuszowa rozwoju rynku gazu ziemnego do 2050 roku na świecie i w Europie.