

Abstrakt

V rámci předpovídání cen elektřiny analyzujeme, zda přidání různých proměnných zlepšuje předpovědi, a zda kratší časové intervaly mezi pozorováními zlepšují přesnost předpovědí. Dále se zaměřujeme na správný výběr zpožděných pozorování, který doposud nebyl v literatuře důkladně popsán. Mnoho článků navíc studovalo ceny elektřiny pouze na větších trzích (např. USA, Austrálie, Nord Pool atd.), a to na datech s omezeným rozsahem a s časovým rozpětím pouze 2–3 roky. Abychom odstranili tyto mezery v literatuře, sestavujeme jeden denní a jeden hodinový datový soubor, oba pokrývající šestileté období (1. ledna 2015 – 31. prosince 2020), ze čtyř zemí střední a východní Evropy – České republiky, Slovenské republiky, Maďarska a Rumunska. Ty obsahují informace o cenách elektřiny a o našich sledovaných přidaných proměnných – teplotě a přeshraničních tocích elektřiny. Pro předpovídání používáme dvě různé metody – Autoregrese (AR) a Zdánlivě Nesouvisející Regrese (SUR). Důkladný výběr zpožděných pozorování, které přizpůsobujeme době uzavření aukčního obchodu s elektřinou, slouží dalším studiím jako návod, jak se vyhnout možným chybám a nekonzistenci v jejich předpovědích. V našich analýzách modely AR i SUR ukazují, že hodinové údaje nabízejí přesnější výsledky a že teplota obecně zlepšuje přesnost předpovědi více než přeshraniční toky.

Klasifikace JEL C51, C53, Q41, Q47

Klíčová slova Předpovídání Cen Elektřiny, střední Evropa, východní Evropa, Trh s Elektřinou, Denní Trh, Teplota, Přeshraniční Tok