

Abstrakt

Specifické vlastnosti spotových cen elektřiny, a to především častý výskyt skoků, vytváří vysoké riziko pro obchodníky s elektřinou, kteří ji nakupují za neregulované velmi proměnlivé ceny, ale spotřebiteli ji prodávají za ceny pevně stanovené. Proto je velmi důležité predikovat, jaká je pravděpodobnost výskytu skoku během následujících hodin. Pokud je nám však známo, dosud žádná studie nebyla zaměřena na Českou republiku, a proto je hlavním cílem této práce predikovat pravděpodobnost výskytu skoku na českém denním trhu. Za tímto účelem definujeme čtyři logit modely, kde každý z nich obsahuje různé nezávislé proměnné (jako je spotřeba elektřiny, venkovní teplota nebo dummy proměnné) a kde je výběr proměnných proveden v souvislosti s předchozí literaturou a na základě specifických vlastností cen. „In-sample“ porovnání modelů je založeno na hodnotách dvou testů, a to na pseudo-R squared a Bayesovském informačním kritériu. V případě ohodnocování „out-of-sample“ kvality modelů vypočítáváme přesnost a důvěryhodnost predikce skoků, statistiky používané v souvislosti s predikováním. Avšak na rozdíl od předchozí literatury se uchýlíme k určitému druhu sensitivní analýzy, která, pokud je nám známo, ještě nebyla v literatuře zaměřené na trh s elektřinou použita.

Klasifikace JEL	C25, C32, C51, C52, C53, Q41, Q47
Klíčová slova	Cena elektřiny, skoky, předpovídání výskytu skoku, denní trh v České republice, logit modely
E-mail autora	Janca.Hortova@seznam.cz
E-mail vedoucího práce	ladislav.kristoufek@fsv.cuni.cz