

## Abstrakt

V této práci je zevrubně popsána existující literatura na téma předpovídání ceny elektřiny, její dělení a nestandardní aspekty. Zároveň byly srovnány některé modely – ARIMA, SVR, SVRARIMA a PSF. Toto srovnání jsme provedli na vnitrodenních datech trhu Nord Pool. Tento přístup je výjimečný, protože téměř ke každému krátkodobému modelování cen elektřiny jsou využita data z trhu na jeden den dopředu. Naše výsledky jsou robustní, protože jsme použili 100 testovacích období a rozdíly v přesnosti předpovídání jsme otestovali modifikovaným DM testem. Náš závěr je, že PSF model je nevhodný k tomuto typu předpovídání a ARIMA model je celkově nejlepší. Jak SVR tak SVRARIMA model jsou marginálně horší. Rozdíl mezi těmito modely není velký a další studie, zaměřené na identifikaci důvodů těchto rozdílů, mohou přinést lepší pochopení chování těchto modelů.