

Wykorzystanie informacji o różnych częstotliwościach w prognozowaniu cen energii elektrycznej

Do modelowania dziennych cen energii elektrycznej wykorzystuje się zmienne objaśniające tej samej częstotliwości. Zapotrzebowanie na coraz dokładniejsze metody prognozowania sprawia, że zasadne staje się poszukiwanie i zastosowanie metod ekonometrycznych pozwalających na wykorzystanie informacji o różnych częstotliwościach publikacji.

Celem pracy jest przedstawienie i zastosowanie modelu, który pozwoli wykorzystać dane o niższej częstotliwości do modelowania i prognozowania dziennych wartości indeksu TGE24, a także średnich dziennych cen energii elektrycznej na włoskiej giełdzie energii.

Uzyskane prognozy punktowe zostaną porównane z wynikami otrzymanymi za pomocą najczęściej stosowanych w literaturze przedmiotu modeli.