

Artykuł - szczegóły



Czasopismo	Rynek Energii
Tytuł artykułu	Wykorzystanie modelu rozkładu kanonicznego wektora zmiennych losowych do prognozy cen na rynku dnia następnego
Autorzy	Popławski, T. , Łyp, J. , Kurach, M.
Warianty tytułu	EN Using model of canonical distribution of a random vector for the forecasting prices on the day-ahead market
Języki publikacji	PL
Abstrakty	<p>PL Artykuł porusza problematykę prognozowania cen na rynku energii elektrycznej z uwzględnieniem zmian zachodzących, między innymi, na Rynku Dnia Następnego (RDN). Zaproponowano model prognostyczny rozkładu kanonicznego wektora zmiennych losowych (MRK) dla przewidywania cen w horyzoncie dobowym. Model zweryfikowano na kilku wybranych prognozach cen na Towarowej Giełdzie Energii.</p> <p>EN The article raises the problem of forecasting the electricity prices in energy market, with consideration changes, inter alia, Day-Ahead Market (DAM). Proposed forecasting model, based on the canonical distribution of a random vector variables, to predict prices in the daily horizon. The model was verified on the several selected price forecasts for the Polish Power Exchange.</p>
Słowa kluczowe	PL rynek energii modelowanie prognozowanie krótkoterminowe EN energy market Day-Ahead Market (DAM) modeling short-term forecasting
Wydawca	KAPRINT
Czasopismo	Rynek Energii , ISSN 1425-5960
Rocznik	2012
Tom	Nr 1
Strony	54--58
Opis fizyczny	Bibliogr. 13 poz., rys., tab.
Twórcy	autor Popławski, T. Instytut Elektroenergetyki, Wydział Elektryczny Politechniki Częstochowskiej, poptom@el.pcz.czest.pl autor Łyp, J. Instytut Elektroenergetyki, Wydział Elektryczny Politechniki Częstochowskiej, jackrat@el.pcz.czest.pl autor Kurach, M. Instytut Elektroenergetyki, Wydział Elektryczny Politechniki Częstochowskiej, kurachm@gmail.com
Bibliografia	[1] Arabas J, Adamowicz Ł., Planowanie Pozycji kontraktowej przy zróżnicowanych cenach rynku bilansującego, Elektroenergetyka (2003), nr 3(46). [2] Cieślak M, i inni, : Prognozowanie gospodarcze. Metody i zastosowanie, Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa 2001. [3] Chodakowska E., Halicka K., Kononiuk A., Nazarko J.: Zastosowanie modeli klasy GARCH do prognozowania cen energii elektrycznej na Towarowej Giełdzie Energii S.A. w: L. Kiełtyka, J. Nazarko (red.), Technologie informatyczne i prognozowanie w zarządzaniu. Wybrane zagadnienia Wyd. Politechniki Białostockiej, Białystok 2005. [4] Dobrzańska I.: Zastosowanie formy kanonicznej wektora losowego w niektórych modelach optymalizacji. Badania Operacyjne i Decyzje, 1:13–16, 1992. [5] Dobrzańska I., Dąsal K., Łyp J., Popławski T., Sowiński J.: Prognozowanie w elektroenergetyce. Zagadnienia wybrane. Wydawnictwo Politechniki Częstochowskiej, Częstochowa 2002. [6] Dudek G.: Analiza modelu krótkoterminowego prognozowania obciążeń systemów elektroenergetycznych opartego na klasteryzacji rozmytej. Badania Operacyjne i Decyzje, nr 2, str. 15-34, 2007. [7] Popławski T.: Methods of analysis and forecast of power engineering load variation in the conditions of energy market transformation. Wydawnictwo Politechniki Częstochowskiej, (2009). [8] Popławski T. (redaktor): Wybrane zagadnienia prognozowania długoterminowego w systemach elektroenergetycznych. Wydawnictwo Politechniki Częstochowskiej, 2012 (w druku). [9] Popławski T., Dąsal K., Medvec Z.: The New Aspects using MRK Model for Short-Term Load Forecasting in the Power System. Energy Spectrum, Vol. 4 nr 2:68–72, 2009. [10] Sowiński J.: Forecasting models of prices in analysis of power system investments under uncertainty. Polityka Energetyczna, IGSMiE PAN, Tom 6, 2003, PL ISSN 1429-6675, p. 85-94 [11] Towarowa Giełda Energii S.A. Regulamin obrotu Rynku Towarów Giełdowych Towarowej Giełdy Energii S.A. Regulamin zatwierdzony decyzją Komisji Nadzoru Finansowego z dnia 07 listopada 2011 r. wchodzi w życie w dniu 1 grudnia 2011 r.

finansowego z dnia 07 listopada 2011 r. wchodzi w życie w dniu 1 grudnia 2011 r.
[12] Ustawa z dnia 10 kwietnia 1997 r. Prawo energetyczne. Z późniejszymi zmianami.

[13] Weron A., Wołomańska A.: Minimalne prawdopodobieństwo straty producenta na rynku bilansującym. Energetyka (2002), nr 12(582).

Kolekcja

**Identyfikator
YADDA**

BazTech

bwmeta1.element.baztech-a5109d51-0846-43a9-8aac-6ea78af5d62d



Otwarta
nauka



© Wszelkie prawa zastrzeżone przez Konsorcjum BazTech | Baza utrzymywana i dystrybuowana przez ICM UW | System oparty na platformie YADDA default, ver. 1.12.5-SNAPSHOT, rev. 36521 | © ICM UW 2005-2013