

Preisprognosen & -limiten für Strom- und Gasmärkte

(Stand 26. Januar 2012)

Die Delta Energy Solution und ior/cf-HSG haben in den letzten Jahren die Kernkompetenzen in der Schätzung und Modellierung von Strom- und Gaspreisdynamiken ausgebaut. Diese Kernkompetenzen werden in Form von "Preisprognosen" sowie "Preislimiten" für den Intra-Day Handel angeboten.

Gegenwärtig werden folgende Produkte für den Strom-Markt abgedeckt:

EEX-Phelix (Forward-Markt)

- Price-Forward-Kurve (in stündlicher Granularität)
- Öko-Price-Forward-Kurve (in stündlicher Granularität)
- Spike-basierte Price-Forward-Kurve (in stündlicher Granularität) laufendes Jahr und fünf Folgejahre
- Forward Risikoprofile (in stündlicher Granularität)
- Cash-Flow-at-Risk (95% Niveau) für Standardprodukte (getrennt nach SHORT und LONG Positionen)
- Volatilitätsstrukturen der Standardprodukte
- Spike-Charakteristik um die HPFC

Marktgebiet Frankreich (Forward-Markt)

- Price-Forward-Kurve (in stündlicher Granularität)
- Spike-basierte Price-Forward-Kurve (in stündlicher Granularität) laufendes Jahr und fünf Folgejahre
- Forward Risikoprofile (in stündlicher Granularität)
- Cash-Flow-at-Risk (95% Niveau) für Standardprodukte (getrennt nach SHORT und LONG Positionen)
- Volatilitätsstrukturen der Standardprodukte
- Spike-Charakteristik um die HPFC

SWISSIX (synthetischer Forward-Markt)

- Price-Forward-Kurve (in stündlicher Granularität)
- Spike-basierte Price-Forward-Kurve (in stündlicher Granularität) laufendes Jahr und fünf Folgejahre
- Forward Risikoprofile (in stündlicher Granularität)
- Cash-Flow-at-Risk (95% Niveau) für synthetische Standardprodukte (getrennt nach SHORT und LONG Positionen)
- Volatilitätsstrukturen der synthetischen Standardprodukte
- Spike-Charakteristik um die HPFC

EEX-Phelix & EEX-Swissix (day-ahead Spot-Markt)

- 3-Tages-Prognosen in Form von Intervall-Prognosen (in stündlicher Granularität für die folgenden 3 Handelstage)
- modale Punktprognose
- Spot-Risikoprofile (in stündlicher Granularität für die folgenden 3 Handelstage)
- Cash-Flow-at-Risk (95% Niveau) für die stündlichen Markt-Clearing-Preise (getrennt nach SHORT und LONG Positionen)
- Volatilitätsstrukturen der stündlichen Markt-Clearing-Preise
- Preislimiten für Intra-Day Handel

Trigger-Preise für Intra-Day Trading (EEX-Phelix)

- Trigger-Preise für Closing von Open Short Positionen
- Trigger-Preise für Closing von Open Long Positionen
- Trigger-Preise für Holding von Open Short Positionen
- Trigger-Preise für Holding von Open Long Positionen

Gegenwärtig werden folgende Produkte für den Gas-Markt abgedeckt:

TTF (Forward-Markt)

- Price-Forward-Kurve (in täglicher Granularität für zyklisches & antizyklisches Regime) für laufendes Jahr und drei Folgejahre
- Forward Risikoprofile (in täglicher Granularität)
- Cash-Flow-at-Risk (95% Niveau) für Standardprodukte (getrennt nach SHORT und LONG Positionen)
- Volatilitätsstrukturen der Standardprodukte

NCG & GPL (Forward-Markt)

- Price-Forward-Kurve (in täglicher Granularität für zyklisches und antizyklisches Regime) für laufendes Jahr und drei Folgejahre
- Forward Risikoprofile (in täglicher Granularität)
- Cash-Flow-at-Risk (95% Niveau) für Standardprodukte (getrennt nach SHORT und LONG Positionen)
- Volatilitätsstrukturen der Standardprodukte

Im Zuge der bevorstehenden Neuordnung im Energiesektor und deren Implikationen für die Strom- und Gaswirtschaft offerieren wir unsere Forwardpreis-Kurven und ihre Dynamik neu auch als Package.

Hierzu werden alle Zeitreihen für Gas-PFCs zu NCG, GPL, TTF (incl. Risikoprofil, Konfidenzband, Volatilitätsstrukturen) sowie für reguläre, öko-basierte und spikebasierte HPFCs zu EEX-Phelix und SWISSIX (incl. Risikoprofil, Konfidenzband, Volatilitätsstrukturen und Spike-Charakteristik) in repräsentativer Lieferform für die Stichtage 31. März, 1. und 4. April 2011 allen Interessenten öffentlich unter <http://dynamics.iorcf.eu> als Download zur Verfügung gestellt.

Alle Zeitreihen für Spotpreis-Prognosen zu EEX-Phelix & SWISSIX und den Preislimiten für den Intra-Day Handel (EEX Strom) werden täglich unter <http://dynamics.iorcf.eu> aktualisiert. Die entsprechenden Historien sind für Dynamics-Kunden via Download beziehbar.

Die Lieferung der PFCs, der Spotpreis-Prognosen und der Intra-Day Preislimiten erfolgt jeweils (in ausgewählten Formaten) um circa 22.00 Uhr nach Vorliegen des offiziellen EEX-Reports. Auf individueller Basis werden auch weitere Europäische Märkte miteinbezogen werden. Richten Sie Ihre Fragen bitte an:

Delta Energy Solution AG

Klaus Kiske, Sales & Marketing Manager, k.kiske@delta-energy.ch

Phone: +49 (0)511 235 32 35, Mobile: +49 (0)172 158 72 86,

St. Gallen, Basel
26. Januar 2012