

Кудрин Н.В., Максимов А.Г.
Нижний Новгород, НИУ-ВШЭ – Нижний Новгород

МОДЕЛИРОВАНИЕ ДИНАМИКИ ЦЕНЫ НА РЫНКЕ ЭЛЕКТРОЭНЕРГИИ

Поведение цен на рынках электроэнергии, не подвергающихся значительному государственному регулированию, отличается сезонностью, высокой волатильностью и скачкообразностью. Данное обстоятельство значительно осложняет моделирование ценообразования с использованием существующих стандартных механизмов. В работе сделана попытка применения стохастической системы ФитцХью-Нагумо для моделирования динамики ценовых изменений на рынках электричества.

Ключевые слова: рынок электроэнергии, модель ФитцХью-Нагумо, динамика цен

Kudrin N.V., Maksimov A.G.
Nizhny Novgorod, HSE - Nizhny Novgorod

MODELING THE DYNAMICS OF PRICES ON ELECTRICITY MARKET

The behavior of electricity prices on the liberalized power markets are characterized by seasonality, high volatility and jumps. These features make it very difficult to model price formation using current conventional mechanisms. The subject of this paper is the implementation of the stochastic FitzHugh-Nagumo model for modeling price dynamics on electricity markets.

Keywords: electricity market, FitzHugh-Nagumo model, price dynamics