

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

## **МОДЕЛИРОВАНИЕ ДИНАМИКИ ЦЕНЫ НА ЭЛЕКТРОЭНЕРГИЮ. SETARX МОДЕЛЬ**

Поведение цен на рынках электроэнергии, не подвергающихся значительному государственному регулированию, отличается сезонностью, высокой волатильностью и скачкообразностью. Данное обстоятельство значительно осложняет моделирование ценообразования с использованием стандартных механизмов. В работе приведены результаты применения SETARX модели.

**Ключевые слова:** рынок электроэнергии, моделирование ценообразования, SETARX модель

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

## **MODELING ELECTRICITY PRICE DYNAMICS. SETARX MODEL**

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 conventional mechanisms. In this paper some result of the Self-Exciting Threshold Autoregressive (SETARX) model implementation are presented.

**Keywords:** power market, prices modeling, SETARX model