

Cím: Energiapiaci portfólió kockázat kezelése

Témavezető: Mádi-Nagy Gergely

Kivonat:

Egy energiakereskedő portfóliója a fogyasztóival, ügyfeleivel kötött üzletekből adódó kitettségből illetve az ezt lefedezni szándékozó származékos termékekből áll. A bemutatott alkalmazás minimalizálja a portfólió árkockázatát egy adott időperiódusra, úgy hogy figyelembe veszi a piacokon elérhető termékek körét, illetve az egyes termékek likviditását.

A kockázatot a Conditional-Value-at-Risk mutatóval mérjük. A likviditást kezelését a piaci ármodellbe építjük be.

A projekt célja: az üzleti környezet bemutatása, a modell leírása, az adódó nemlineáris programozási feladat implementációja, hatékony megoldása, tesztelése, árszenáriók generálása.

A projekthez szükséges:

- Python programozás (projekt közben is megtanulható),
- cikkek olvasása angol nyelven.

Irodalom:

http://scinet.dost.gov.ph/union/Downloads/science_006_314031.pdf