1. Record Nr. UNINA9910346914803321

Autore	Seifert Jan
Titolo	Preismodellierung und Derivatebewertung im Strommarkt - Theorie und Empirie
Pubbl/distr/stampa	KIT Scientific Publishing, 2010
ISBN	1000018070
Descrizione fisica	1 online resource (XVI, 209 p. p.)
Lingua di pubblicazione	Tedesco
Formato	Materiale a stampa
Livello bibliografico	Monografia
Sommario/riassunto	Strommarkte zeichnen sich durch eine sehr komplexe Strompreischarakteristik aus, die besondere Anforderungen an das Risikomanagement von Energiekonzernen stellt. Die vorliegende Arbeit beschaftigt sich mit der Preismodellierung sowie Derivatebewertung im Strommarkt. Kernpunkte sind dabei die Beschreibung und Schatzung von Preissprungen, eine einheitliche Kalibrierung an Spot- und Derivatemarkten sowie die Auswirkungen des Emissionszertifikatehandels auf die Strompreischarakteristik.