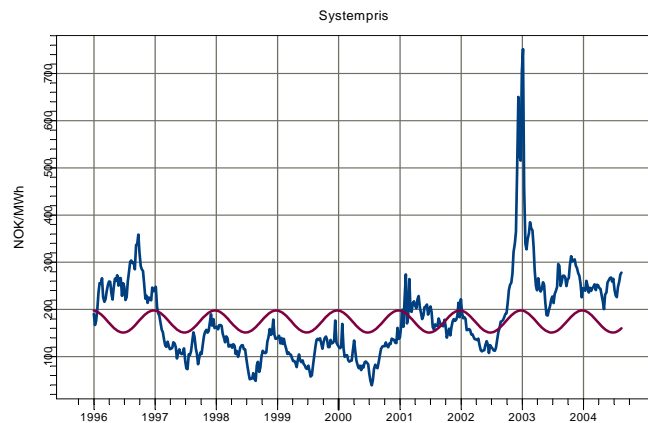


## Statistisk analyse av energipriser

Torsdag 16. april 2009,  
Kl. 9.00-15.00

Norsk Regnesentral, Gaustadalléen 23, Blindern, Oslo

Statistisk analyse og modellering er viktige komponenter i alle systemer for å beregne finansiell risiko. Norsk Regnesentral har utstrakt erfaring i statistisk analyse av energipriser. Gjennom et stort antall prosjekter utført for våre kunder har vi opparbeidet kompetanse på hvilke aspekter som er sentrale når man skal modellere slike priser i praksis. Vi har erfart hvilke begreper som er vanskelige å forstå fra en "ikke-statistikers" standpunkt, og har lang trening i å formidle disse på en pedagogisk måte.



I kurset vil vi diskutere

- stasjonaritet/ikke-stasjonaritet
- tunghalede fordelinger
- samvariasjon/korrelasjon
- prediksjon

Vi vil også gjennomgå hvordan energiprismodeller kan benyttes i praksis. Vi vil fokusere på anvendelsene og ikke matematikken bak, og fremstillingen vil være derfor være eksempeldrevet og nytteorientert.

Kurset er beregnet på sivil- og sosialøkonomer, sivilingeniører og andre med kunnskaper i matematikk, statistikk og IT på siviløkonominivå. For mer informasjon om kursinnholdet, se baksiden av dette arket.

Påmelding innen **16. mars** til Kjersti Aas, tlf: 22852694, eller epost: [kurs@nr.no](mailto:kurs@nr.no) (kursene pleier å være populære, så det lønner seg å være tidlig ute med påmelding).

**Pris (inkl. lunsj):** kr 5000.

Hvis flere fra samme bedrift: kr 3500 fra og med andre deltager.

Vi sender faktura. Husk å oppgi fakturaadresse når du melder deg på kurset.

## Faglig innhold

<b>Innledning:</b> Kursoversikt	09.00 – 09.10
<b>Introduksjon</b>	09.10 – 09.30
• Hvorfor modellere energipriser?	
<b>Tidsrekkemodeller</b>	09.30 – 10.30
• Stasjonaritet	
• Autoregressive prosesser	
• Sesongvariasjon	
• Multi-faktormodeller	
<b>Fordelinger</b>	10.30 – 11.30
• Normalfordeling	
• Tunghalede og skjeve fordelinger	
<b>Prediksjon</b>	11.30 – 12.00
• Forklaringsvariable	
• Prediksjonsmodeller	
<b>Lunsj</b>	12.00 – 13.00
<b>Samvariasjon</b>	13.00 – 13.45
• Korrelasjon	
• Kausalitet	
• Kointegrasjon	
<b>Praktiske eksempler</b>	13.45 – 14.55
• Modeller for ulike råvarepriser	
• Netto nåverdi med usikkerhet	
• Totalrisiko for en energiprodusent	
<b>Avsluttende oppsummering:</b>	
• Hva har vi lært?	14.55 – 15.00

Det vil bli to kaffepauser ca. kl 10.15 og 14.00.

Norsk Regnesentral (NR) er et forskningsinstitutt med et av Europas største fagmiljøer for statistisk modellering. NR er etter hvert blitt en viktig aktør på modellering av energipriser i Norge, med de fleste av de store kraftselskapene på kundelisten. I tillegg til konsulentvirksomheten driver NR også med grunnforskning, der vi samarbeider med ledende internasjonale miljøer på statistisk modellering av priser. NR er et av 14 sentre for forskningsdrevet innovasjon (SFI) som Norges Forskningsråd satser spesielt på, med statistiske metoder for finans som det viktigste satsingsområdet.

For mer info om NRs aktiviteter innen finans, kontakt Kjersti Aas, tlf: 22852694 eller epost: [Kjersti.Aas@nr.no](mailto:Kjersti.Aas@nr.no)