

MS Excel Intensiv-Workshop

Statistische Modellierung im Energiebereich

- Trainer** Ralf Zöller, Geschäftsführer, Emerald Risk Consulting GmbH, Berlin
- Inhalt** Zur Prognose oder Simulation von Last, Preisen und anderen dem Zufall unterliegenden Größen ist eine statistische Modellierung Voraussetzung. Ziel des Seminars ist die anwendungsorientierte Modellierung verschiedener Energiedaten. Methoden aus Statistik und Ökonometrie werden eingesetzt, um ausgehend von einem Datensatz brauchbare Modelle zu entwickeln.
- Wir modellieren Abhängigkeiten, z.B. Last/Temperatur, schätzen die Modellparameter und analysieren die Qualität und Prognosekraft der Modelle. Außerdem modellieren wir Zeitreihen wie Temperatur, Last und Spotpreise. Solche Modelle können verwendet werden, um im Rahmen einer Monte-Carlo-Simulation Szenarien der zukünftigen Entwicklung für Profit-at-Risk oder Pricing zu generieren. Im Zentrum stehen dabei zunächst die Saisonalitäten, aber auch Aspekte der Stochastik wie Mean-Reversion und GARCH-Effekte.
- Themen** Formulierung und Parametrisierung eines Modells • Einflussgrößen berücksichtigen • lineare Regression • kleinste Quadrate • Standarderrors • Maximum Likelihood • MLE mit Excels Solver • Prognosen • Mean-Reversion • Residualanalyse • Autokorrelation • Temperaturmodell • Lastmodell • stochastische Volatility und GARCH • Gas- und Strom-Spotpreise • Saisonalitäten in Last und Preisen • Likelihood-Ratio Tests
- Format** MS Excel Intensiv-Workshop. Viel Interaktivität und Individualität.
- Technik** Im Seminar steht Ihnen ein Notebook mit Office 2010 (deutsch) zur Verfügung. Falls Sie jedoch Ihren eigenen Computer mitbringen, können Sie ohne Probleme auch eine andere Excel-Version verwenden. Bitte dann sicherstellen, dass Excel's Solver installiert ist.
- Zielgruppe** Risikomanagement, Handel, Analyse, Portfoliomanagement, Beschaffung, Vertrieb oder andere Interessierte aus dem Bereich der Energiewirtschaft • gute Excel-Fertigkeiten werden vorausgesetzt
- Veranstalter** Emerald Risk Consulting GmbH, Manfred-von-Richthofen-Str. 9, 12101 Berlin
www.emerald.com, Tel: +49 (30) 3011 3012, Fax: +49 (30) 3011 3065
Ansprechpartnerin für alle organisatorischen Fragen ist Frau Suza Cramer, suza.cramer@emerald.com. Für alle Fragen und Anregungen zum Inhalt wenden Sie sich bitte direkt an Herrn Zöller, ralf.zoeller@emerald.com