DR. NIKOLA KREČAR

Dr. Nikola Krečar je v doktorski disertaciji raziskoval področje trgovalnih strategij z upoštevanjem premije tveganja in razvil novo metodo modeliranja premije tveganja, ki temelji na načinu »ex-ante« kot najprimernejšem za oceno premije tveganja na trgu z električno energijo. Prispevek njegove disertacije je sestavljen iz treh glavnih gradnikov: novega analitičnega modela premije tveganja, novega linearnega modela premije, ki upošteva različne vplivne faktorje, ter metode, ki povezuje oba modela algoritma za uporabo modela. Poleg tega je zasnoval nov algoritem trgovalne strategije na trgu z električno energijo z upoštevanjem premije tveganja.
Analitični model premije tveganja temelji na robustnem stohastičnem procesu, ki zaradi robustnosti ni primeren za napoved premije kratkoročnih terminskih produktov na trgu z električno energijo. Ker se je v raziskavi osredotočil na napovedovanje premije tveganja letnih terminskih produktov, se je nova metoda KGB izkazala za robustno in zato zelo primerno. Metoda s povezovanjem obeh modelov omogoča, da udeleženec trga z omejenim naborom vhodnih podatkov napove premijo tveganja brez napovedi vrednosti terminskih produktov. S tem nova metoda poenostavi izračun premije tveganja in omogoči njeno uporabo širšemu krogu udeležencev trga z električno energijo zunaj ozkega kroga specializiranih analitičnih oddelkov velikih evropskih energetskih družb. Doktorska disertacija dr. Nikole Krečarja zato prispeva k zrelejšemu in bolj poštenemu trgu električne energije.