

<<水电企业电力营销风险管理>>

图书基本信息

书名：<<水电企业电力营销风险管理>>

13位ISBN编号：9787508384573

10位ISBN编号：7508384571

出版时间：2009-3

出版时间：中国电力出版社

作者：涂扬举 等著

页数：195

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问：<http://www.tushu007.com>

## <<水电企业电力营销风险管理>>

### 前言

电力市场机制的引入,可以有效促进企业竞争,提高运行效率,降低经营成本,优化资源配置。但电力市场竞争,尤其是竞价上网的实施,在给发电企业孕育新的发展机遇的同时,也带来了一系列风险。

如何识别、度量、评估、分析、预防和规避风险,加强风险管理,是发电企业必须密切关注和高度重视的重大课题。

除了发电企业共有的风险因素外,由于水电自身存在来水的不确定性、水库调节性能的差异、综合利用要求及上下游梯级调度等问题,水力发电企业在电力营销和竞价上网过程中,会遇到更为复杂的不确定性因素和经营风险。

为了顺利实现水力发电企业的经营目标,促进竞价的科学化、合理化,减少或规避决策的风险,提高经营效益,研究水力发电企业电力营销和竞价上网风险管理问题,具有十分重要的理论意义和生产实用价值。

为此,作者结合电力企业中众多实例编写了本书,以供电力企业相关管理人员参考。

本书共分12章。

第1、2章主要对国内外电力市场风险管理的研究现状及意义,造成电力市场风险的主要因素进行了总结和分析,介绍了风险规避的基础理论和方法;第3章介绍了以VAR尺为核心的市场风险测量的基础理论和主流计算方法;第4、5章则通过分析水电站入库径流的影响因素以及电价的风险因素,建立了发电量风险度量数学模型和现货电价风险测量模型;第6~9章重点分析了期货交易、电力期权交易、两部制电价以及发电权交易的功能和风险规避作用;第10章对水电企业竞价引入保险机制的必要性和可行性进行了分析。

提出了对水电企业电价、发电量保证率保险的思路和途径;第11章则根据日前边际电价特点,提出了采用模糊聚类并结合人工神经网络进行预测的方法,同时还给出了某电网边际电价预测算例;第12章就市场环境下的短期优化调度方案进行电价风险测量的问题,提出了最小风险收入指标,并在此基础上建立了基于VAR的水电站短期优化调度数学模型。

## <<水电企业电力营销风险管理>>

### 内容概要

为了顺利实现水力发电企业的经营目标，促进竞价的科学化、合理化，减少或规避企业决策的风险以及提高经营效益，《水电企业电力营销风险管理》就水力发电企业电力营销和竞价上网风险管理问题进行了深入而全面的探讨。

书中首先对国内外电力市场风险管理的研究现状及意义，造成电力市场风险的主要因素进行了总结和分析，继而介绍了以V R为核心的市场风险测量的基础理论和主流计算方法，通过分析水电站入库径流的影响因素以及电价的风险因素，建立了发电量风险度量数学模型和现货电价风险测量模型。

此外，《水电企业电力营销风险管理》还重点分析了期货交易、电力期权交易、两部制电价以及发电权交易的功能和风险规避作用，对水电企业竞价引入保险机制的必要性和可行性进行了分析，从而提出了对水电企业电价、发电量保证率保险的思路和途径；同时，书中还结合水力发电企业中电力营销的具体实例给出了电价预测和风险测量的计算算例，因此具有十分重要的理论指导意义和生产实用价值。

《水电企业电力营销风险管理》语言精练、重点突出、条理清晰、原理分析透彻，可作为水力发电企业相关技术及管理人员的参考用书，也可用作相关专业的教辅材料。

## <<水电企业电力营销风险管理>>

### 作者简介

涂扬举，1964年8月生，四川省巴中市人，博士，高级工程师，现任国电大渡河瀑布沟分公司总经理，四川省青联常委，曾参加国家自然科学基金、部省及企事业单位重点科研生产项目近10项，获省部级科技成果奖5项，在国内外学术刊物上发表论文30余篇，其中7篇论文被EI收录，参与编写《水利水电工程施工手册》等书籍。

## &lt;&lt;水电企业电力营销风险管理&gt;&gt;

## 书籍目录

前言1 电力市场风险及国内外研究现状概述1.1 电力市场概况1.2 电力企业的共有风险1.3 水电企业电力营销风险1.4 研究水电营销风险规避问题的意义1.5 国内外研究现状2 风险管理的基础理论2.1 风险特征2.2 风险规避和管理2.3 风险评估的方法3 VaR风险测量理论3.1 VaR产生的背景3.2 VaR的基本含义3.3 VaR计算的基本原理3.4 VaR方法的优缺点3.5 VaR的计算方法3.6 VaR模型的后验测试与误差分析4 径流-发电量风险分析4.1 天然来水的不确定性4.2 可发电量的不确定性4.3 电量不确定性引发的风险问题4.4 发电量风险度量4.5 发电量预测偏差导致的风险4.6 电量竞标风险5 电价风险分析5.1 电价的基本特征及其风险分析5.2 现货市场电价的数理分布及其波动性5.3 现货市场电价波动率的数理分布及其波动性5.4 现货市场电价风险度量5.5 电力市场竞价模式6 电力期货交易及风险规避作用研究6.1 期货及期货交易的概念6.2 电力期货市场6.3 电力期货交易对水电企业电力营销风险的规避作用7 期权交易及其风险规避作用研究7.1 期权交易的内涵7.2 期权市场与期货市场的关系7.3 期权交易类型7.4 期权交易的作用7.5 国外电力市场期权交易概况7.6 期权交易对水电企业电力营销风险规避作用8 两部制上网电价与风险规避作用研究8.1 两部制上网电价内涵8.2 国内外两部制上网电价的制定方法简介8.3 会计成本分解定价方法8.4 竞价上网条件下的容量电价9 发电权交易对水电企业电力营销风险的规避作用9.1 发电权交易的内涵9.2 发电权交易的作用9.3 发电权交易案例——水火电量置换9.4 撮合交易模式下的水火电量置换9.5 双边交易模式下水火电置换动态进化博弈模型9.6 水火电量置换对水电企业电力营销风险的规避作用9.7 推进发电权交易需要解决的问题10 保险机制对水电企业电力营销风险的规避作用10.1 保险转移的内涵10.2 电力保险在西方发达国家的发展与实践.....11 提高电价预测精度对竞价风险的规避作用12 基于VaR的水电站短期优化调度

## &lt;&lt;水电企业电力营销风险管理&gt;&gt;

## 章节摘录

1 电力市场风险及国内外研究现状概述 1.1 电力市场概况 20世纪90年代以来,随着世界上许多国家电力工业的市场化改革和重组,电力工业百余年的发展也将进行一次最重要的变革。电力市场改革的基本思想是对垂直一体化经营的电力系统不同程度地放松或解除管制,引入竞争,提高效率;其核心是将发电、输电、配电的主要功能分解成在商业运营方面相互独立的实体,将电力、电量、输电服务、辅助服务等商品,尽可能精确地表示为电价,将电力系统的各种操作以经济尺度加以衡量,在所有市场参与者之间公平、公正地分摊相关费用。

当前,我国已初步完成了电网公司、独立发电企业以及其他相关市场主体的重构工作,全面改革了调度机制、交易机制、运营机制和利益分配机制,逐步实现了从发电竞争、趸售竞争到零售竞争的电力市场运营模式。

六大区域电力市场中,东北、华东、南方电力市场已分别进入模拟和正式运行阶段,华中、华北区域电力市场也正在积极筹备中,这标志着我国电力市场改革已取得实质进展并稳步推进。

区域电力市场的建立将大大加强省级电力市场间的联系,平衡能源资源时空分布上的不均匀,增强区域内电力供需平衡调节能力,提高发电侧电力市场竞争力度,有利于降低社会供电成本。

市场化改革在给电力企业带来机遇的同时,也会带来一系列风险。

电力市场的交易类型一般分为长期合同交易、现货交易、实时交易、辅助服务交易、发电权交易以及金融衍生品市场交易。

#### (1) 长期合同交易。

在单一购买者模式下的发电侧电力市场,组织发电公司竞争的电网经营企业担负着保证向用户供电的义务。

所以,电网经营企业为了防止严重缺电或电价急剧升高的风险,必须与发电公司签订一定数量的长期合同。

目前,各发电公司保留原有合同中80%左右的电量,作为电力市场的长期合同。

这种长期合同是原先合同的延续,随着市场的发展与完善,其比例将逐渐减小,并最终由市场决定的长期交易合同所取代。

## <<水电企业电力营销风险管理>>

### 编辑推荐

《水电企业电力营销风险管理》语言精练、重点突出、条理清晰、原理分析透彻，可作为水力发电企业相关技术及管理人员的参考用书，也可用作相关专业的教辅材料。

<<水电企业电力营销风险管理>>

版权说明

本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问:<http://www.tushu007.com>