

TEMA

Diferencia en la
“VOLATILIDAD de los Precios del PETROLEO”

Mediante escenarios o

Mediante un modelo “CEGH” agregando una
variable de estado al sistema

CEGH: Correlación en Espacio Gaussiano con conservación de Histograma

OBJETIVO

- El precio del Petróleo es Clave en la generación de energía
- Análisis tradicional: Manejar precio por escenario con supuesto de “variación lenta”, utilizando un valor esperado y luego valores fijos por arriba y por debajo de ese valor.
- Objetivo: Mostrar, como cambian los **costos marginales de 1 MWh** utilizando un modelo Gaussiano para los precio del petróleo con precio estabilizado de la energía (ingreso que recibiría 1MW al spot despachado en la base) y el valor del agua como política de uso de los recursos.

METODOLOGIA

1. **Sala: Programación Estacional del período Mayo-Octubre 2010-ADME**
2. **Postes:**
 - Poste1 - Pico de las 7 hs de mayor consumo.
 - Poste2 - Pico de las 28 hs siguientes de mayor consumo
 - Poste3 - Resto 91 hs.
 - Poste4 - Valle de las 42 hs de menor consumo
3. **Se compararon el precio spot y el valor del agua obtenidos mediante diferentes escenarios fijos para el precio del petróleo y con la serie de precios.**

Escenarios fijos que se consideraron":

50 USD cuantil 10 de la serie de precios.	
60 USD cuantil 30	“
67 USD cuantil 50	“
74 USD cuantil 70	“
103 USD cuantil 90	“

AGENDA

PARTE I

Probabilidad de Excedencia e Ingreso al Spot 1MWh

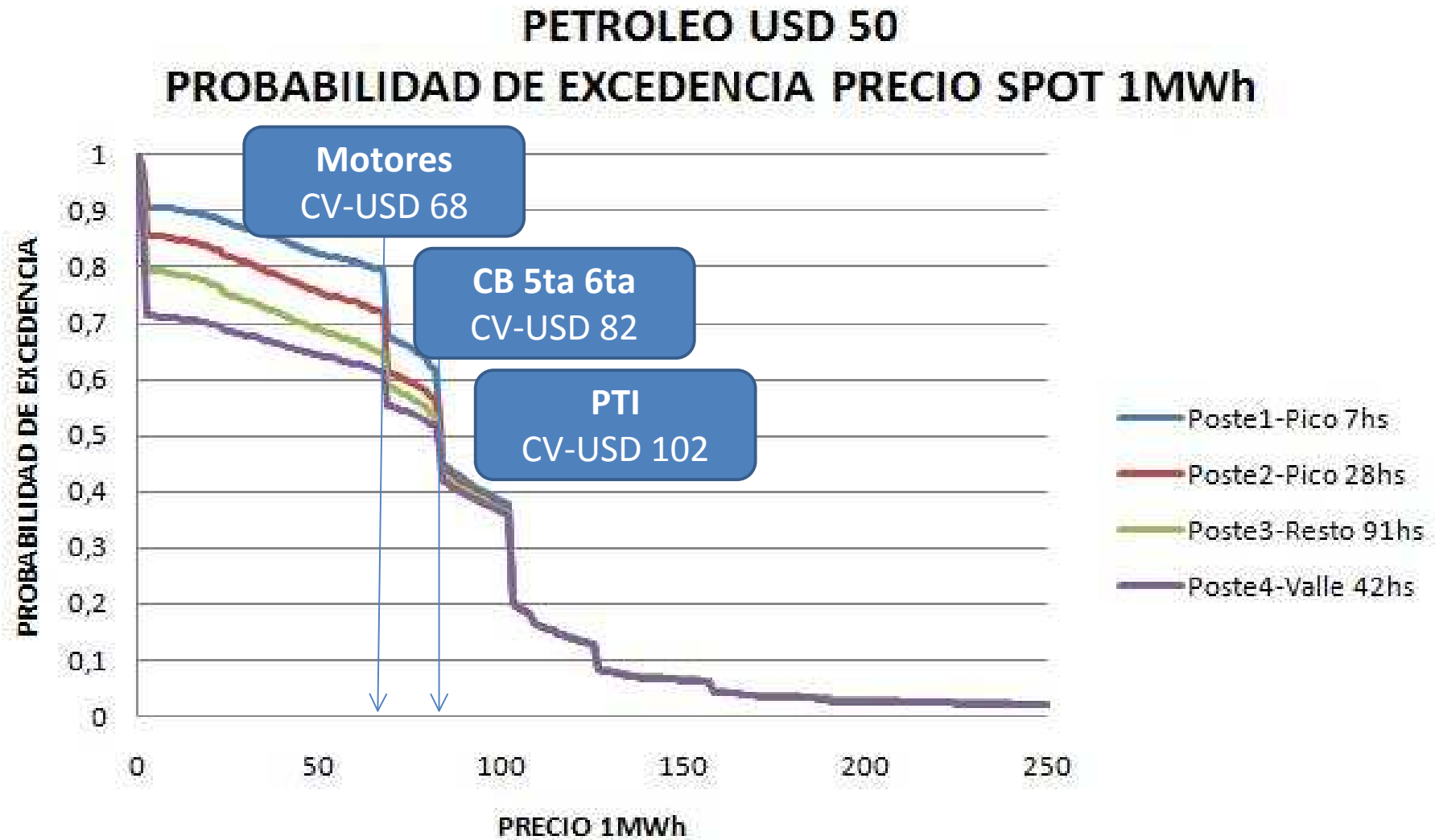
PARTE II.

Valor del agua dado un precio del petróleo

Tiempo Exposición: 15 minutos

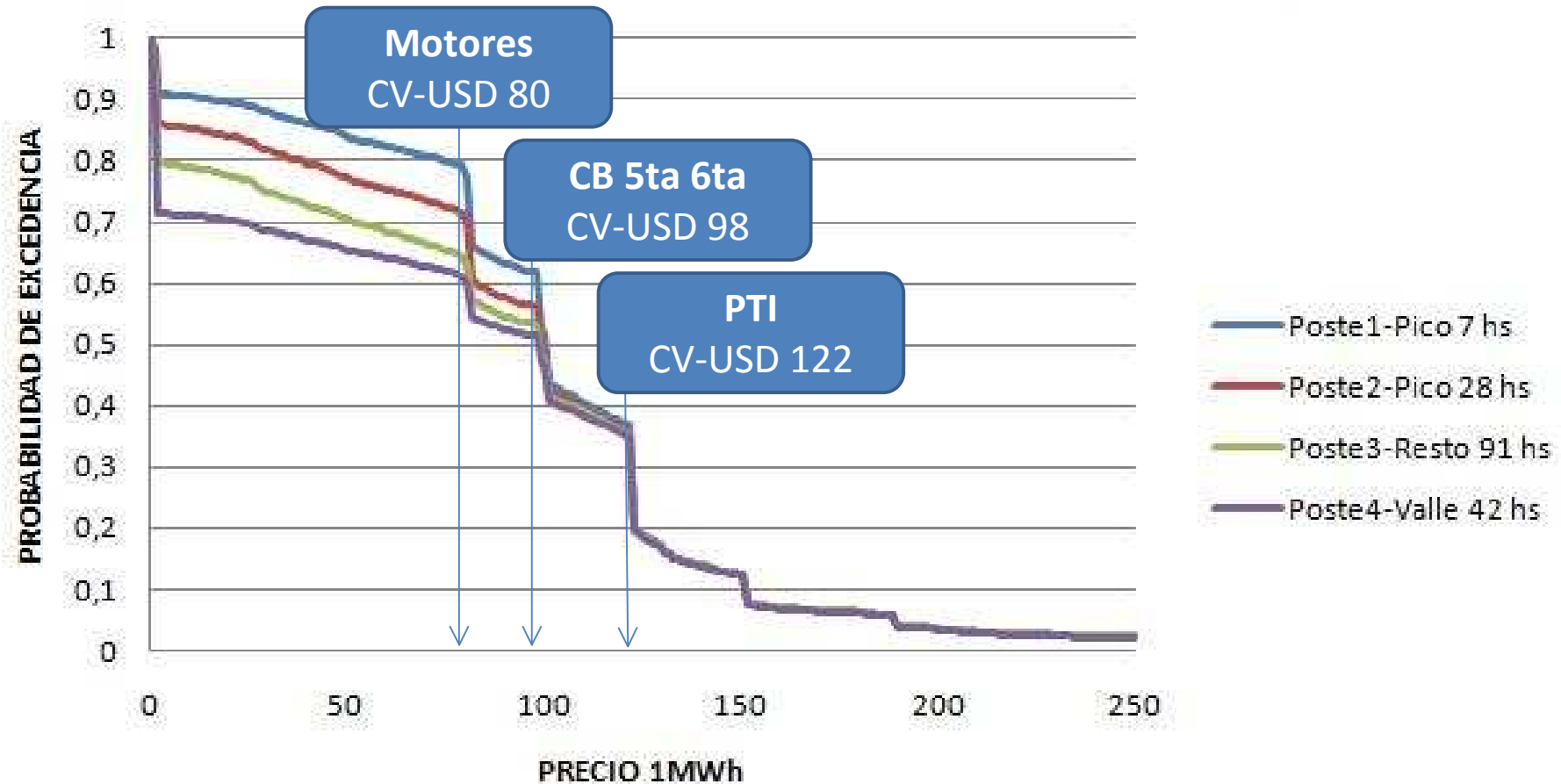
Tiempo para preguntas: 6 minutos

Barril-Petróleo USD 50-Prob. Excedencia



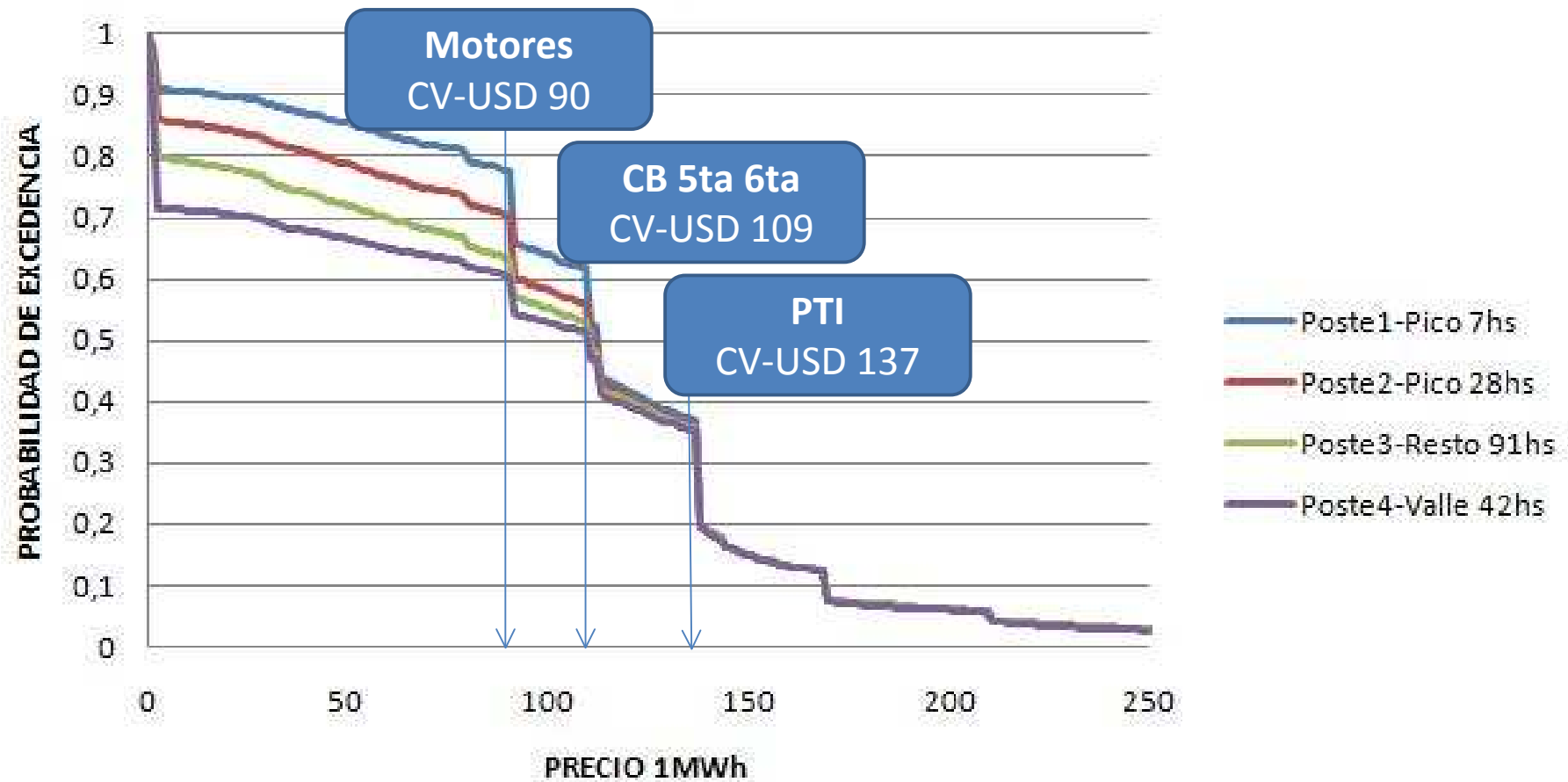
Barril-Petróleo USD 60-Prob. Excedencia

PETROLEO USD 60 PROBABILIDAD DE EXCEDENCIA PRECIO SPOT 1MWh

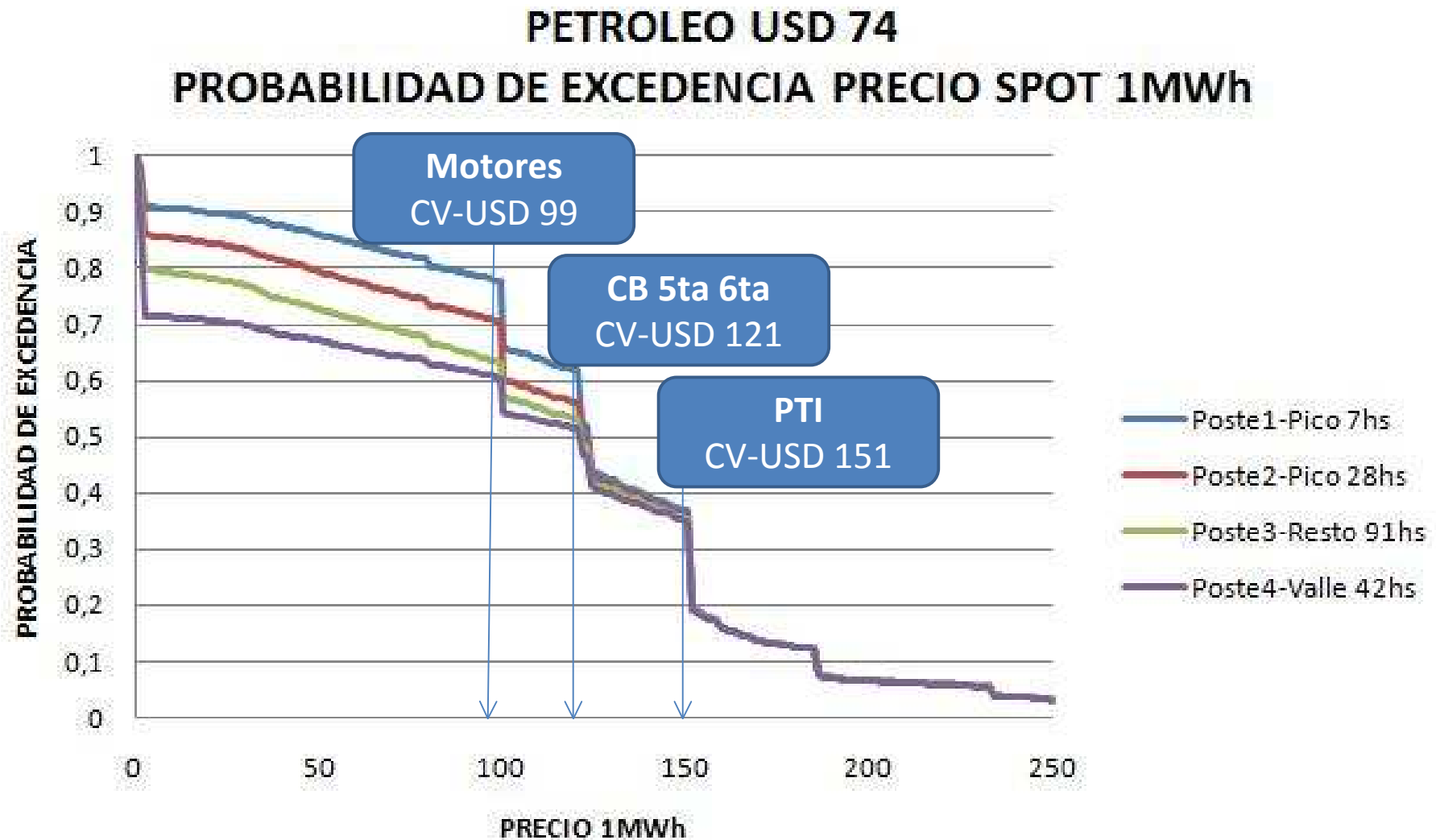


Barril-Petróleo USD 67-Prob. Excedencia

PETROLEO USD 67 PROBABILIDAD DE EXCEDENCIA PRECIO SPOT 1MWh

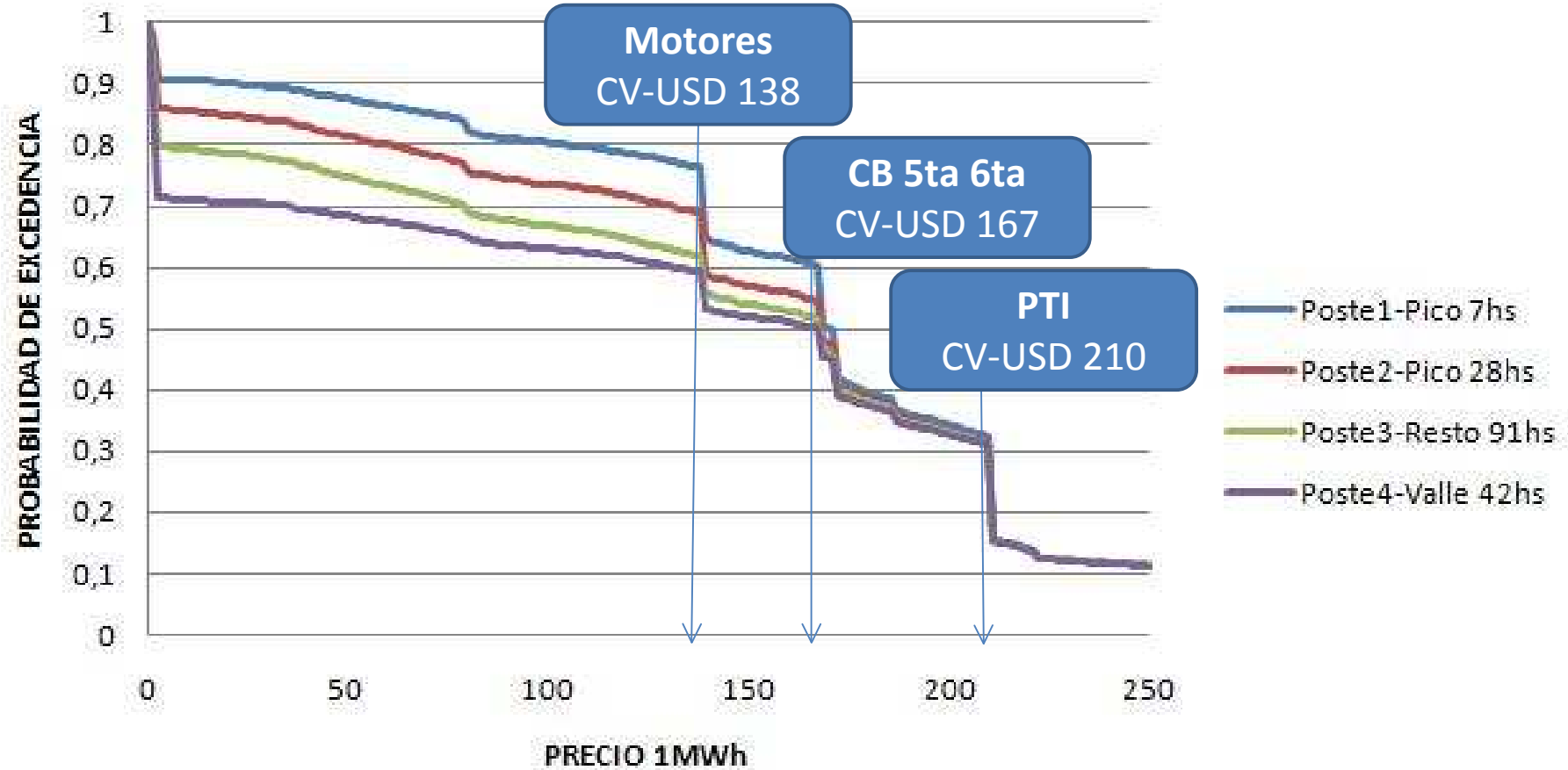


Barril-Petróleo USD 74-Prob. Excedencia



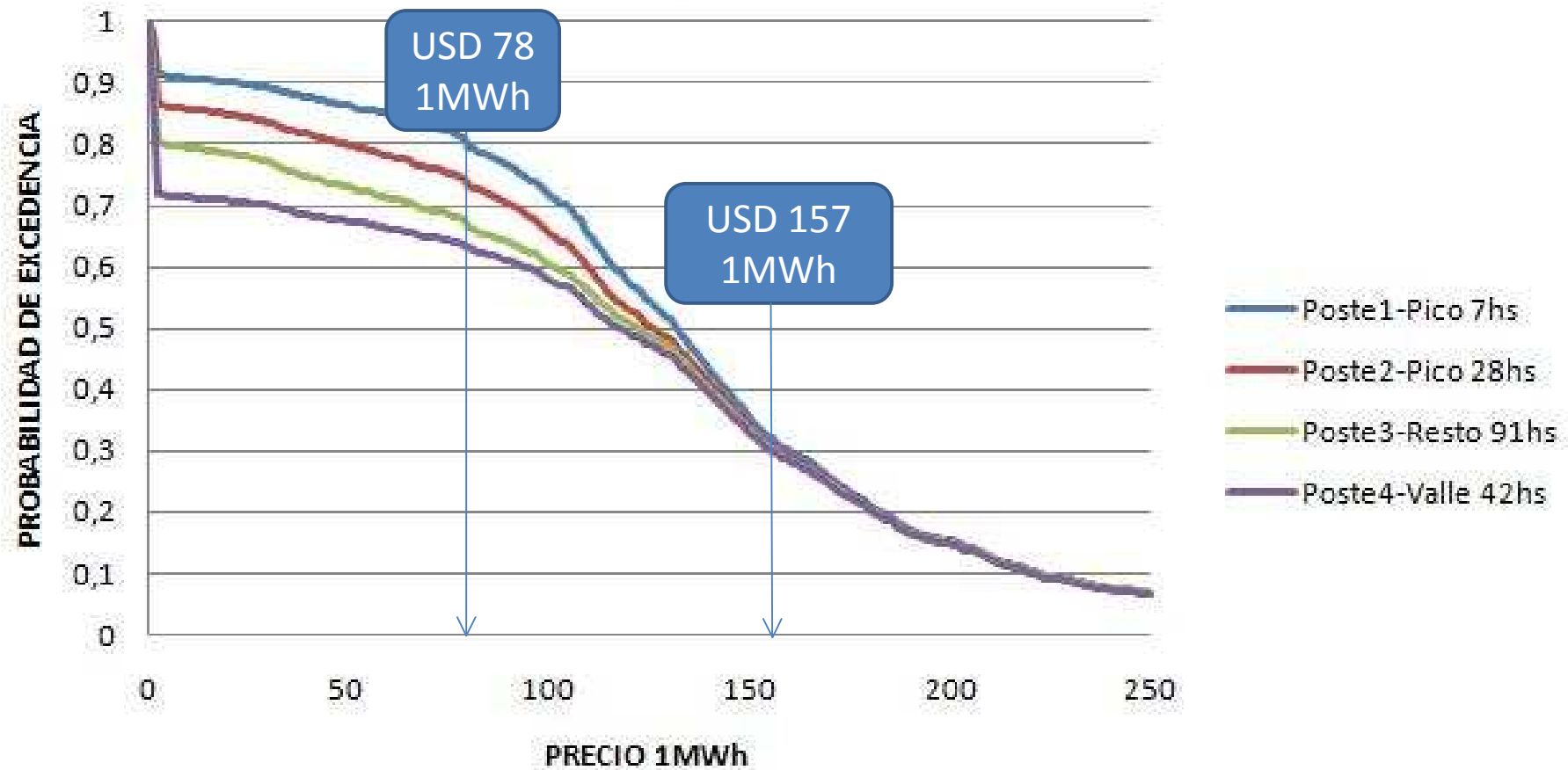
Barril-Petróleo USD 103-Prob. Excedencia

PETROLEO USD 103 PROBABILIDAD DE EXCEDENCIA PRECIO SPOT 1MWh



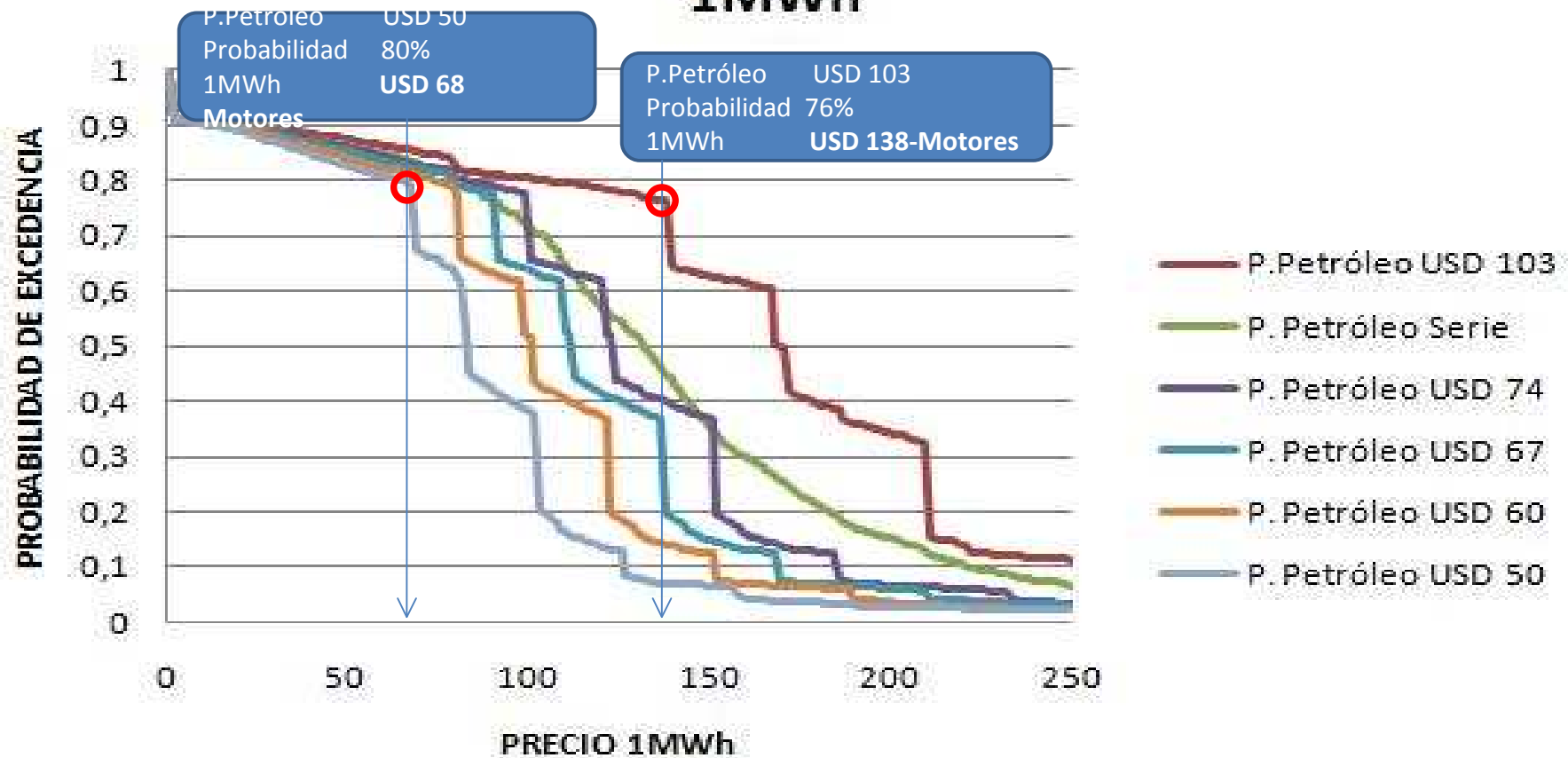
PETROLEO USD SERIE-Prob. Excedencia

PETROLEO SERIE DE PRECIO
PROBABILIDAD DE EXCEDENCIA PRECIO SPOT 1MWh



POSTE 1 – PICO 7 hs

POSTE 1 - PICO 7 hs PROBABILIDAD DE EXCEDENCIA PRECIO SPOT 1MWh

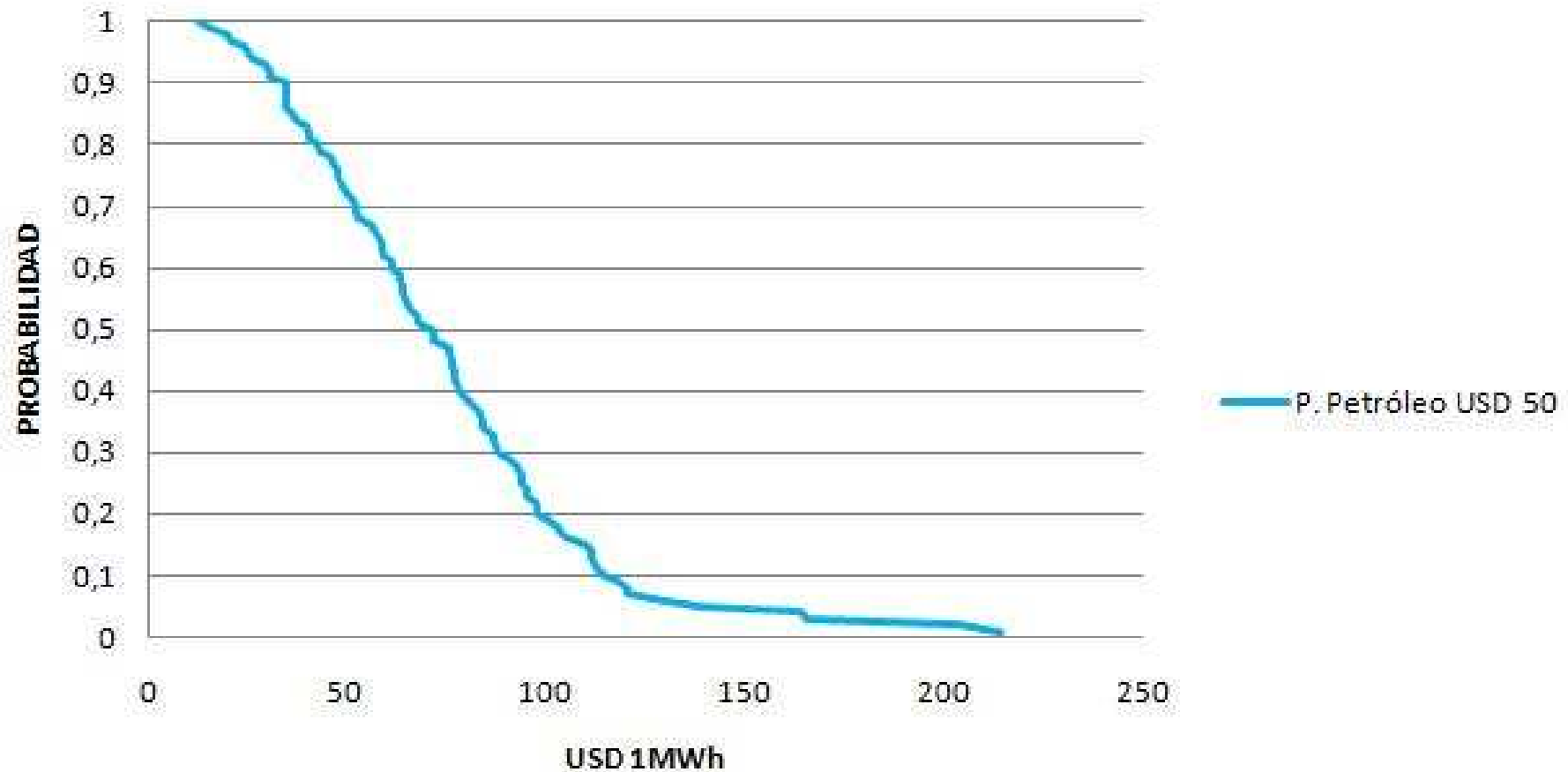


INGRESO AL SPOT 1 MWh

Ingresos/Cantidad MWh

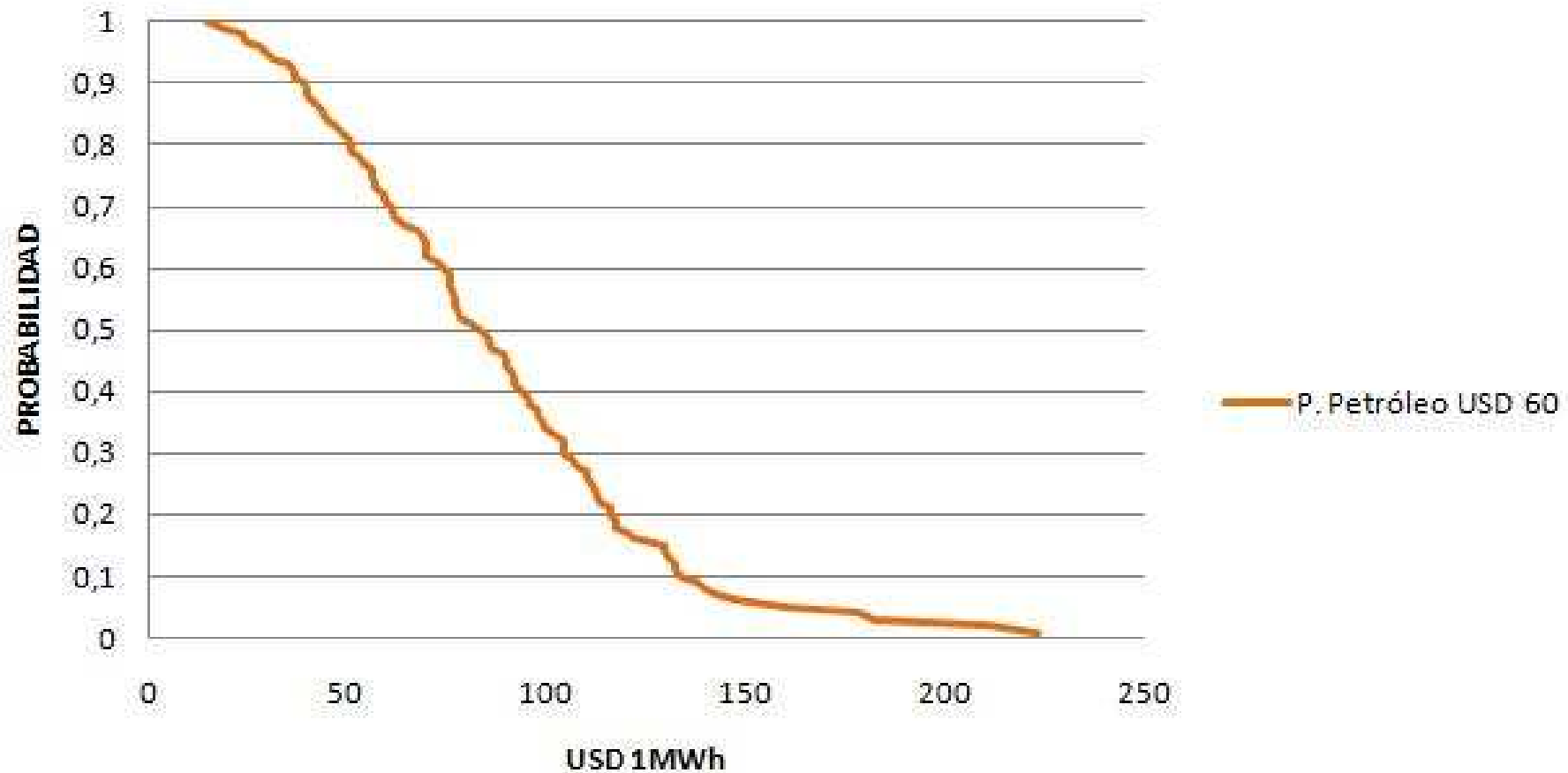
Ingresos/Cantidad MW – P. Petróleo USD 50

PETROLEO USD 50
INGRESO 1 MW AL SPOT



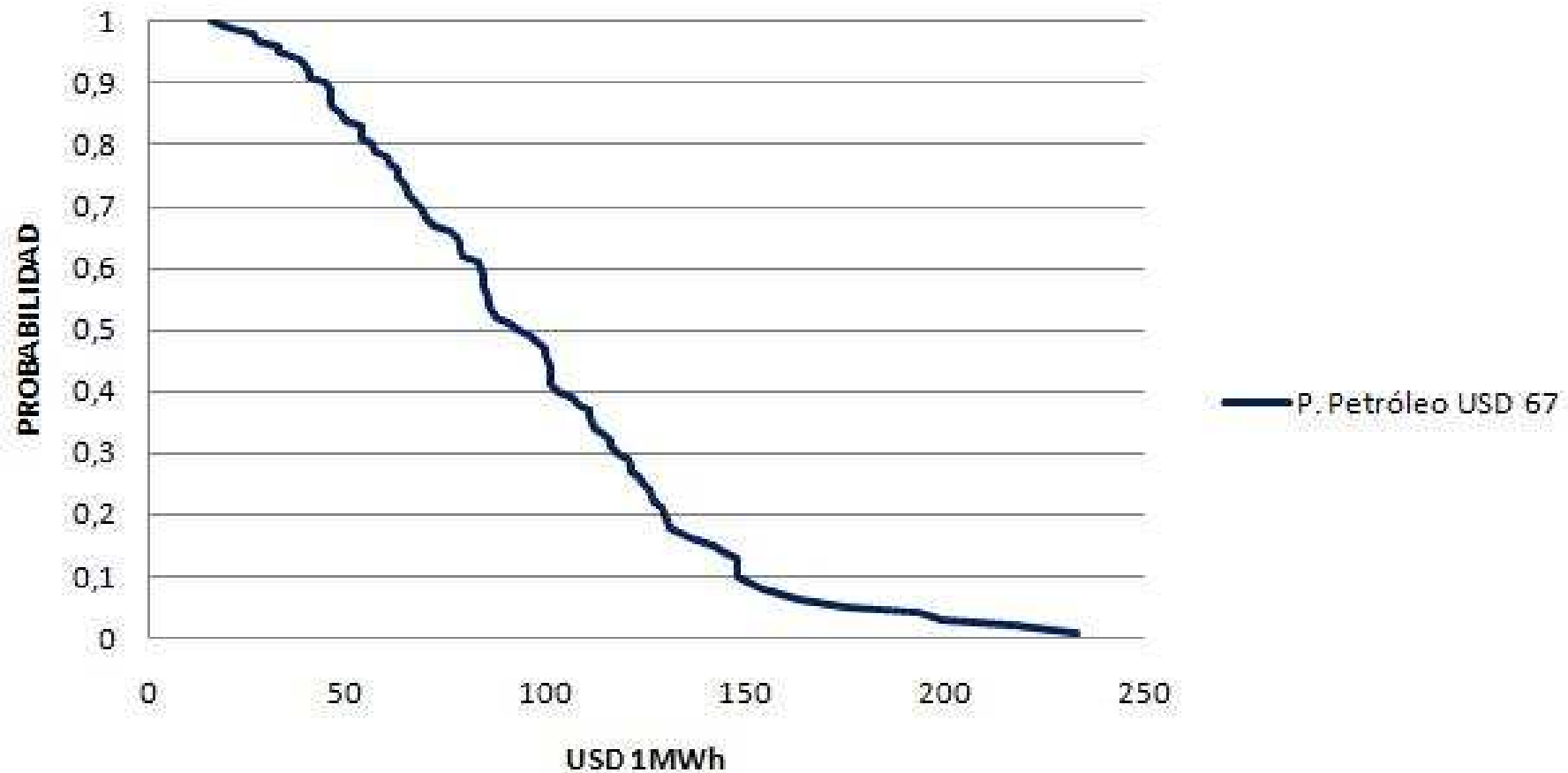
Ingresos/Cantidad MW – P. Petróleo USD 60

PETROLEO USD 60
INGRESO 1 MW AL SPOT



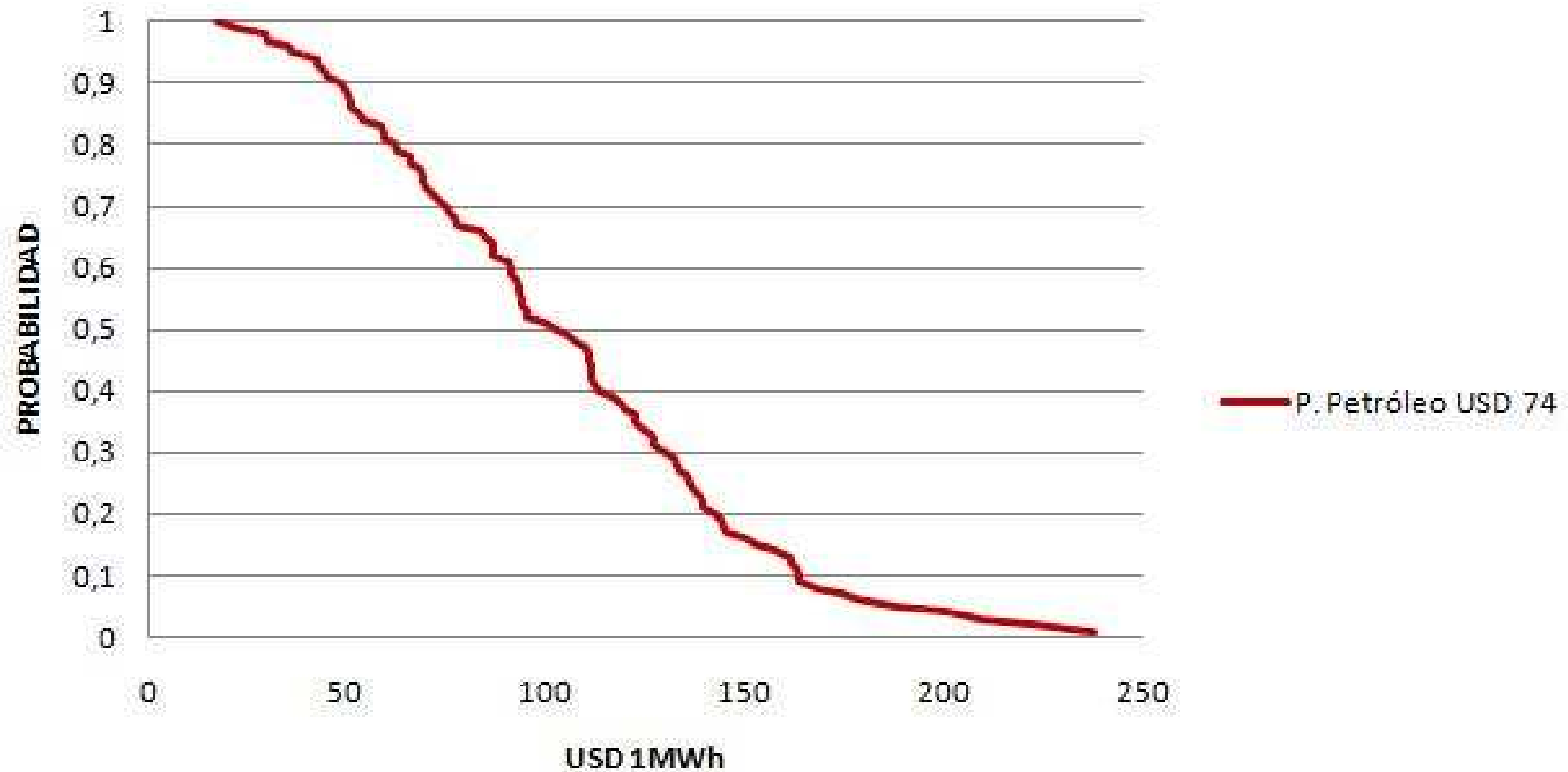
Ingresos/Cantidad MW – P. Petróleo USD 67

PETROLEO USD 67 INGRESO 1 MW AL SPOT



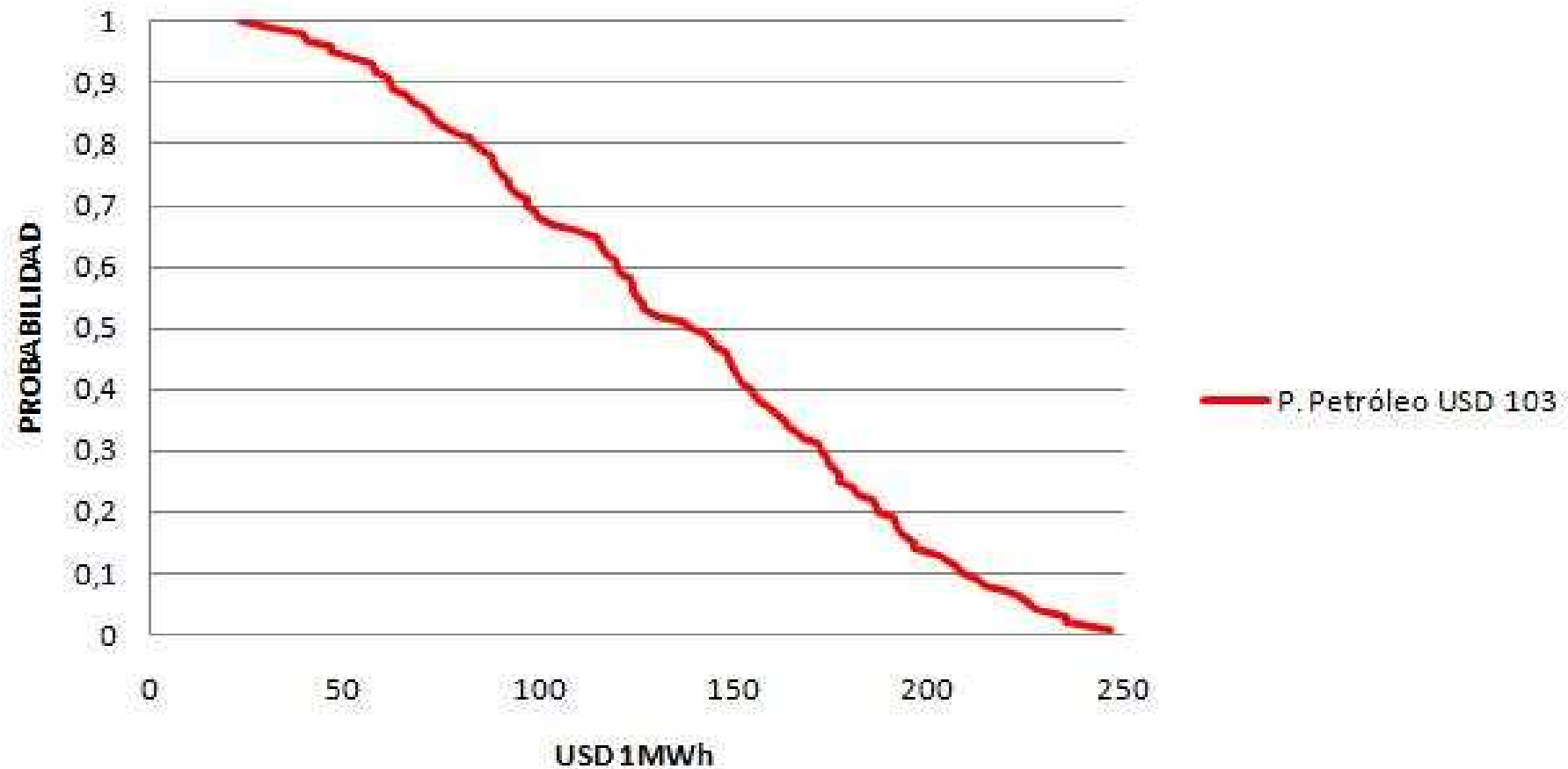
Ingresos/Cantidad MW – P. Petróleo USD 74

PETROLEO USD 74
INGRESO 1 MW AL SPOT



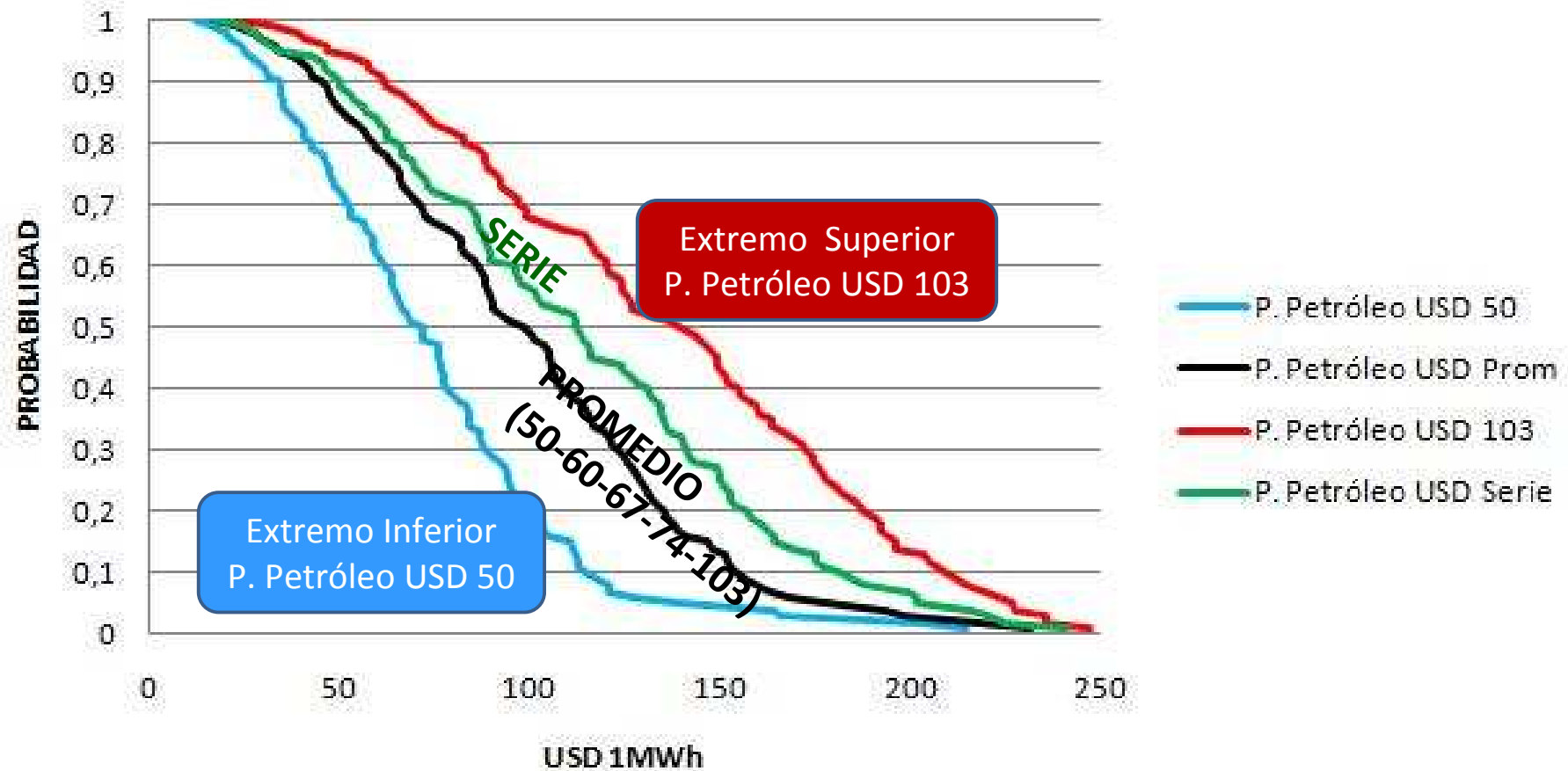
Ingresos/Cantidad MW – P. Petróleo USD 103

PETROLEO USD 103 INGRESO 1 MW AL SPOT



Ingresos/Cantidad MW

PETROLEO USD SERIE-PROMEDIO Y EXTREMOS INGRESO 1 MW AL SPOT

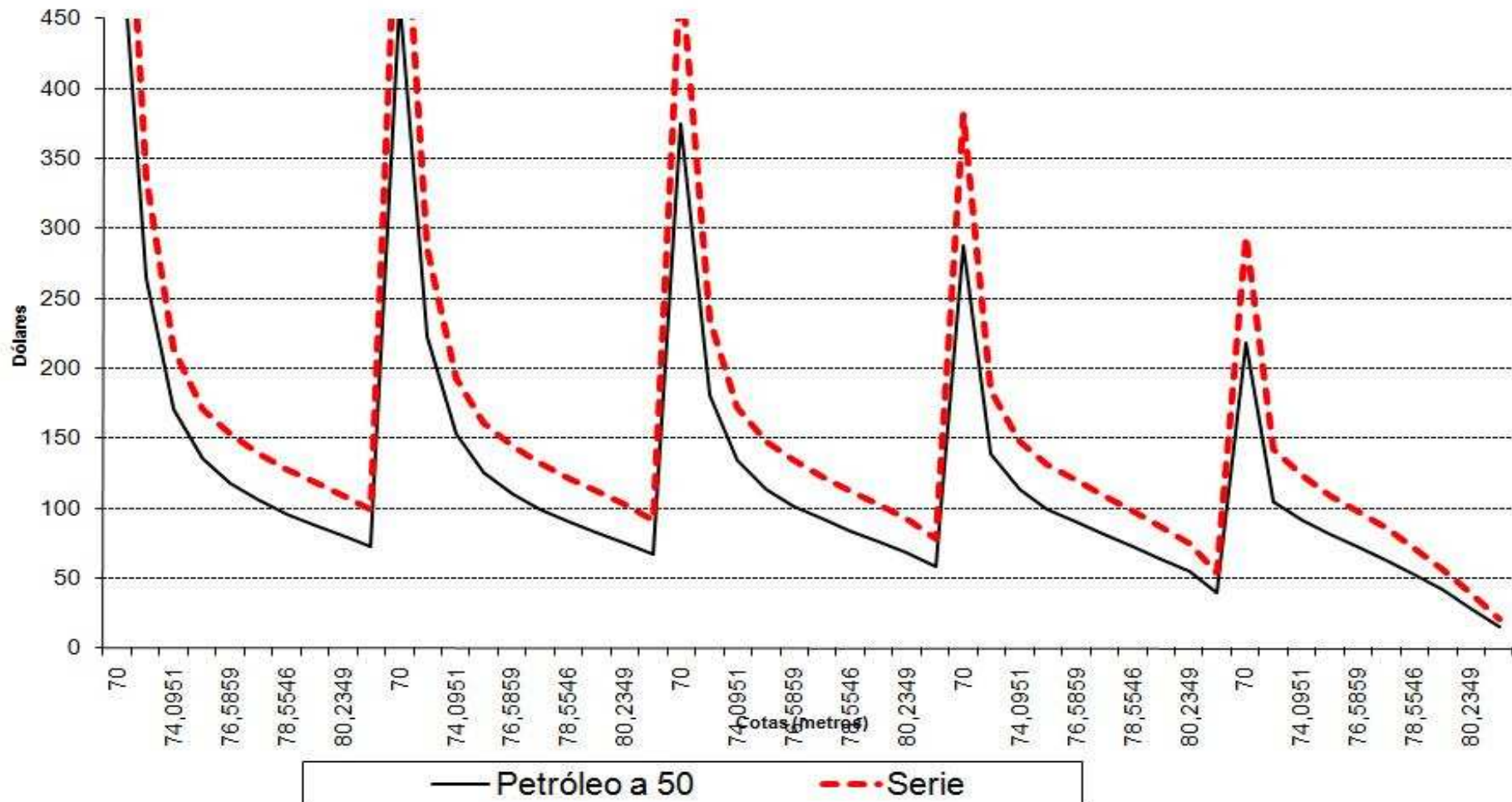


PARTE II

Valor del agua dado un precio del petróleo

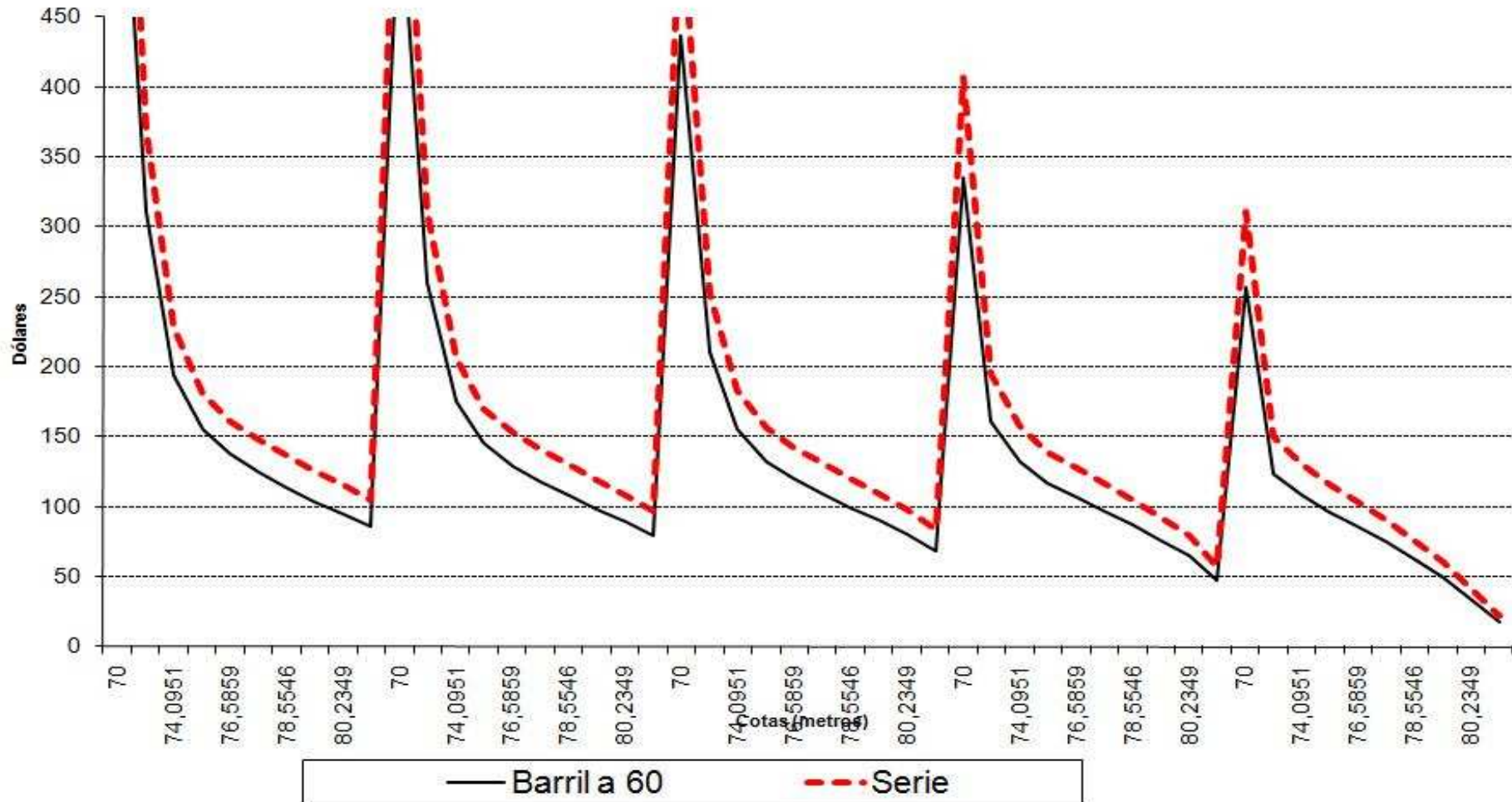
Valor del Agua – P. Petróleo USD 50 y Serie

Valor promedio del Agua con escenario a 50 y con la Serie de precios del Petróleo



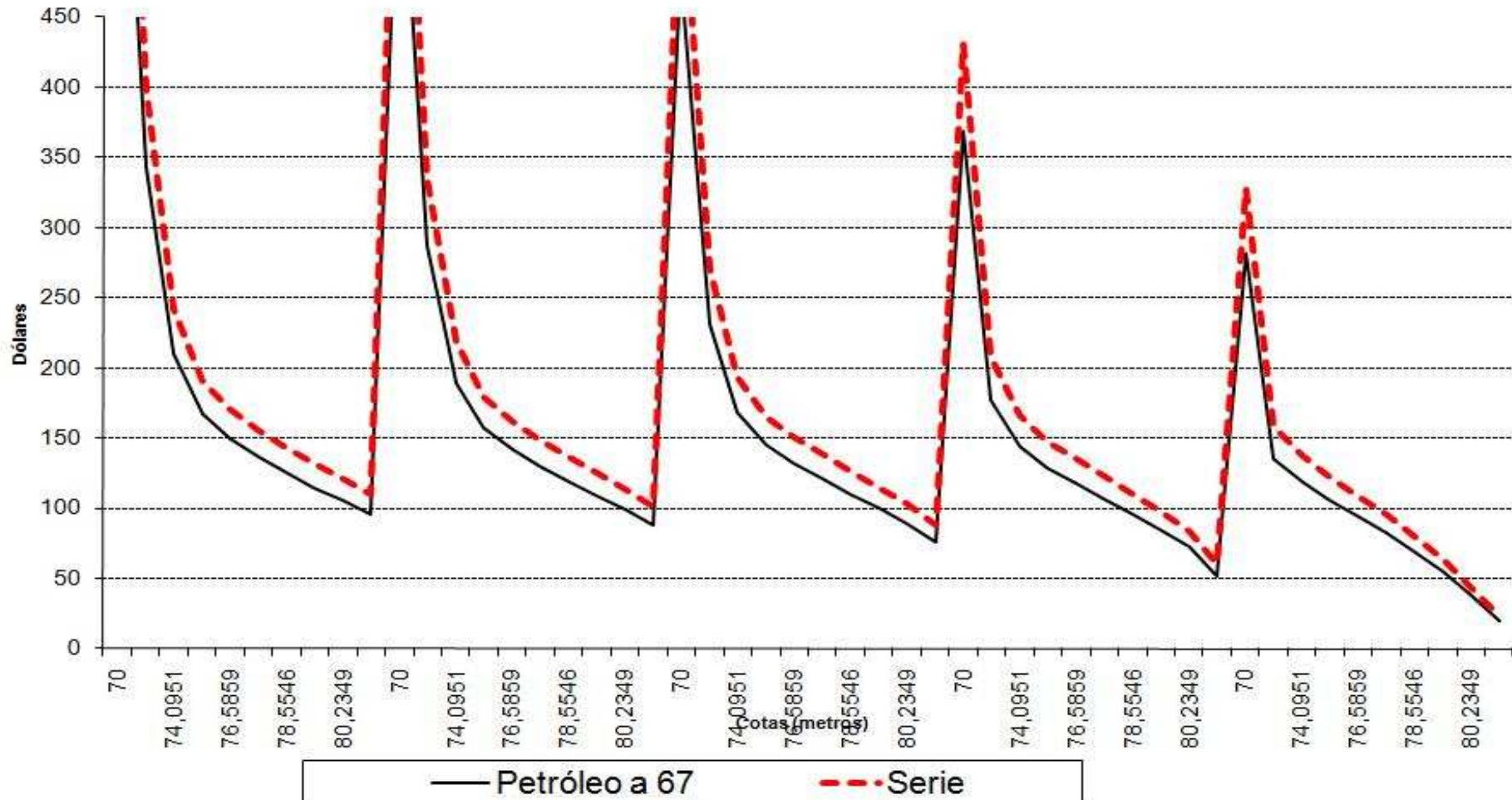
Valor del Agua – P. Petróleo USD 60 y Serie

Valor promedio del Agua con escenario a 60 y con la Serie de precios del Petróleo



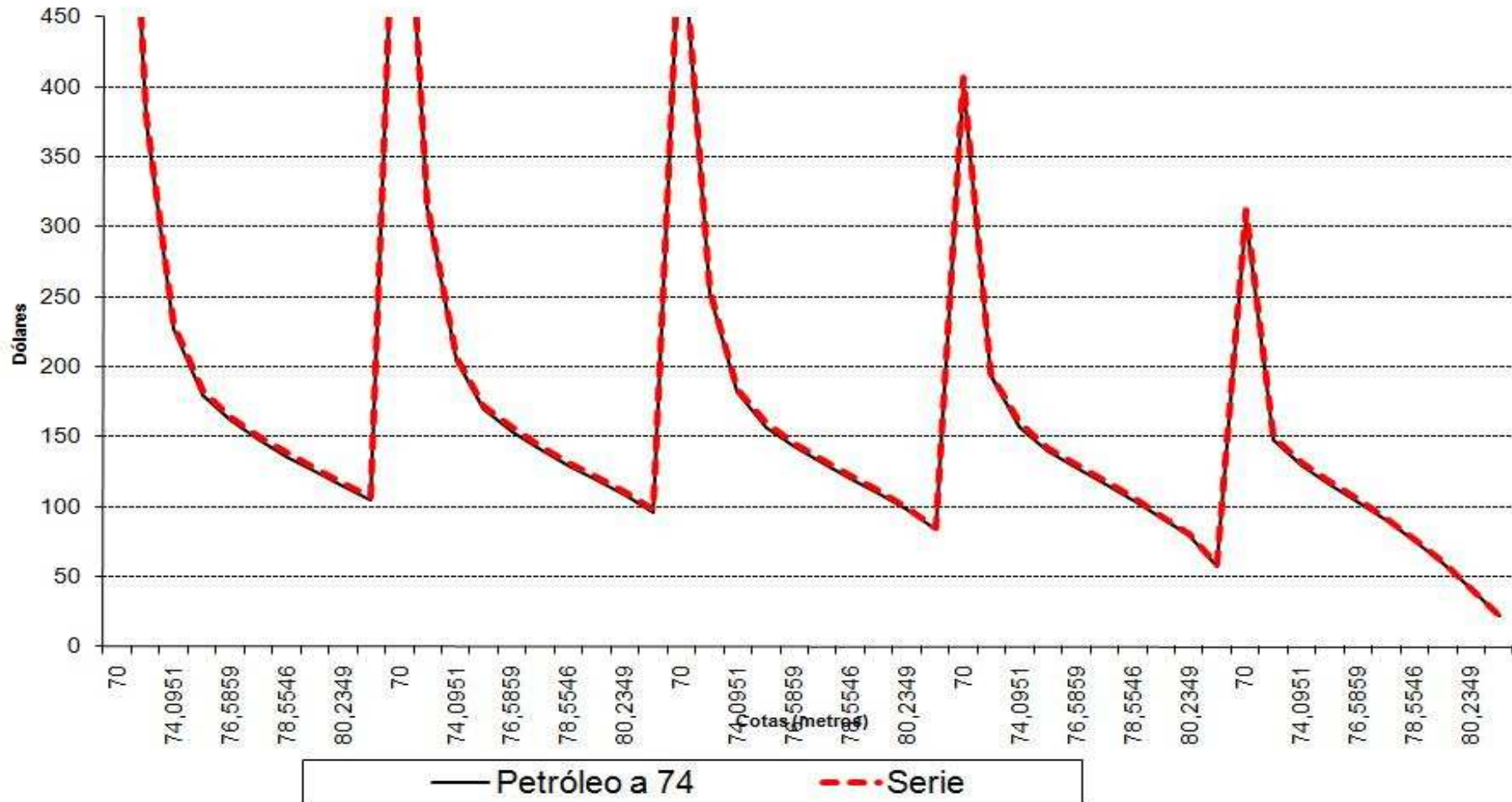
Valor del Agua – P. Petróleo USD 67 y Serie

Valor promedio del Agua con escenario a 67 y con la Serie de precios del Petróleo



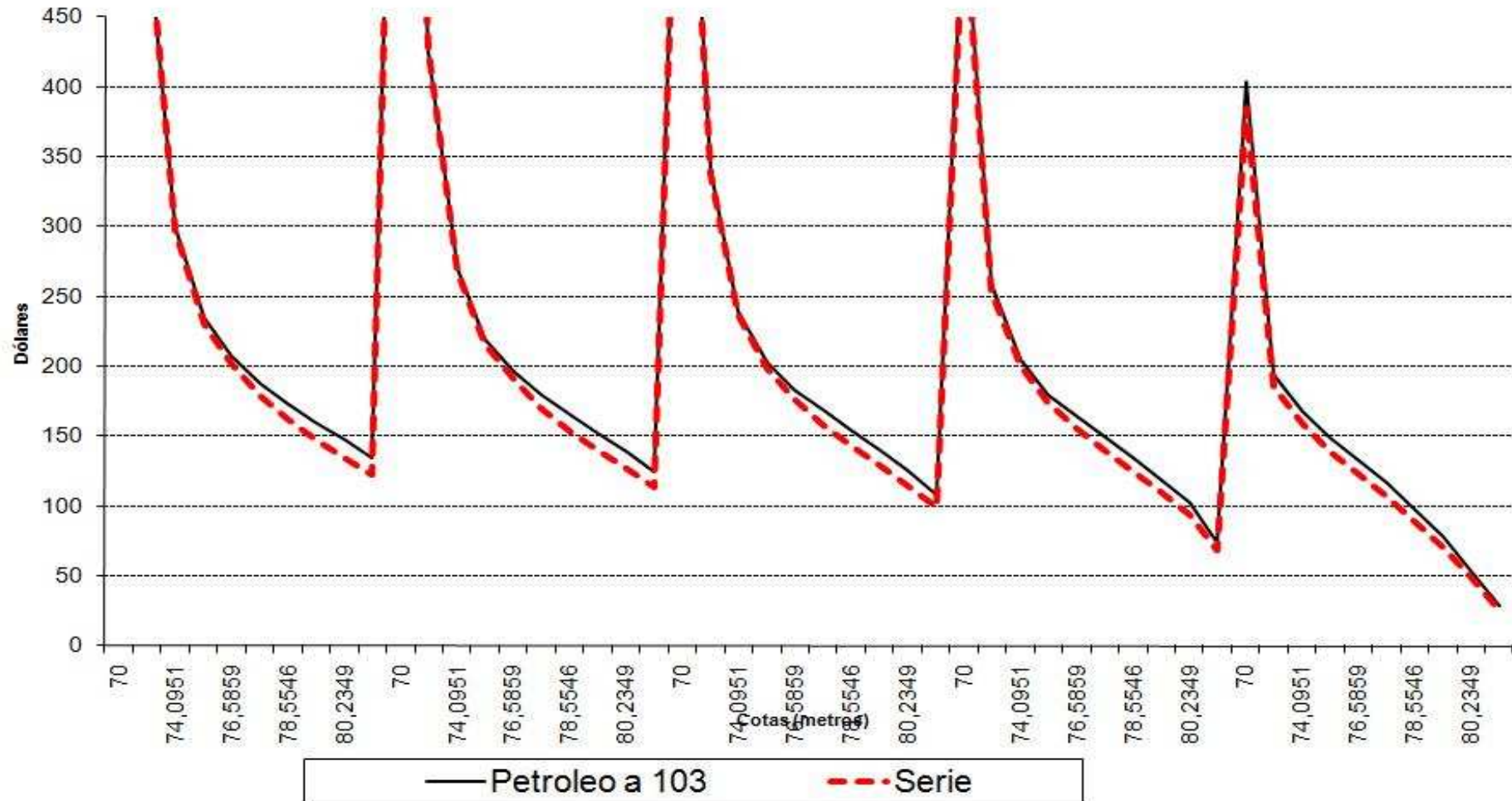
Valor del Agua – P. Petróleo USD 74 y Serie

Valor promedio del Agua con escenario a 74 y con la Serie de precios del Petróleo



Valor del Agua – P. Petróleo USD 103 y Serie

Valor promedio del Agua con escenario a 103 y con la Serie de precios del Petróleo



LERCY BARROS
ARISBEL AMBROSSI

GRACIAS POR SU TIEMPO