

## ANALISI DELLE QUOTAZIONI DI MERCATO DELL'ENERGIA

### DESCRIZIONE

Studio della stagionalità delle materie prime del comparto energetico valutando l'andamento del prezzo su tre diversi archi temporali : 1 anno ,5 anni e 10 anni

ANALISI DEI REQUISITI Potenziali interessati:

1. Utility energia 2. PMI

Tecnologia

Python e software di visualizzazione:Tablau e BI PERSONALE-ORGANIGRAMMA

project manager (economista)

stakeholder (responsabile utility)

data engineer data analyst data scientist

PM=cordinatore del progetto

STAKEHOLDER=portatore interessi dell'azienda appaltatrice dello studio

DATA.ENG= raccolta dati dalle varie piattaforme di commodity spread trading

DATA.ANALYST= creazione dashbord e strumenti di sintesi per le valutazioni del business

DATA SCIENTIST= creazione modelli predittivi dell'andamento dei prezzi per il comparto energy

Scopo

Anticipare i trend di stagionalità delle materie prime al fine di ottenere un vantaggio competitivo sui competitor, e sviluppare con modelli probabilistici possibili spread sul prezzo.

Documentazione

Report enti del settore energia.

STRUTTURAZIONE DEI REQUISITI IN GRUPPI DI FRASI OMOGENEE:

Si intende proporre l'analisi della media, mediana e deviazione standard dei profitti nonché la perdita minima e il massimo guadagno per ogni tipologia di materia prima energetica. Inoltre si vuole ricavare il tempo medio di uno spread nel periodo che intercorre fra l'acquisto e la vendita del contratto di future.

## GLOSSARIO:

### Termini

Anno Profitto

Drowdown

Stop loss

Take profit Percentuale del prezzo

### Descrizione

Periodo preso in considerazione Valore in dollari del movimento del future

Perdita massima, valore in dollari

Valore soglia per non andare in perdita

Valore soglia per trarre profitto dall'operazione Variazione percentuale mensile del prezzo della materia prima

|                 |  |
|-----------------|--|
| Future Contract | Obbligo di consegnare o ricevere una determinata quantità di una merce durante un determinato mese al prezzo stabilito |
|-----------------|--|

TIPOLOGIA DATI NECESSARI: Trattasi di dati strutturati Colonne:

- anno
  - punti→media
  - profitti→media
  - perdita max=min(profitti)
  - profitto max=max(profitti)
  - avg profitto→senza valori negativi
  - tolgo gli outliers
  - drowdown =max drowdown
  - calcolo la dev standard dei profitti=st.dev(profitti)
  - mediana dei profitti
- dove posiziono stop loss,take profit

### OUTCOME ATTESO:

Analisi predittiva sull'andamento della materia prima al fine di acquistare tale materia al momento giusto per garantire scorte sufficienti al massimo guadagno possibile minimizzando le perdite.