



## Outil d'anticipation du prix de l'électricité

*En application de la commande RTE 4500476602/R0UA du 22/11/2012*

### ***Résumé de l'étude***

L'objectif pour RTE est d'anticiper la cotation du prix de l'électricité sur le marché français.

#### **1. Le travail de la SCM**

Nous avons livré un logiciel d'anticipation, reposant sur les principes décrits dans notre fiche "indicateurs prospectifs", [http://scmsa.eu/fiches/SCM\\_Indicateurs\\_prospectifs.pdf](http://scmsa.eu/fiches/SCM_Indicateurs_prospectifs.pdf) permettant de prévoir, séparément, les périodes de forte hausse, de stagnation, de forte baisse.

A partir d'une base de données d'indicateurs (base de type "Bloomberg"), le logiciel extrait automatiquement deux triplets, l'un pour les hausses, l'autre pour les baisses.

Nous avons réalisé une anticipation sur 12 mois, en décembre 2012. Voici les triplets retenus :

#### **Triplet « haut » :**

- Indicateur 1 : "Germany / UMRTDE Index / EC Eurostats unemployment rates.M" ;
- Indicateur 2 : "Zone € / GECU30YR Index / Rendement emprunts d'Etats 30Y.M" ;
- Indicateur 3 : "Styrene Butadiene Rubber 1500-Polymer.Asia.Production Cash Cost Spot Basis.Asia/Pacific.M".

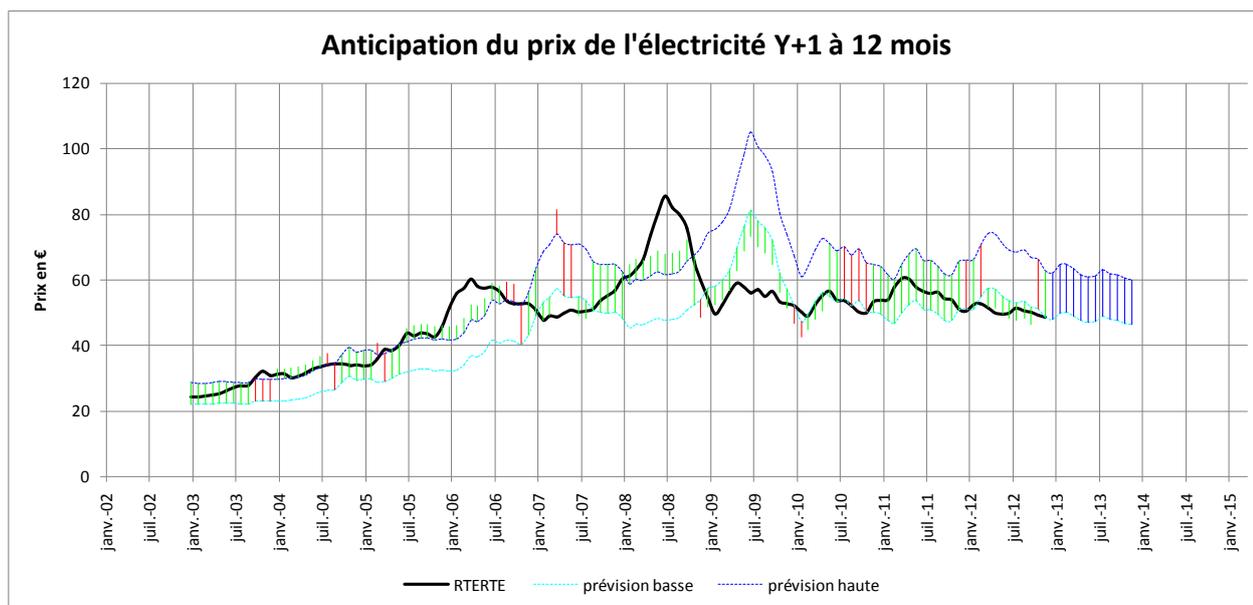
#### **Triplet « bas » :**

- Indicateur 1 : " Industrial confidence indicator. Seasonally adjusted data. Balance. European Union (27 countries).M " ;
- Indicateur 2 : " Consumer confidence Jobs hard to get SA (%) / CONCJOBH Index / Conference board.M " ;
- Indicateur 3 : " Chile.Amplitude adjusted (CLD).M " .

Le taux de bonne anticipation, obtenu au moyen de ces indicateurs, est de 82% sur tout l'historique (2003-2012) et de 85% sur les cinq dernières années (2008-2012), ce qui est très satisfaisant.

Pour le mois de décembre 2013, le logiciel anticipe une cotation du prix de l'électricité sur le marché français comprise entre 46 et 60 €/MWh.

La validation graphique de l'anticipation est présentée dans la figure ci-dessous. On peut y comparer, rétrospectivement, les prix réels avec les anticipations du logiciel.



## 2. Exploitation de l'outil par RTE

Ces résultats ont été obtenus par la SCM à partir de notre base de données, extraite de Bloomberg, et qui n'est pas mise à jour de manière régulière. Elle permet la constitution de l'outil et son exploitation instantanée, mais non son exploitation dans le futur. RTE a donc commencé la constitution d'une base de données appropriée, qui permettra l'exploitation régulière du logiciel.

La SCM a en outre fourni un outil permettant de sélectionner les données appropriées dans la base en cours de constitution.