

Valoración de contratos a plazo en mercados eléctricos. Aplicación al mercado ecuatoriano

K. Quizhpe; Á. Baíllo Moreno; M. Ventosa Rodríguez

Abstract-

Los mercados de energía eléctrica se caracterizan por la extrema volatilidad del precio spot. La incertidumbre asociada al precio es una fuente de riesgo tanto para los agentes vendedores (compañías de generación) como para los agentes compradores. Por este motivo, se hace necesario desarrollar herramientas y metodologías de análisis, valoración y gestión del riesgo asociado al negocio de generación. En este documento se propone, formula y desarrolla un procedimiento para la valoración de contratos mayoristas de electricidad a largo plazo con el objetivo de lograr un adecuado equilibrio entre riesgo y rentabilidad en el contexto de las empresas de generación que operan en el mercado eléctrico ecuatoriano.

Index Terms- Gestión del riesgo, contratos a plazo, profit at risk

Due to copyright restriction we cannot distribute this content on the web. However, clicking on the next link, authors will be able to distribute to you the full version of the paper:

[Request full paper to the authors](#)

If your institution has an electronic subscription to IEEE Latin America Transactions, you can download the paper from the journal website:

[Access to the Journal website](#)

Citation:

Quizhpe, K.; Baíllo, Á.; Ventosa, M. "Valoración de contratos a plazo en mercados eléctricos. Aplicación al mercado ecuatoriano", *IEEE Latin America Transactions*, vol.6, no.2, pp.184-193, .