

## Certifierad elhandlare

### 6. Riskhantering

13 november 2024

Clarion Hotel Sign, Östra Järnvägsgatan 35 i Stockholm

Kursledare/Föreläsare: Rickard Werneker, Josefin Bodell och Mårten Lind, MarketMath

Tiderna är ungefärliga

09:00 **Start: Risk**

*(Rickard Werneker)*

- Vilka är riskerna i marknaden?
- Hur kan man göra för att hedga?
- I vilken utsträckning reducerar hedgning ens risk?

Vi tittar på SYS, EPAD, valuta, profiler, volymrisk and balanskostnad.

10:00 **Paus**

10:15 **Mäta risk**

*(Josefin Bodell)*

Att mäta risk handlar om att se in i framtiden.

Vad är det för "slump" som beskriver elpriser? Och hur kan vi utnyttja det för att bestämma risken?

Guidad tur via normal- och log-normalfördelning och volatilitet till Value-at-Risk.

11:15 **Att prissätta en slutkund**

*(Rickard Werneker)*

Slutkundspriset byggs upp av olika element:

- Grundpris
- Valuta
- EPAD
- Månadsprofil

12:00 **Lunch**

13:00 **Att prissätta en slutkund (forts.)**

*(Rickard Werneker)*

Slutkundspriset byggs upp av olika element:

- Dygnsprofil
- Timprofil
- Övrigt

- 13:45      **Paus med kaffe**
- 14:15      **Solkraft**  
(*Mårten Lind*)
- 14:35      **Avräkning**  
(*Rickard Werneker*)
- Schablonavräkning
  - Månadsvis timavläsning
- 15:20      **Uppföljning**  
(*Rickard Werneker*)  
Vi tar en titt på ett par typiska portföljer och hur de utvecklar sig över tiden.
- 16:30      **Avslut**

**Med reservation för eventuella ändringar.**