

## Certifierad elhandlare

### 6. Riskhantering

23 november 2023

Scandic Klara, Slöjdgatan 7, Stockholm

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

09.00

#### **Start: Risk**

*(Rickard Werneker, VD, MarketMath)*

- 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, Tekn Dr)*

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**

*(Josefin Bodell, Tekn Dr)*

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 **Slutkundsportfölj**  
(*Rickard Werneker*)  
Vi tar en titt på en typisk slutkundsportfölj och hur den utvecklar sig över tiden.
- 16.20 **Avslut**

**Med reservation för eventuella ändringar.**