

Certifierad elhandlare

6. Riskhantering

27 april 2023

Scandic Klara, Slöjdgatan 7, Stockholm

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

09.15 **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.

10.15 **Paus**

10.30 **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.

11.30 **Att prissätta en slutkund**

(Josefin Bodell, Tekn Dr)

Slutkundspriset byggs upp av olika element:

- Grundpris
- Valuta
- EPAD
- Månadsprofil

12.15 **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.
- 16.30 **Avslut**

Med reservation för eventuella ändringar.