

## Certifierad elhandlare

### 6. Riskhantering - Webbinarium

19 november 2020 via Zoom-länk

Tiderna är ungefärliga

Kursledare/Föreläsare: Rickard Werneker och Josefin Bodell, MarketMath

08.30 **Incheckning och test av teknik**

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.

Paus 15 min

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.

Bensträckare 5 min

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

Paus 15 min

14:15

**Avräkning**

*(Rickard Werneker)*

- Schablonavräkning
- Månadsvis timavläsning

Bensträckare 10 min

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.**