

Certifierad elhandlare

6. Riskhantering

10 april 2025

Scandic Klara, Slöjdgatan 7 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.