

Wartość zagrożona jako instrument zarządzania ryzykiem pogodowym

Grzegorz MENTEL



monografia

słowa kluczowe: *value at risk, zarządzaniem ryzykiem pogodowym, pogodowe instrumenty pochodne, prognozowanie, bootstrap, backtesting*

p-ISBN 978-83-7934-187-0

e-ISBN 978-83-7934-367-6

dostęp: witryna wydawcy – luty 2020

ostateczna wersja

data opublikowania: 2017

licencja: CC BY-NC-ND

SPIS TREŚCI

Wstęp

1. Podstawy teorii niepewności i ryzyka
 - 1.1. Próba zdefiniowania ryzyka w warunkach niepewności
 - 1.2. Ryzyko i niepewność jako zjawiska obiektywne
 - 1.3. Typy i rodzaje ryzyka
 - 1.4. Źródła ryzyka i jego stopniowanie
 - 1.5. Przyczyny niepewności
2. Proces zarządzania ryzykiem
 - 2.1. Charakterystyka procesu. Ogólne metody zarządzania ryzykiem
 - 2.2. Ilościowe ujęcie zarządzania ryzykiem
 - 2.3. Modele zarządzania ryzykiem. Próba klasyfikacji
 - 2.4. Współczesne teorie zarządzania ryzykiem
3. Zarządzanie ryzykiem pogodowym
 - 3.1. Istota i cechy ryzyka pogodowego
 - 3.2. Wpływ nieekstremalnych zdarzeń pogodowych na wyniki finansowe podmiotów gospodarczych
 - 3.3. Zarządzanie ryzykiem nieekstremalnych zdarzeń pogodowych – etapy, metody
 - 3.4. Zabezpieczanie się przed ryzykiem pogodowym. Rozwój rynku pogodowych instrumentów pochodnych
 - 3.5. Wykorzystanie instrumentów pochodnych w zarządzaniu ryzykiem niekatastroficznych zdarzeń pogodowych
4. Czynniki pogodowe w świetle prognoz meteorologicznych
 - 4.1. Prognozy meteorologiczne – koncepcja wykorzystania
 - 4.2. Analiza własności instrumentów bazowych
 - 4.3. Charakter zmienności indeksów pogodowych
5. Metody analizy ryzyka rynkowego w warunkach pogodowych
 - 5.1. Zarządzanie ryzykiem pogodowym w ujęciu Weather-VaR. Założenia modelowania wartości zagrożonej

- 5.2. Backtesting procedurą weryfikującą wartość narażoną na ryzyko
- 5.3. Bootstrap jako kontrola nad poziomem błędu wartości zagrożonej
- 5.4. Multisezonowość danych pogodowych

Zakończenie
Bibliografia
Spis rysunków
Spis tabel