

# Wartość zagrożona jako instrument zarządzania ryzykiem pogodowym

Grzegorz Mentel



monografia

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

© Copyright by Oficyna Wydawnicza Politechniki Rzeszowskiej, Rzeszów 2017

ISBN 978-83-7934-187-0

244 strony

format B5

oprawa twarda

cena 60,00 zł

## 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 niekatastroficzkich 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