

[opis]

Pogoda znacząco wpływa na wszystkie sfery działalności człowieka, przez co ma ogromny wpływ na aktywność biznesową. Lista przedsiębiorstw, których przychody są od niej zależne, jest bardzo długa. Szacuje się, że pogoda bezpośrednio lub pośrednio wpływa na przychody trzech z czterech firm. Taki stan rzeczy czyni ją wszechobecną, a wszelkie próby jej okiełznania nabierają w ostatnich latach wyjątkowego znaczenia.

Niniejsza monografia stanowi zwarte opracowanie dotyczące procesu zarządzania ryzykiem pogodowym z uwzględnieniem nowej koncepcji zwanej Weather-VaR. Jest jednocześnie studium teoriopoznawczym nad problemami płynącymi ze zmieniających się warunków pogodowych. Dotyczy głównie opisu procesu przez odpowiednie jego zdefiniowanie, jak i wskazanie ekonomicznych skutków oddziaływania konkretnych czynników pogodowych na określone sektory gospodarki. Odnosi się do aspektów wdrożeniowych przedziałowych miar ryzyka rynkowego w warunkach pogodowe, zwłaszcza w okresach krótkoterminowych. W monografii dokonano charakterystyki i oceny skuteczności wartości zagrożonej przez analizę tzw. bezwarunkowego pokrycia oraz analizę niezależności i oceny właściwości prognostycznych przekładających się na zwiększenie precyzji wyceny pogodowych instrumentów zabezpieczających. Nowatorski charakter pracy wynika z podejścia do modelowania wartości narażonej na ryzyko w ujęciu wyłącznie badania czynnika pogodowego jako instrumentu "sprawczego", którego przewidywania mogą znacząco wpłynąć na rynek terminowych kontraktów pogodowych.

[spis]

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 pogodne 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

Streszczenie

Summary