

SPIS TREŚCI

WPROWADZENIE	9
Rozdział 1.	
ISTOTA RYZYKA	17
1.1. Koncepcja ryzyka	17
1.2. Filozoficzne i praktyczne źródła ryzyka	27
1.3. Ryzyko w klasycznym nurcie teorii ekonomii	34
1.4. Ryzyko w poglądach szkół ekonomicznych niemieszczących się w nurcie klasycznym	43
1.5. Ryzyko jako funkcja w świetle teorii systemów	50
1.6. Koncepcje teoretyczne ryzyka w analizie inwestycji infrastrukturalnych w transporcie	55
Rozdział 2.	
UWARUNKOWANIA ANALIZY RYZYKA W INWESTYCJACH INFRASTRUKTURALNYCH	60
2.1. Determinanty badania ryzyka w transporcie	60
2.1.1. Specyfika analizy ryzyka inwestycji infrastrukturalnych.	60
2.1.2. Determinanty instytucjonalne i polityczne analizy ryzyka w infrastrukturze transportu	61
2.1.3. Źródła ryzyka w inwestycjach w infrastrukturze transportu	68
2.1.4. Metody finansowania inwestycji infrastrukturalnej a ryzyko	73
2.1.4.1. Finansowanie ze środków publicznych szczebla centralnego	78
2.1.4.2. Finansowanie na poziomie JST	82
2.1.4.3. Finansowanie kapitałami prywatnymi	85
2.1.4.4. Finansowanie w systemie PPP	88
2.2. Ryzyko w projektach inwestycyjnych z punktu widzenia interesariuszy	97
2.3. Alokacja ryzyka w procesie inwestowania w infrastrukturze	100
2.3.1. Zasady przenoszenia ryzyka	100
2.3.2. Metody przenoszenia ryzyka	109
2.3.3. Alokacja ryzyka projektu w zgodzie z FIDIC	111
Rozdział 3.	
PROCES ANALIZY RYZYKA W INWESTYCJACH INFRASTRUKTURALNYCH	118
3.1. Analiza ryzyka w ekonomii	118
3.2. Etapy procesu analizy i zarządzania ryzykiem	124

3.2.1. Planowanie procesu	124
3.2.2. Analiza ryzyka.	125
3.2.3. Zarządzanie ryzykiem	128
3.2.4. Monitorowanie i kontrola ryzyka	131
3.3. Systematyka ryzyka	132
3.4. Klasyfikacja ryzyka w inwestycjach infrastrukturalnych w transporcie	146
Rozdział 4.	
RODZAJE RYZYKA W INWESTYCJACH INFRASTRUKTURALNYCH	154
4.1. Ryzyko wynikające z otoczenia projektu	154
4.2. Ryzyko wewnętrzne wynikające ze sposobu realizacji projektu.	188
Rozdział 5.	
METODY I INSTRUMENTY OCENY RYZYKA W INWESTYCJACH INFRASTRUKTURALNYCH W TRANSPORCIE	207
5.1. Teoretyczne podstawy oceny ryzyka projektów inwestycyjnych	207
5.1.1. Metodyka oceny ryzyka	207
5.1.2. Metody ilościowe oceny ryzyka	210
5.1.3. Metody jakościowe oceny ryzyka	221
5.2. Ryzyko w standardach zarządzania projektami	238
5.3. Wzorce oceny ryzyka inwestycji infrastrukturalnych w transporcie	246
5.3.1. Metodyka europejska – CBA/MCA	246
5.3.2. Metodyka CBA-DK	256
5.3.3. Zalecenia oceny ryzyka inwestycji infrastrukturalnych w Polsce	258
5.3.4. Metoda brytyjska – redukcji nadmiernego optymizmu w ocenie ryzyka	264
5.3.5. Inne rozwiązania światowe	267
5.3.6. Porównanie modeli oceny	272
Rozdział 6.	
METODA REFERENCYJNEJ OCENY RYZYKA.	277
6.1. Podstawy metody referencyjnej oceny ryzyka	277
6.2. Model relacji	283
6.2.1. Główne kategorie ryzyka	283
6.2.2. Elementy składowe głównych grup ryzyka w modelu relacji	286
6.3. Model oceny ryzyka	296
6.3.1. Ocena referencyjna	296
6.3.2. Modelowanie w oparciu o logikę rozmytą	300
6.3.3. Model referencyjny	309
6.3.4. Model aplikacyjny	312

Rozdział 7.

MODELOWA OCENA RYZYKA W INWESTYCJACH W POLSKIEJ INFRASTRUKTURZE AUTOSTRADOWEJ	315
7.1. Uwarunkowania oceny	315
7.2. Ocena ryzyka kosztów autostradowych inwestycji infrastrukturalnych w Polsce	320
7.3. Ocena ryzyka czasu w inwestycjach w infrastrukturze autostradowej w Polsce	331
7.4. Analiza wyników i wytyczne do oceny projektów indywidualnych	341
ZAKOŃCZENIE	354
BIBLIOGRAFIA	358
SPIS RYSUNKÓW.	390
SPIS TABEL	391

Aneks 1.

PODSTAWOWE OPERACJE NA ZBIORACH ROZMYTYCH	394
---	-----

Aneks 2.

OBLICZONE FUNKCJE PRZYNALEŻNOŚCI MODELI OCENY RYZYKA	398
---	-----

Aneks 3.

KWESTIONARIUSZ BADANIA RYZYKA W PROJEKCIE Z ZAKRESU INFRASTRUKTURY TRANSPORTU	399
--	-----