

SPIS TREŚCI

Wstęp	7
Rozdział 1. Sytuacja ekonomiczno-finansowa a ryzyko działalności podmiotów gospodarczych	13
1.1. Fluktuacje sytuacji gospodarczej i ich właściwości	13
1.2. Przegląd metod badania sytuacji gospodarczej na poziomie międzynarodowym i krajowym	18
1.3. Istota i zarządzanie ryzykiem w działalności gospodarczej	25
1.4. Klasyfikacja ryzyka podmiotów gospodarczych	30
Rozdział 2. Konceptualizacja i metody pomiaru ryzyka sektorowego	35
2.1. Pojęcie sektora działalności gospodarczej i istota jego ryzyka	35
2.2. Kondycja branż gospodarki a ryzyko sektorowe	40
2.3. Studia nad ryzykiem sektorowym na świecie i w Polsce	43
2.4. Teoretyczne podstawy pomiaru ryzyka	45
2.5. Metody pomiaru ryzyka sektorowego i optymalizacji struktury branżowej portfela inwestycyjnego	52
Rozdział 3. Metody stosowane w badaniu sytuacji ekonomiczno-finansowej sektorów gospodarczych	57
3.1. Metody konstrukcji zmiennych syntetycznych	57
3.2. Metody analizy danych panelowych	69
3.3. Modele autoregresyjne jednowymiarowe	72
3.4. Wektorowe modele autoregresyjne	80
3.5. Metody badania cykliczności zjawisk	87

Rozdział 4. Badanie fluktuacji sytuacji ekonomiczno-finansowej gałęzi i działów <i>przemysłu przetwórczego</i>	97
4.1. Metodologia badań	97
4.2. Charakterystyka danych i obiektów badawczych.	100
4.3. Wyniki badania kondycji branż	102
4.3.1. Analiza kondycji ekonomiczno-finansowej działów i gałęzi <i>przemysłu przetwórczego</i>	102
4.3.2. Ocena wpływu specyfiki gałęzi i działów na pomiar ich kondycji	109
4.3.3. Modelowanie struktury autoregresyjnej indywidualnych indeksów kondycji branż	111
4.3.4. Analiza kointegracji indeksów kondycji działów <i>przemysłu przetwórczego</i>	117
4.3.5. Badanie cykliczności zmian sytuacji ekonomiczno-finansowej branż	123
 Rozdział 5. Identyfikacja, pomiar i ocena ryzyka branżowego w polskim <i>przemysle przetwórczym</i>	137
5.1. Ocena ryzyka indywidualnego gałęzi i działów <i>przemysłu przetwórczego</i>	137
5.2. Optymalizacja struktury gałęziowej portfela inwestycyjnego	145
5.3. Prognozy poziomu ryzyka sektorowego	153
 Zakończenie	161
Literatura	169
Spis tabel	177
Spis rysunków	179
Aneks	181