

Opis rozprawy

Imię i nazwisko autora rozprawy	mgr inż. Maciej Celej
Imię i nazwisko promotora rozprawy	Prof. dr hab. inż. Roman Magda
Wydział	Wydział Górnictwa i Geoinżynierii
Instytut/Katedra/Zakład	Katedra Ekonomiki i Zarządzania w Przemysle
Data obrony (wystarczy rok)	2016
Tytuł rozprawy	<b>Modelowanie strategii zabezpieczającej wynik finansowy przedsiębiorstwa górnictwa z wykorzystaniem kontraktów opcyjnych</b>
Język rozprawy	polski
Streszczenie rozprawy w jęz. polskim (max 1400 znaków)	<p>Racjonalne funkcjonowanie przedsiębiorstwa w warunkach gospodarki globalnej wiąże się z potrzebą umiejętnego i sprawnego zarządzania, szczególnie wtedy, kiedy zysk wypracowany przez przedsiębiorstwo jest skorelowany ze zmianami cen, kursów walut oraz stóp procentowych na rynkach finansowych.</p> <p>W procesie zarządzania ryzykiem finansowym kluczową rolę odgrywają instrumenty pochodne, które w pracy traktowane są jako podstawa, na której przedsiębiorstwo może opierać strategię operacyjną.</p> <p>Celem rozprawy jest opracowanie autorskiej metody zabezpieczania wyniku finansowego przedsiębiorstwa górnictwa poprzez wykorzystanie kontraktów opcyjnych. Proponowana metoda oraz przedstawiony w pracy proces modelowania rachunku zysków i strat opiera się o modele zmienności z rodziny GARCH.</p> <p>Docelowo zaproponowana metoda może pełnić funkcję wspomagającą procesy zarządcze w przedsiębiorstwie, umożliwiając kadrze zarządzającej budowę strategii zabezpieczającej, która posłuży zwiększeniu prawdopodobieństwa realizacji przyjętych założeń budżetowych.</p>
Tytuł i streszczenie rozprawy w jęz. angielskim (max 1400 znaków)	<p><b>Modeling a hedging strategy based on the application of option contracts in securing the financial profit of a mining company</b></p> <p>Business efficiency in terms of global economy refers to the need of a skillful and effective management, particularly when the profit that has been attained by a company correlates with the price change, the exchange rate and interests rates on the financial market.</p> <p>In the process of risk management the key factor centers around derivative instruments that are treated as the basis on which the company can build its operational strategy.</p>

	<p>The aim of this thesis is to devise an authorial method that could secure the financial result through the use of option contracts. The proposed method and the presented process of modeling the profit and loss account is based on Garch models of volatility</p> <p>Ultimately, the proposed method may function as a tool to support the management process allowing the management board to build a hedging strategy that will increase the probability of the accomplishment of the budget projections</p>
--	--

27.06.2016  
Cdy