

Projekt – zadanie 5

Termin prezentacji: 18-19.06.2024

1. Dla jednego z analizowanych ryzyk (zmiennych ryzyka lub ryzyk z rejestru ryzyka) zaproponuj strategię zabezpieczenia się przed ryzykiem z wykorzystaniem rzeczywistych instrumentów pochodnych. Oblicz VaR lub wybraną miarę wrażliwości dla tej strategii.
2. Oszacuj prawdopodobieństwo niewypłacalności (defaultu) w modelu KMV dla dwóch wybranych kontrahentów analizowanej firmy.