

**PROGRAM**  
**Seminarium z cyklu „Europejskie Przedsiębiorstwo”**  
**„Analiza i zarządzanie ryzykiem inwestycyjnym przedsiębiorstwa**  
**w przedsięwzięciach międzynarodowych”**

**27 kwietnia 2016 r. , godz. 10:30 – 14:30**  
Warszawa, Sienna Training Centre, ul. Sienna 73

**Prelegent:**

**Pan dr Tomasz Krawczyk** – Doktor nauk ekonomicznych, specjalność: zarządzanie projektami badawczymi, ekonometria finansowa, rynki kapitałowe, modelowanie ryzyka w projektach inwestycyjnych. Obecnie zatrudniony na Wydziale Nauk Ekonomicznych Uniwersytetu Warszawskiego, konsultant Enterprise Europe Network oraz wiceprzewodniczący odpowiedzialny za współpracę z przemysłem w ramach projektu European Nuclear Science and Applications Research 2. Posiadacz międzynarodowego certyfikatu European Foundation Certificate in Banking.

**Rejestracja uczestników – godz. 10:00**

**Godz. 10:30 Część I**

- 1. Czym jest ryzyko?**
  - a. Krótka historia ryzyka
  - b. Postępowanie wobec ryzyka
- 2. "Casino business", czyli rachunek prawdopodobieństwa i statystyka dla przedsiębiorczych**
  - a. Rachunek prawdopodobieństwa dla przedsiębiorczych
  - b. Statystyczne mierniki przydatne w zarządzaniu ryzykiem przedsiębiorstwa
- 3. Biznes plan - finansowe ujęcie inwestycji przedsiębiorstwa**
  - a. Plan przychodów i kosztów
  - b. Inwestycje
  - c. Rachunek zysków i strat
  - d. Bilans
  - e. Podstawowe wskaźniki finansowe
  - f. Biznes plan a NPV
  - g. Biznes plan a analiza ryzyk przedsiębiorstwa

**Ok. godz. 12:00 Przerwa (30 min.)**

**Godz. 12:30 Część II**

- 1. Uniwersalne metody umożliwiające ocenę i zarządzanie ryzykiem w międzynarodowych przedsięwzięciach inwestycyjnych**
  - a. Metoda Monte Carlo - symulacja biznes planu, symulacja NPV
  - b. Metody oparte na Instrumentach pochodnych - opcje finansowe i opcje realne, kontrakty
  - c. Metody oparte na drzewach decyzyjnych - teoria decyzji w warunkach ryzyka
  - d. Metody ekonometryczne - modele klasyczne i szeregów czasowych
- 2. Zastosowania praktyczne oceny i zarządzania ryzykiem w przedsięwzięciach międzynarodowych**
  - a. Start-up - analiza i zarządzanie ryzykiem nowego przedsięwzięcia inwestycyjnego
  - b. Przedsiębiorstwo na rynkach międzynarodowych - handel międzynarodowy a inżynieria finansowa
  - c. Projekt badawczo-rozwojowy – zarządzanie ryzykiem projektu badawczo-rozwojowego
- 3. Międzynarodowe przykłady katastrof oraz ich wpływ na funkcjonowanie przedsiębiorstwa**
  - a. Elementy teorii katastrof
  - b. Wahadłowiec Challenger - przemysł kosmiczny (dostawca uszczelki)
  - c. 11 września 2001 zamachy na World Trade Center - (załamanie giełd światowych)
  - d. Kryzys 2008 - 2011 - (załamanie giełd światowych i przejście kryzysu do strefy realnej)
  - e. Problem kryzysu organizacyjnego opartego na innowacyjności technologicznej (problem generacji technologicznej tzw. wyścig kolejnych generacji )
  - f. Problemy przedsiębiorstw z UE wynikające z sankcji gospodarczych (firmy sprzedające produkty rolne)

**Godz. 14:00 Pytania uczestników/Dyskusja panelowa**

**Godz. 14:30 Zakończenie seminarium**