

Zarządzanie ryzykiem

1. Pojęcie ryzyka bankowego, rodzaje

2. Przyczyny wpływające na wzrost ryzyka
3. Zarządzanie ryzykiem bankowym
4. Pojęcie ryzyka stopy procentowej
5. Zarządzanie ryzykiem luki funduszowej
6. Zarządzanie ryzykiem skumulowanej luki funduszowej
7. Analiza czynników wpływających na dochód banku
8. Zarządzanie luką okresowości (CAP)
9. Analiza okresowości w banku komercyjnym
10. Operacje FRA zabezpieczające ryzyko stopy procentowej
11. Operacje FUTURES zabezpieczające ryzyko stopy procentowej
12. Transakcje CAP
13. Transakcje FLOOR
14. Transakcje COLLAR i CORRIOR
15. Transakcje SWAP
16. Kontrakty opcyjne zabezpieczające ryzyko stopy procentowej
17. Transakcje FORWARD zabezpieczające ryzyko stopy procentowej
18. Ryzyko walutowe, definicje
19. Instytucjonalne formy zabezpieczenia ryzyka walutowego
20. Wybór waluty kontraktu jako forma zabezpieczenia ryzyka walutowego
21. Klauzule waloryzacyjne
22. Walutowe prawa opcyjne
23. Platności przyspieszone, kredyty banku eksperta dla importera, przedpłaty
24. Instrumenty kompensujące ryzyko walutowe
25. Kontrakty walutowe SPOT i FORWARD
26. Transakcje zabezpieczające ryzyko walutowe FUTURES
27. SWAP-y walutowe
28. Opcje walutowe
29. Zarządzanie ryzykiem płynności – podstawowe pojęcia

30. Płynność i rentowność banku
31. Ryzyko płynności i jego przyczyny
32. Teoretyczne koncepcje regulowania płynności
33. Metoda puli zasobów finansowych
34. Metoda konwersji zasobów finansowych
35. Metoda aktywnego zarządzania pasywami
36. Metoda sekurytyzacji należności kredytowych
37. Identyfikacja i pomiar ryzyka płynności
38. Zewnętrzne normy płynności
39. Operatywne sterowanie płynnością
40. Kontrola i monitoring płynności
41. Mierniki oceny płynności banku
42. Ryzyko kredytowe, pojęcia, klasyfikacja
43. Czynniki wpływające na zwiększenie ryzyka kredytowego
44. Ocena zdolności kredytowej
45. Procedury oceny zdolności kredytowej
46. Ograniczenie koncentracji kredytowej
47. Monitoring kredytowy
48. Subiektywne mierniki kredytowe
49. Obiektywne mierniki kredytowe
50. Analiza dyskryminacyjna przy ocenie zdolności kredytowej
51. Fundusze własne banku jako element ograniczenia ryzyka
52. Współczynnik wypłacalności
53. Rezerwy celowe
54. Limity koncentracji kredytów
55. Regulacje dotyczące obrotu papierami wartościowymi
56. Pozycje walutowe i ich limitowanie
57. Ryzyko, rentowność i płynność banku
58. Zysk i ryzyko portfela papierów wartościowych
59. Ryzyko kapitałowe w banku
60. Ryzyko defraudacji
- 61. Ryzyko handlowe banku komercyjnego**