

Spis treści

Wstęp

1 Wprowadzenie do zarządzania finansowego bankiem

- 1.1. Banki jako pośrednicy finansowi i ich otoczenie
- 1.2. Regulacje dotyczące działalności bankowej
- 1.3. Cele działalności bankowej
- 1.4. Definicja zarządzania finansowego bankiem

2 Sprawozdania finansowe banku

- 2.1. Ogólne zasady konstrukcji sprawozdań finansowych
- 2.2. Sprawozdania udostępniane szerokiej publiczności
 - 2.2.1. Bilans
 - 2.2.2. Rachunek zysków i strat
 - 2.2.3. Pozostałe sprawozdania finansowe
- 2.3. Sprawozdania zarządcze

3 Zarządzanie efektywnością

- 3.1. Co podlega ocenie efektywności i jak ją mierzyć?
- 3.2. Wskaźniki finansowe
- 3.3. Model ROE
- 3.4. Metody wartości dodanej
 - 3.4.1. Ogólne założenia metod wartości dodanej
 - 3.4.2. SVA a EVA
 - 3.4.3. Zasady szacowania EVA
- 3.5. Ocena efektywności transakcji
 - 3.5.1. Kalkulacja nadwyżki odsetkowej
 - 3.5.2. Kalkulacja kosztu jednostkowego
 - 3.5.3. Pozostałe składniki marży
- 3.6. Jak zarządzać efektywnością?

4 Zarządzanie ryzykiem

- 4.1. Co to jest ryzyko oraz jak je mierzyć?
- 4.2. Bazylea II, Bazylea III i pozostałe regulacje ostrożnościowe
- 4.3. Metody pomiaru ryzyka bankowego
 - 4.3.1. Ryzyko kredytowe
 - 4.3.2. Ryzyko struktury aktywów i pasywów
 - 4.3.3. Ryzyko rynkowe
 - 4.3.4. Ryzyko operacyjne
- 4.4. Modele wartości zagrożonej (VaR)
 - 4.4.1. Modele VaR dla ryzyka rynkowego
 - 4.4.2. Modele VaR dla ryzyka kredytowego
 - 4.4.3. Modele VaR dla ryzyka operacyjnego
- 4.5. Jak zarządzać ryzykiem?

5 Zarządzanie kapitałem

- 5.1. Co to jest kapitał banku?
- 5.2. Kapitał regulacyjny
- 5.3. Kapitał ekonomiczny
- 5.4. Alokacja kapitału
- 5.5. Jak zarządzać kapitałem?

6 Zintegrowane zarządzanie efektywnością i ryzykiem

- 6.1. Co to jest zintegrowane zarządzanie efektywnością i ryzykiem?
- 6.2. Zastosowanie RORAC/RAROC do oceny kredytu
- 6.3. Modele RORAC/RAROC „GO’ RA-DO’ Ł” (top-down)
- 6.4. Modele RORAC/RAROC „DO’ Ł-GO’ RA” (bottom-up)
- 6.5. Zarządzanie efektywnością i ryzykiem w sposób zintegrowany

Bibliografia