

Analiza i zarządzanie ryzykiem walutowym w działalności bankowej

Jeśli potrzebują Państwo więcej informacji o tej pracy, to proszę pisać - [kontakt](#)

magisterska, politechnika rzeszowska

SPIS TREŚCI

1. RYZYKO BANKOWE 3
 - 1.1. POJĘCIE I ISTOTA RYZYKA W DZIAŁALNOŚCI BANKOWEJ. 3
 - 1.2. KLASYFIKACJA RYZYK BANKOWYCH. 4
 - 1.3. RYZYKO WALUTOWE W DZIAŁALNOŚCI BANKÓW. 11
 - 1.3.1. POJĘCIE RYZYKA WALUTOWEGO. 11
 - 1.3.2. RODZAJE RYZYKA WALUTOWEGO. 11
 - 1.4. RYZYKO WALUTOWE – ASPEKT HISTORYCZNY 16
 - 1.4.1. SYSTEM WALUTY ZŁOTEJ 16
 - 1.4.2. SYSTEM Z BRETTON WOODS 18
 - 1.4.3. WZROST POZYCJI DOLARA 18
 - 1.4.4. LATA PIĘCDZIESIĄTE I SZEŚĆDZIESIĄTE XX WIEKU 19
 - 1.4.5. ROZPAD SYSTEMU Z BRETTON WOODS 20
 - 1.4.6. UMOWA WASZYNGTOŃSKA (SMITHSONIAN AGREEMENT) 20
 - 1.4.7. EUROPEJSKI SYSTEM WALUTOWY 21
 - 1.5. EURO – WPROWADZENIE I ZASADY DZIAŁANIA. 23
 - 1.5.1. ISTOTA EURO. 23
 - 1.5.2. ETAPY WPROWADZANIA EURO. 24
 - 1.5.3. ZASADY STOSOWANIA KURSÓW KONWERSJI. 26
 - 1.5.4. KSZTAŁTOWANIE KURSU WYMIANY EURO 27
2. GLOBALNY CHARAKTER MIĘDZYNARODOWYCH RYNKÓW WALUTOWYCH. 29
 - 2.1 POJĘCIE WALUTY, DEWIZY I KURSU WALUTOWEGO. 29
 - 2.1.1 KLASYFIKACJA KURSÓW WALUTOWYCH. 30
 - 2.1.2 STRUKTURA KOSZYKA WALUTOWEGO. 35
 - 2.2 CZYNNIKI WPŁYWAJĄCE NA KSZTAŁTOWANIE SIĘ KURSU WALUTOWEGO.

36

- 2.3 PROGNOZOWANIE KURSÓW WALUTOWYCH. 44
- 2.4 INTERWENCJE WALUTOWE. 47
- 2.5 ROLA BANKÓW W ROZLICZENIACH MIĘDZYNARODOWYCH. 49
 - 2.5.1 FUNKCJE PEŁNIONE PRZEZ BANKI NA RYNKACH MIĘDZYNARODOWYCH. 49
 - 2.5.2 OPERACJE WŁASNE BANKÓW NA RYNKACH MIĘDZYNARODOWYCH. 50
- 2.6 KWANTYFIKACJA RYZYKA WALUTOWEGO. 51
 - 2.6.1 METODA POZYCJI WALUTOWEJ. 51
 - 2.6.2 ANALIZA SCENARIUSZY OPARTA NA PROGNOZACH KURSÓW WYMIANY. 56
 - 2.6.3 METODA VALUE AT RISK (VAR). 57
 - 2.6.4 POMIAR RYZYKA WALUTOWEGO WEDŁUG PROPOZYCJI KOMITETU BAZYLEJSKIEGO. 58
- 3 METODY OGRANICZANIA RYZYKA WALUTOWEGO W DZIAŁALNOŚCI BANKÓW. 61
 - 3.1 ZARZĄDZANIE RYZYKIEM WALUTOWYM. 61
 - 3.2 STRATEGIE OGRANICZANIA RYZYKA WALUTOWEGO 63
 - 3.3 TERMINOWE TRANSAKCJE DEWIZOWE. 65
 - 3.3.1 TRADYCYJNE TERMINOWE TRANSAKCJE WALUTOWE (FORWARD). 66
 - 3.3.2 TRANSAKCJE TERMINOWE NOWEGO TYPU. 70
 - 2.1.1.1 Swapy pochodne. 72
 - 2.1.1.2 Kontrakty walutowe futures. 77
 - 2.1.1.3 Opcje walutowe. 81

Jeśli chcesz zamówić pisanie pracy od podstaw, to zapraszamy na stronę [pisanie prac](#) - sprawdzony serwis