Analiza i zarządzanie ryzykiem walutowym w działalności bankowej

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 PIĘĆDZIESIĄTE 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