

Wykorzystywanie niektórych transakcji pochodnych w celu zarządzania ryzykiem stopy procentowej banku

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

Praca magisterska obroniona na 5 w Poznaniu, Akademia Ekonomiczna, stron 80, bibliografia 49 pozycji

WSTĘP

ROZDZIAŁ I: RYZYKO BANKOWE

- 1.1. Pojęcie i istota ryzyka
- 1.2. Rodzaje ryzyka bankowego
- 1.3. Czynniki wpływające na wzrost ryzyka
- 1.4. Kontrola ryzykiem zarządzanie ryzykiem banku
- 1.5. Cele zarządzania ryzykiem banku

ROZDZIAŁ II : RYZYKO STOPY PROCENTOWEJ BANKU

- 2.1. Istota i systematyka ryzyka stopy procentowej oraz czynniki wpływające na kształtowanie się rynkowej stopy procentowej
 - 2.1.1. Ryzyko stopy procentowej
 - 2.1.2. Systematyka ryzyka stopy procentowej
 - 2.1.3. Czynniki wpływające na kształtowanie się rynkowej stopy procentowej
- 2.2. Zarządzanie ryzykiem stopy procentowej
 - 2.2.1. Kontrola wewnętrzna
 - 2.2.2. Metody pomiaru i monitorowania
 - 2.2.2.1. Metoda luki
 - 2.2.2.2. Metoda analizy czasu trwania – duration

2.3.2.3. Metoda badania elastyczności

2.3 Dyrektywy zarządzania ryzykiem stopy procentowej towarzyszące

transakcjom pochodnym zawierany przez banki

ROZDZIAŁ III : ZABEZPIECZENIE RYZYKA STOPY PROCENTOWEJ BANKU ORAZ JEGO REDUKCJA PRZY UŻYCIU TRANSAKCJI TERMINOWYCH TYPU FRA I FINANCIAL FUTURES

3.1. Regulacje dotyczące transakcji pochodnych

3.1.1. Istota transakcji pochodnych

3.1.2. Klasyfikacja instrumentów pochodnych

3.1.3. Główne motywy wykorzystania instrumentów pochodnych oraz związane z nimi ryzyko

3.2. Operacje Forward Rate agreement zabezpieczające ryzyko stopy procentowej

3.2.1. Unormowania dotyczące FRA

3.2.2. Zabezpieczenie przed ryzykiem stopy procentowej za pomocą FRA

3.2.3. Podsumowanie cech FRA oraz korzyści dotyczące z obrotu tymi kontraktami

3.3. Operacje Financial Futures zabezpieczające ryzyko stopy procentowej

3.3.1. Cechy oraz regulacje dotyczące kontraktów futures

3.3.2. Cena kontraktu terminowego futures

3.3.3. Procentowe transakcje futures

3.3.4. Porównanie kontraktów FRA i futures

ROZDZIAŁ IV: SWAPY IRS W ZARZĄDZANIU RYZYKIEM STOPY PROCENTOWEJ BANKU

4.1 Regulacje dotyczące obrotu kontraktami swap i ich klasyfikacja

4.2. Sposoby kwotowa swapów procentowych

4.3 Swap IRS jako operacje zabezpieczające ryzyko stopy procentowej banku

4.3.1. Swap kuponowy

4.3.2. Swap bazowy

ZAKOŃCZENIE

BIBLIOGRAFIA

1. Książki i artykuły
2. Strony internetowe

SPIS TABEL

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