

Wstęp

1. Uwarunkowania zarządzania finansowego

1.1. Banki jako pośrednicy finansowi i ich otoczenie

1.2. Wybrane uwarunkowania zewnętrzne

1.2.1. Sieć bezpieczeństwa finansowego i regulacje

1.2.2. Nowe technologie i ich znaczenie

1.2.3. Relacje z klientami

1.3. Wybrane uwarunkowania wewnętrzne

1.3.1. Cele działalności bankowej

1.3.2. Struktura organizacyjna banków

1.3.3. Modele biznesowe banków i ich ewolucja

2. Sprawozdania finansowe banku

2.1. Ogólne zasady konstrukcji sprawozdań finansowych

2.2. Sprawozdania udostępniane szerokiej publiczności

2.2.1. Sprawozdanie z sytuacji finansowej

2.2.2. Rachunek zysków i strat

2.2.3. Pozostałe sprawozdania finansowe

2.3. Sprawozdania zarządcze

2.4. Raporty finansowe a cyfryzacja

3. Ocena efektywności

3.1. Zakres oceny efektywności

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. Zarządzanie efektywnością

4. Ocena ryzyka

4.1. Podstawowe definicje i klasyfikacja

4.2. Ramy regulacyjne

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. Zarządzanie ryzykiem

5. Kapitały i zintegrowane zarządzanie finansami banku

5.1. Kapitały własne banku

5.2. Kapitał regulacyjny

5.3. Kapitał ekonomiczny

5.4. Alokacja kapitału

5.5. Zarządzanie kapitałem

5.6. Zintegrowane zarządzanie efektywnością i ryzykiem

Podsumowanie

Bibliografia