

Spis treści

Wstęp.....	9
Rozdział 1. Ryzyko operacyjne. Podstawowe pojęcia.....	13
Pojęcie ryzyka w finansach. Podstawowe rodzaje ryzyka	13
Rozwój koncepcji zarządzania ryzykiem	18
Definiowanie ryzyka operacyjnego	23
Analiza katastrofalnych strat spowodowanych zdarzeniami operacyjnymi	37
Stan zarządzania ryzykiem operacyjnym w instytucjach finansowych	50
Rozdział 2. Środowisko regulacyjne jako główny stymulator wdrożenia zarządzania ryzykiem operacyjnym.....	55
Adekwatność kapitałowa banków jako punkt odniesienia dla podmiotów sektora finansowego	57
Ryzyko operacyjne w nowej umowie kapitałowej i dyrektywach europejskich.....	61
Wdrożenie regulacji nowej umowy kapitałowej	71
Krytyka zapisów nowej umowy kapitałowej.....	91
Geneza dokumentów bazylejskich w zakresie ryzyka operacyjnego i harmonogram wdrożenia nowej umowy kapitałowej	96
Rozdział 3. Metodologie zarządzania ryzykiem operacyjnym w instytucjach finansowych	99
Koncepcja zarządzania ryzykiem operacyjnym	100
Analiza zaawansowanych metod pomiaru ryzyka operacyjnego	144
Metody zabezpieczania się przed ryzykiem operacyjnym.....	158

Rozdział 4. Propozycja systemu zarządzania ryzykiem operacyjnym dla instytucji finansowej średniej wielkości.....	164
Zarys koncepcji systemu zarządzania ryzykiem operacyjnym	165
System zarządzania ryzykiem operacyjnym	169
Wnioski	199
Zakończenie	201
Załączniki	205
1. Bazylejska kategoryzacja rodzajów ryzyka operacyjnego	207
2. Macierz linii biznesowych i rodzajów ryzyka operacyjnego.....	210
3. Drzewo decyzyjne dla pola „klasyfikacja zdarzenia” w raporcie o stratach operacyjnych	211
4. Drzewo decyzyjne dla pola „bazylejski rodzaj ryzyka (poziom I)” w raporcie o stratach operacyjnych.....	212
5. Kategoryzacje efektów strat operacyjnych – definicje i przykłady.....	214
6. Studium przypadku – wykorzystanie systemu zarządzania ryzykiem do identyfikacji, pomiaru i monitorowania ryzyka operacyjnego	216
7. Modelowanie rozkładu dotkliwości strat operacyjnych metodą wartości ekstremalnych	237
Bibliografia	245
Indeks	251