Dr Wincenty Kulpa prof. PRz

Zestaw zagadnień problemowych Ćwiczenia 6

1. Ryzyko kraju w działalności bankowej

2. Agencje ratingowe w świecie ocena wiarygodności ekonomicznej Polski w skali tych agencji

3. Istota ryzyka stopy procentowej

4. Na czym polega zagrożenie ryzkiem stopy procentowej dla banku

5. Metody oceny ryzyka stopy procentowej

6. W jakim celu bada się elastyczność stopy procentowej

7. Zarządzanie ryzykiem stopy procentowej - przykład z wybranego banku

8. Pojęcie ryzyka walutowego, rodzaje kursów walutowych

9. Sposoby mierzenia ryzyka walutowego

10. Zarządzanie ryzykiem walutowym – przykład z wybranego banku

11. Podstawowe rodzaje transakcji walutowych

12. Istota ryzyka operacyjnego

13. Metody oceny ryzyka operacyjnego

13a. Zarządzanie ryzykiem operacyjnym – przykład z wybranego banku

14. Przykład fraudu bankowego wykonanego przez Nicka Leeson’a - proszę wykorzystać źródła zewnętrzne

15. Przykład fraudu bankowego wykonanego przez Jerome Kerviel’a - proszę wykorzystać źródła zewnętrzne

16. Oszustwa bankowe jako element ryzyka operacyjnego

17. Podstawowe formy i przypadki cyberprzestępczości w banku

18. Do czego służą modele VaR

19. Charakterystyka ryzyka systemowego

20. Istota ryzyka rynkowego

21. Na czym polega zasada „To big to fail” w świecie rynków finansowych

22. Zabezpieczenie przed ryzykiem walutowym poprzez transakcje outright - przykład z wybranego banku

23. Podstawowe metody liczenia VaR – przykład z wybranego banku

24. Backtesting, strestesting, metoda scenariuszy w badaniu wiarygodności modelu zarządzania ryzkiem - przykład z wybranego banku.