

SPIS TREŚCI

Rozdział 1

Zarządzanie ryzykiem kredytowym – teoria i praktyka

1.1. Wstęp	7
1.2. Pieniądz i bankowość – rys historyczny	8
1.3. Otoczenie prawne i regulacyjne sektora bankowego	9
1.4. Struktura bilansu banku, charakterystyka segmentów rynku w kontekście oceny ryzyka kredytowego	18

Rozdział 2

Model podejmowania decyzji kredytowych

2.1. Wstęp	27
2.2. Model decyzyjny przy podejmowaniu decyzji kredytowej	28
2.3. Ocena firmy w kontekście podejmowania decyzji kredytowej	31
2.4. Ocena struktury transakcji kredytowej	99
2.5. Przykłady	154

Rozdział 3

Coaching w biznesie – praktyczne wykorzystanie coachingu w wybranych obszarach funkcjonowania oddziału banku detalicznego

3.1. Wstęp	167
3.2. System motywacyjny dla doradców	172
3.3. Badanie jakości rozmów handlowych doradców z klientami banku	174
3.4. Skuteczne zapraszanie klientów do oddziału przez telefon	176
3.5. Oceny roczne pracowników	180
3.6. Zarządzanie zmianą na przykładzie fuzji banków	182
3.7. Rekrutacja pracowników	185
3.8. Projekt końcowy	186

Rozdział 4

Zarządzanie ryzykiem w przedsiębiorstwie niefinansowym

4.1. Istota ryzyka	189
4.2. Rodzaje ryzyka	190
4.3. Etapy zarządzania ryzykiem	194
4.4. Wybrane miary ryzyka	197

Spis treści

Rozdział 5

Wartość pieniądza w czasie

5.1. Wstęp	205
5.2. Wartość pieniądza w czasie a inflacja	205
5.3. Kapitalizacja a dyskonto	206
5.4. Efektywna a nominalna stopa procentowa	207
5.5. Podstawowe modele wartości pieniądza w czasie	208

Rozdział 6

Funkcje, struktura i instrumenty rynku kapitałowego

6.1. Funkcje rynku kapitałowego	221
6.2. Struktura rynku kapitałowego	222
6.3. Instrumenty rynku kapitałowego	224

Rozdział 7

Obligacje i ich rola w ograniczaniu ryzyka

7.1. Obligacje – podstawowe informacje	227
7.2. Wycena obligacji	229
7.3. Ryzyko związane z inwestowaniem w obligację. Immunizacja obligacji	231
7.4. Wypukłość obligacji	237

Rozdział 8

Analiza akcji

8.1. Wstęp	243
8.2. Analiza techniczna	243
8.3. Analiza fundamentalna	247

Rozdział 9

Teoria portfela papierów wartościowych

9.1. Analiza ryzyka i stopy zwrotu z akcji spółek	257
9.2. Klasyczna metoda H. Markowitza optymalizacji portfela papierów wartościowych	260
9.3. Klasyczna metoda W. Sharpe'a optymalizacji portfela papierów wartościowych ..	262
9.4. Fundamentalny portfel papierów wartościowych – oparty na taksonomicznej mierze atrakcyjności inwestycyjnej (TMAI)	265

Rozdział 10

Instrumenty pochodne w zarządzaniu ryzykiem

10.1. Instrumenty pochodne – wprowadzenie	273
10.2. Wykorzystanie kontraktów terminowych do zabezpieczenia kursu walutowego .	274
10.3. Zabezpieczenia na rynku kapitałowym z wykorzystaniem opcji	276
10.4. Wykorzystanie instrumentów pochodnych do sterowania ryzykiem cen akcji	283
10.5. Wykorzystanie instrumentów pochodnych do sterowania ryzykiem stopy procentowej	286

Spis treści

Rozdział 11

Koszt kapitału i dźwignia finansowa w przedsiębiorstwie

11.1. Koszt kapitału przedsiębiorstwa	295
11.2. Dźwignia finansowa	303

Rozdział 12

Ocena opłacalności inwestycji rzeczowych

12.1. Wstęp	309
12.2. Szacowanie przepływów na potrzeby oceny efektywności inwestycji	310
12.3. Podstawowe mierniki szacowania opłacalności inwestycji	310
12.4. Ryzyko w ocenie opłacalności inwestycji	315

Rozdział 13

Opcje rzeczowe (rzeczywiste, realne)

13.1. Ograniczenia metod wyceny opartych na oczekiwanych przepływach pieniężnych	321
13.2. Ogólna charakterystyka opcyjnego podejścia do oceny efektywności inwestycji .	325
13.3. Podstawy wyceny opcji rzeczywistych	331
13.4. Przykład wyceny opcji rzeczywistych	334
Wykaz wybranych skrótów	347