

ЗМІСТ

ПЕРЕДМОВА	5
Розділ 1. ЕКОНОМІЧНА ПРИРОДА, КЛАСИФІКАЦІЯ ТА ФАКТОРИ РИЗИКІВ БАНКУ	8
1.1. Сутність та властивості ризиків банку.....	9
1.2. Методичні підходи до класифікації ризиків банку та їх характеристика.....	18
1.3. Систематизація факторів ризиків банку.....	26
1.4. Матриця ризиків банку.....	31
Контрольні запитання.....	41
Тестові завдання для самоконтролю.....	41
Вправи для самостійної роботи.....	44
Розділ 2. СИСТЕМА ТА ПРОЦЕС УПРАВЛІННЯ РИЗИКАМИ БАНКУ	52
2.1. Сутність, еволюція розвитку ризикології та ризик-менеджменту в банку.....	53
2.2. Зміст, мета, завдання, функції та принципи інтегрованої системи управління ризиками банку.....	72
2.3. Етапи управління ризиками в банку.....	86
2.4. Стратегія та методи управління ризиками в банку.....	92
Контрольні запитання.....	110
Тестові завдання для самоконтролю.....	111
Вправи для самостійної роботи.....	114
Розділ 3. СТАНДАРТИ РИЗИК-МЕНЕДЖМЕНТУ ТА РЕГУЛЮВАННЯ РИЗИКІВ НАГЛЯДОВИМИ ОРГАНАМИ	121
3.1. Міжнародні стандарти ризик-менеджменту.....	122
3.2. Рекомендації Базельського комітету щодо управління ризиками.....	143
3.3. Регулювання ризиків Національним банком України.....	162
Контрольні запитання.....	180
Тестові завдання для самоконтролю.....	181
Вправи для самостійної роботи.....	183
Розділ 4. ІНСТРУМЕНТАРІЙ ОЦІНКИ РИЗИКІВ	185
4.1. Визначення загальної величини ризику банку з урахуванням узгодження інтересів зацікавлених сторін.....	186
4.2. Сучасні підходи до виміру ризиків банку.....	192
4.3. Особливості застосування VaR-методології до оцінки ризиків банку.....	220
4.4. Агрегація індивідуальних оцінок ризику банку та визначення ефекту диверсифікації.....	228
4.5. Стрес-тестування банківських ризиків.....	241
Контрольні запитання.....	253
Тестові завдання для самоконтролю.....	255
Вправи для самостійної роботи.....	264
Розділ 5. ОРГАНІЗАЦІЙНЕ ЗАБЕЗПЕЧЕННЯ УПРАВЛІННЯ РИЗИКАМИ БАНКУ	267
5.1. Учасники процесу управління ризиками банку та їх функції.....	268
5.2. Профільні комітети банку.....	278
5.3. Моделі побудови служби ризик-менеджменту банку.....	295
Контрольні запитання.....	305
Тестові завдання для самоконтролю.....	306
Вправи для самостійної роботи.....	310
Розділ 6. МЕТОДИЧНЕ ТА ІНФОРМАЦІЙНЕ ЗАБЕЗПЕЧЕННЯ РИЗИК-МЕНЕДЖМЕНТУ БАНКУ	315

6.1. Методичне забезпечення управління ризиками банку	316
6.2. Вимоги до інформаційного забезпечення ризик-менеджменту	327
6.3. Фінансова звітність з ризик-менеджменту банку	335
6.4. Статистична звітність з ризик-менеджменту банку.....	345
Контрольні запитання.....	360
Тестові завдання для самоконтролю	361
Вправи для самостійної роботи	364
Розділ 7. ОСОБЛИВОСТІ УПРАВЛІННЯ ОКРЕМИМИ ВИДАМИ РИЗИКІВ.....	368
7.1. Стратегічний, репутаційний та інші нефінансові ризики банку	369
7.2. Операційно-технологічний ризик банку	390
7.3. Ризик ліквідності банку	405
7.4. Кредитний ризик банку	438
7.5. Відсотковий ризик банку	480
Контрольні запитання.....	509
Тестові завдання для самоконтролю	511
Вправи для самостійної роботи	520
Список рекомендованих джерел.....	528
Додатки	551