

Астрелина В.В, Бондарчук П.К., Шальнов П.С.

Управление ликвидностью в российском коммерческом банке : учебное пособие / В.В. Астрелина, П.К. Бондарчук, П.С. Шальнов. - М. : ИД «ФОРУМ» : ИНФРА-М, 2016. - 176 с.: ил. - (Высшее образование).

Оглавление

Введение	3
Глава 1. ТЕОРЕТИЧЕСКИЕ ПОДХОДЫ И НОРМАТИВНЫЕ ТРЕБОВАНИЯ К ПРОЦЕССУ УПРАВЛЕНИЯ ЛИКВИДНОСТЬЮ В КОММЕРЧЕСКОМ БАНКЕ.	5
1.1. Исторические теории оценки и управления ликвидностью. Методы запаса и потока	6
1.2. Требования Базельского комитета и Банка России	24
1.3. Организация управления ликвидностью и контроль в коммерческом банке.	42
1.4. Факторы, влияющие на управление ликвидностью	47
1.5. Методы управления ликвидностью	51
1.6. Организация и контроль за управлением ликвидностью	55
1.7. Механизм управления ликвидностью и соответствующая ИТ-инфраструктура банка	63
1.8. Оценка ликвидности банка международными рейтинговыми агентствами	67
Глава 2. АНАЛИЗ И ПРОГНОЗИРОВАНИЕ СОСТОЯНИЯ ЛИКВИДНОСТИ В КОММЕРЧЕСКОМ БАНКЕ.	79
2.1. Риски ликвидности банка. Анализ и интерпретация результатов	79
2.2. Динамическое моделирование и управление ликвидностью	91
2.3. Сценарное моделирование	

Глава 3. УПРАВЛЕНИЕ ЛИКВИДНОСТЬЮ БАНКА. ИНСТРУМЕНТЫ, СПЕЦИФИКА УПРАВЛЕНИЯ ЛИКВИДНОСТЬЮ В КРИЗИСНЫХ СИТУАЦИЯХ	104
3.1. Механизм управления ликвидностью банка. Управленческая отчетность	104
3.2. Инструменты управления ликвидностью и их воздействие на экономику банка	112
3.3. Управление ликвидностью в кризисных ситуациях.	128
3.4. Оценка потребности в ликвидных средствах на примере российского банка	134
Рекомендуемая литература	143
Приложение 1. Организация управления ликвидностью (схема)	145
Приложение 2. Данные для case-study.	146
Приложение 3. Анализ состояния ликвидности в банке.	151
Приложение 4. Пример проведения стресс-тестирования баланса банка	154
Приложение 5. Пример проведения анализа ликвидности банка на основе формы 125.	156
Приложение 6. Оценка ликвидности банка ведущим рейтинговым агентством. _____	162
Приложение 7. Система оценки финансовой устойчивости CAMELS.	171