

Literatura uzupełniająca do 1 stopnia certyfikacji SZR WIB

Lp	Kategoria	Autor	Tytuł	Wydawca	Rok wydania
1		A A.A Groppelli, E. Nikbakht	Wstęp do finansów	WIG PRESS	1999
2		B J.C. Francis	Inwestycje. Analiza i zarządzanie	WIG PRESS	2000
3		A E.F Brigham, L.C Gapenski	Zarządzanie finansami, tomy 1-2	Polskie Wydawnictwo Ekonomiczne	2000
4		B H.B Mayo	Wstęp do inwestowania	LIBER	1997
5		C J. Bessis	Risk Management in Banking	WILEY	1998
6		D Z. Marciniak	Zarządzanie wartością i ryzykiem	SGH	2001
7		D J. Hull	Kontrakty terminowe i opcje. Wprowadzenie	WIG PRESS	1997 i późniejsze
8		D J. Hull	Options, Futures & Other Derivatives	Prentice Hall	wiele wydań
9		C H. Riehl	Zarządzanie ryzykiem	WIB	2001
10		C R. Kendall	Zarządzanie ryzykiem dla menedżerów	LIBER	2000
11		C C.Matten	Zarządzanie kapitałem bankowym	Dom Wydawniczy ABC	2000
12		D A. McDougall	Swapy	Dom Wydawniczy ABC	2001
13		C D. Bennett	Ryzyko walutowe	Dom Wydawniczy ABC	2000
14		D F. Taylor	Rynki i opcje walutowe	Dom Wydawniczy ABC	2000
15		D A. Kasapi	Kredytowe instrumenty pochodne	Dom Wydawniczy ABC	2002
16		D P. Wilmott	P.Wilmott Introduces Quantitative Finance	WILEY	wiele wydań
18		C P. Matkowski	Zarządzanie ryzykiem operacyjnym	Oficina Wydawnicza Wolters Kluwer	2006
19		C Carol Alexander	Operational Risk - Regulation, Analysis and Mar	FT Prentice Hall	2003

Komentarze

* Podane zostały tłumaczenia na j. polski, jeśli istnieją. Wciąż są one tańsze od oryginalnych wydań.

* Objasnienia kodów kategorii

A - Teoria finansów

B - Teoria inwestowania

C - Zarządzanie ryzykiem w instytucji finansowej

D - Instrumenty pochodne

* Sugestia - z każdej kategorii powinno się wybrać wiodącą, najpełniejszą pozycję oraz dwie dopełniające oraz trzymać się ich do końca stud

Uwagi

Wstęp do finansów oraz elementarz instrumentów pochodnych

Solidny wykład CAPM, APT, zarys teorii użyteczności, dywersyfikacja portfela, wstęp do podstawowych instrumentów pochodnych

Teoria finansów, zarządzanie strukturą kapitałową, wycena inwestycji, wstęp do zarządzania ryzykiem

Przegląd teorii inwestowania, ciekawe, ale raczej nie wyczerpujące

Są dwa wydania, pierwsze z 1998 jest mniejsze i wystarczające na 1 stopień certyfikacji, drugie z 2002 znacznie większe i ambitniejsze

Przegląd modeli z teorii inwestowania i zarządzania ryzykiem

Konieczność dla każdego początkującego w instrumentach pochodnych

Im młodsze wydanie tym lepsze. Rozwija poprzednią pozycję tego autora. Konieczność dla wszystkich, którzy zawodowo stykają się z instrumentami pochodnymi.

Bardzo dobre, praktyczne wprowadzenie do zarządzania ryzykiem bankowym

Pozwala zapoznać się z organizacją procesu zarządzania ryzykiem

Jedna z pierwszych pozycji o kapitale ekonomicznym

O swapach, głównie procentowych przystępnie

Przegląd metod i idei z zakresu zarządzania ryzykiem walutowym

O opcjach bardzo przystępnie i wstępnie

O pochodnych kredytowych przystępnie i wstępnie

Dobry wstęp do modelowania instrumentów pochodnych

Dobre kompendium podstawowej wiedzy z zakresu ryzyka operacyjnego.

Dobry zakres materiały rozszerzający podstawową wiedzę z zakresu ryzyka operacyjnego, głównie o metody zaawansowane. Napisane w przystępny sposób.

dium