

<<运作风险>>

图书基本信息

<<运作风险>>

内容概要

对于企业来说, 风险日益增加并且不可避免。

如何处理日益增加的风险对于金融机构和整个经济体系来说, 变得非常必要。

“越来越快的技术进步和金融创新带来了新的、非常复杂的风险元素。

” ——威廉·麦克多诺(William McDnough), 国际清算银行行长, 2000 年9月20日 “风险的重新划分诱发了更多的不动产投资, 因而造成了更高的生活标准。

” ——艾伦·格林斯潘, 美国联邦储备委员会主席, 1999年10月14日 “运作风险是这样一个主题... 大多数银行现在都把它们看得同信用风险和市场风险一样重要。

在未来的几年内, 银行将耗费更多的资源并对其给予更多的关注。

” ——蒂姆·斯维尼(Tim Sweeney), 英国银行家协会会长, 1998年 《运作风险: 度量与建模》提出了一种新的增加企业价值的方法, 那就是提供一种方法来度量运作风险, 并促使企业更好地控制运作中收益的波动性和风险。

本书启发性地介绍了一种关注业务运作的新方法及其理论基础, 以确保文中的方法论可以被广泛应用并且保持长期稳定。

<<运作风险>>

作者简介

杰克·L·金博士是英国热那亚有限公司的常务董事，该公司主要业务为风险咨询及相关软件开发。

他给企业带来了约30年的风险技术及其应用方面的经验。

从1998年8月至2000年11月，金博士担任Operational Risk for Algorithmics股份有限公司的董事。加入该公司之前，金博

<<运作风险>>

书籍目录

第一部分 运作风险概述 第1章 运作风险简介 1.1 引言 1.2 运作风险实例：汽车旅行 1.3 运作风险定义
1.4 运作风险的处理 1.5 运作风险度量和建模 1.6 下一步是什么 1.7 全书概要 1.8 参考文献 第2章 历史上的
损失 2.1 引言 2.2 损失分类 2.3 重大的损失 2.4 运作风险管理失败的例子 2.5 其他损失案例 2.6 小结
2.7 参考文献 第3章 管制 3.1 引言 3.2 背景 3.3 银行监管 3.4 公司治理 3.5 小结 3.6 参考文献 第二部分 运
作风险度量 第4章 运作风险的度量框架 4.1 引言 4.2 框架判据 4.3 现有框架方法 4.4 框架假设 4.5 框架
定义 4.6 运作风险度量框架 4.7 运作风险度量 4.8 Delta-EVTTM如何支持运作风险管理 4.9 框架执行步
骤 4.10 小结 4.11 参考文献 第三部分 运作风险建模 第四部分 数学基础

<<运作风险>>

版权说明

本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问:<http://www.tushu007.com>