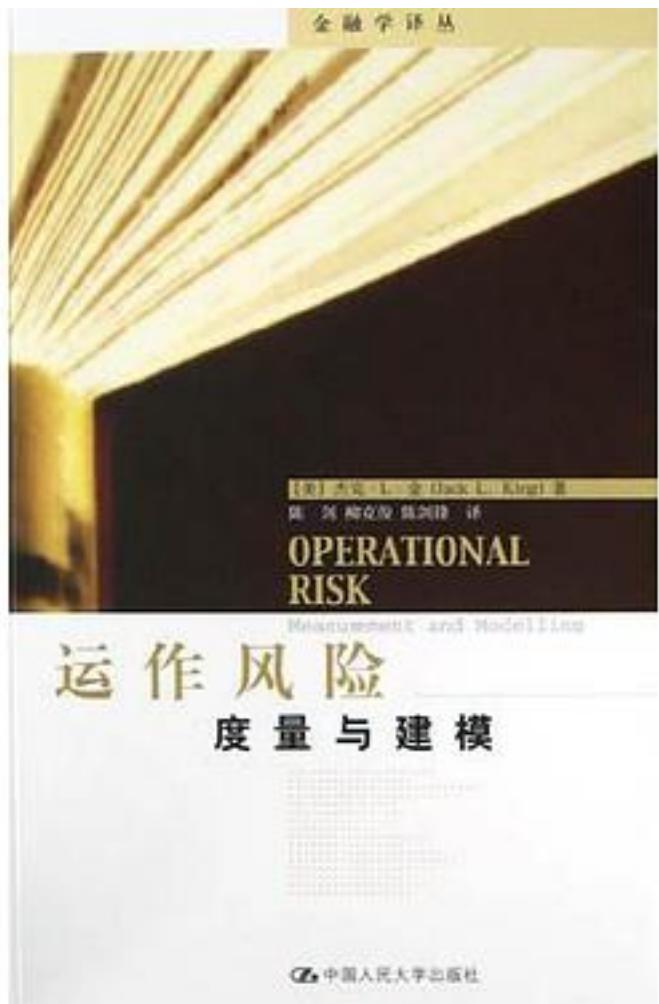


# 运作风险



[运作风险 下载链接1](#)

著者:杰克·L·金

出版者:中国人民大学出版社

出版时间:2005-2-1

装帧:平装(无盘)

isbn:9787300037394

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 McDonough)，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。

作者介绍：

目录: 第一部分 运作风险概述

第1章 运作风险简介

第2章 历史上的损失

第3章 管制

第二部分 运作风险度量

第4章 运作风险的度量框架

第5章 Delta方法

第6章 EVT方法

第三部分 运作风险建模

.....

第四部分 数学基础

.....

第五部分 附录

.....

· · · · · (收起)

[运作风险 下载链接1](#)

标签

风险

# 全面风险管理

## 评论

[运作风险 下载链接1](#)

## 书评

[运作风险 下载链接1](#)