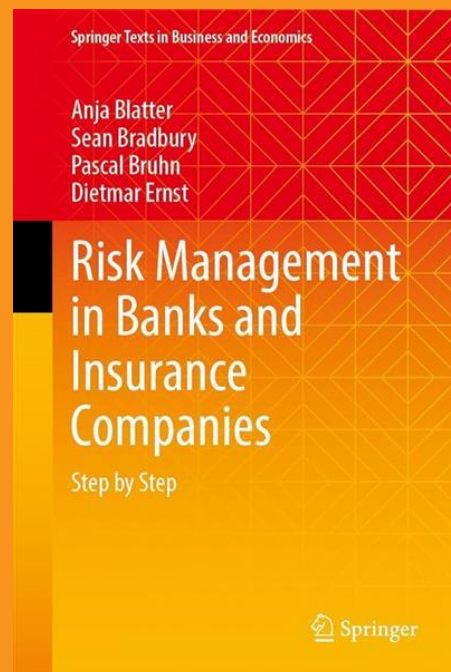


کتاب حاضر نشان می‌دهد که چگونه مدیریت ریسک نوین در بانک‌ها و شرکت‌های بیمه می‌تواند با استفاده از نرم‌افزارهای اکسل و متلب مدل‌سازی شود. خوانندگان کتاب، به روشی گام به گام، نظام‌مند و ساختار یافته با تمامی مهارت‌ها و دانش لازم آشنا می‌شوند. برای مطالعه کتاب، به جز دانش اکسل هیچ نوع دانش پیش‌نیاز دیگری لازم نیست.

این کتاب درسی به پنج بخش تقسیم می‌شود. در بخش اول خوانندگان اصول اولیه تحلیل و مدل‌سازی ریسک‌های بازار را می‌آموزند. در مرحله بعد نگارندگان مدل‌سازی ریسک‌های اعتباری را معرفی و شرح می‌دهند و ریسک‌های عملیاتی از طریق تنظیم توزیع زیان بر اساس تخمین کارشناسان متخصص، عددی‌سازی می‌شود. علاوه بر این اقدامات مربوط به هر کدام از این ریسک‌ها مورد بررسی قرار می‌گیرند. به منظور محاسبه هر اقدام مربوط به ریسک‌های کل پرتفو و با هدف تعیین سرمایه ریسک، روش تجمیع بررسی می‌شود. مفاهیم عمومی گوناگونی درباره این مسئله وجود دارد که با جزئیات در بخش آخر کتاب، مورد کاوش قرار می‌گیرند.

مخاطبین هدف، دانشجویان مدیریت کسب و کار با تمرکز بر خدمات مالی هستند. نگارندگان کتاب، آنجا بتینا بلاتر استاد روش‌های عددی در مالی، شان برادبری استاد روش‌های تجربی، پاسکال برون استاد کارشناسی ارشد مالی بین‌المللی و دایتمار ارنست استاد تمام مالی بین‌المللی در دانشگاه نورتینگن گایسلینگن آلمان هستند. این کتاب در ۲۲۹ صفحه به رشته تحریر در آمده است.



نویسندگان:

Anja Blatter
Sean Bradbury
Pascal Bruhn
Dietmar Ernst

ناشر:

Springer

سال نشر:

۲۰۲۴

شابک:

۹۷۸۳۰۳۱۴۲۸۳۵۷