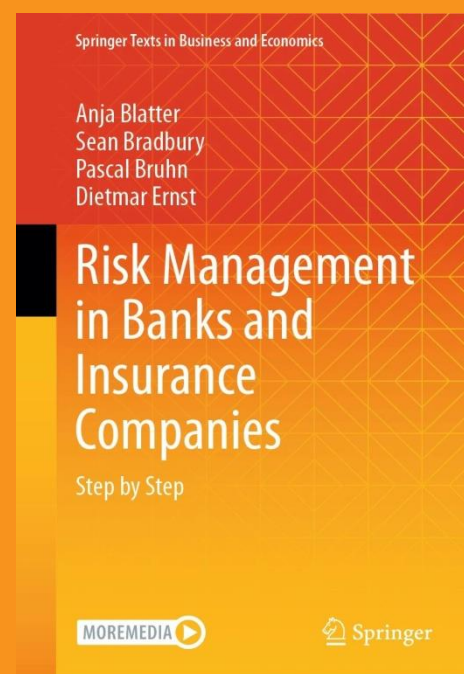


این کتاب نشان می‌دهد که چگونه می‌توان مدیریت ریسک نوین در بانک‌ها و شرکت‌های بیمه را در قالب‌های اکسل و متلب مدل‌سازی نمود. در این کتاب تمامی دانش‌های مورد نیاز خوانندگان جهت فهم مطالب بصورت نظام‌مند و ساختار یافته فراهم آمده است. جهت مطالعه کتاب، به جز دانش مقدماتی اکسل به هیچ نوع پیش‌زمینه علمی دیگری نیاز نیست.

در این کتاب مقدمات تحلیل و مدل‌سازی ریسک‌های بازار آموزش داده شده و مدل‌سازی ریسک‌های اعتباری توضیح داده می‌شود. در این کتاب ریسک‌های عملیاتی از طریق تنظیم توزیع‌های زیان و بر اساس برآوردهای کارشناسان کمی‌سازی می‌شود. علاوه بر این اجزای هر یک از سنجه‌های ریسک در این کتاب مورد بررسی قرار می‌گیرد.

این کتاب به منظور اندازه‌گیری سنجه ریسک برای یک سبد کلی و با هدف تعیین سرمایه ریسک به مبحث روش تجمیع می‌پردازد. آموزش اکسل و متلب برای ارزیابی ریسک‌های بانک‌ها و شرکت‌های بیمه و آموزش گام به گام و ساختار یافته از ویژگی‌های کلیدی این کتاب هستند. این کتاب برای دانشجویان رشته مدیریت کسب و کار با تمرکز بر خدمات مالی نگارش و طراحی شده است.

آنیا بلاتر استاد روش‌های کمی در امور مالی، پاسکال بران مدرس برنامه کارشناسی ارشد مالی بین‌الملل، شان برادبری مدرس روش‌های تجربی و پروفسور دیتمار ارنست استاد مالی بین‌الملل در دانشگاه نورتینگن-گایزلینگن هستند. این کتاب در ۲۱۵ صفحه به رشته تحریر در آمده است.



مؤلفان:

Anja Blatter
Sean Bradbury
Pascal Bruhn
Dietmar Ernst

ناشر:

Springer

سال نشر:

۲۰۲۵

شابک:

۹۷۸۳۰۳۱۴۲۸۳۶۴