

《风险管理关注点的方法与技巧》大纲

第一部分 风险来源与管理框架

■ 第一节 风险管理的概述

一、操作风险的起源

(一) 商业银行操作风险提出的背景和原因

(二) 操作风险的相关案例

1. 巴林银行倒闭事件
2. 日本大和银行事件
3. 中国银行开平之劫
4. 邯郸农行金库盗窃案

(三) 国内外专家的观点和认识

二、操作风险的分类

(一) 操作风险的定义

(二) 操作风险的分类

三、操作风险的性质

四、操作风险的传统特点

五、现代操作风险管理的新趋

■ 第二节 风险管理的基本框架

一、操作风险管理的演变

(一) 传统基础阶段

(二) 专门管理阶段

(三) 定性管理阶段

(四) 定量管理阶段

(五) 整体管理阶段

2. 风险评估与计量

3. 风险控制与缓释

4. 风险监测

5. 风险报告

二、操作风险管理框架的基本构成要素

三、操作风险管理的环境和文化

(一) 文化管理类要素

1. 公司治理

2. 内部控制

3. 操作风险组织体系

(二) 操作风险管理战略和政策

1. 操作风险管理战略

2. 操作风险管理政策

(三) 管理流程和技术方法类要素

1. 风险识别

四、操作风险管理框架的评价与发展

(一) 操作风险管理框架的挑战

(二) 操作风险管理框架的有效性评价

1. 对操作风险的定义

2. 平衡的方法

3. 操作风险管理文化

4. 整个机构范围内的一致性

5. 审计

6. 风险检查委员会

7. 损失数据库

8. 指标

(三) 操作风险管理的发展