

Бартом, Томас, Шенкир, Уильям, Уокер, Пол

Комплексный подход к риск-менеджменту: стоит ли этим заниматься. : Пер. с англ.— М.: Издательский дом "Вильямс", 2003.— 208с.

Авторы книги детально рассматривают новую, комплексную, модель риск-менеджмента на предприятии. Она характеризуется тем, что управление рисками перестает быть заботой отдельных специалистов (производственников, финансистов, марке-тигго и т.д.), а выходит на новый, стратегический уровень. В основе книги лежит практика риск-менеджмента пяти ведущих американских компаний (United Grain Growers (сельское хозяйство). DuPont (химическая промышленность). Проанализировать процесс риск-менеджмента, рассмотреть новые факторы риска и практические инструменты риск-менеджмента (сценарный анализ; подход EAR; кривая прибыли/убытки и др), показать место и функции финансового руководителя в процессе риск-менеджмента. Книга будет полезна специалистам по риск-менеджменту, руководителям компаний.

Содержание

Предисловие к русскому изданию.....	10
1. Риск-менеджмент: первое знакомство.....	11
Господство неопределенности.....	12
Новая парадигма риск-менеджмента.....	14
Исследования вопросов риск-менеджмента.....	15
Цели и методы исследования.....	16
Структура книги.....	16
Комментарии.....	17
2. Риск-менеджмент: уроки лидеров.....	19
Выявление рисков.....	20
Измерение рисков	21
VAR и стресс-тестинг.....	22
Прибыль с учетом риска: EAR	
Стратегии реагирования на риск.....	26
Риски: интегрировать и учитывать все	27
Привлечение консультантов	28
Стимулирование осведомленности сотрудников организации о ее рисках	29
Инфраструктура риска	32
Сторонники риск-менеджмента в рамках всего предприятия	34
Резюме	35
Комментарии	35
3. Chase Manhattan Corporation	37
История компании	37
Chase Manhattan сегодня	42
Риск в Chase Manhattan	47
Акционерная добавленная стоимость: SVA	51
Рыночный риск	53
Инвестиции с учетом риска: VAR	54
Стресс-тестинг	55
Кредитный риск	56
Операционный риск	59
Самооценка операционного риска	62
Резюме	63
С кем мы беседовали	63
Дополнительная литература	64
Комментарии	64
Приложение 3.1. Chase: Описание и измерение рыночного риска ...	66
Приложение 3.2. Руководство по операционному риску	70
Приложение 3.3. Пример программы самооценки риска на основе доклада COSO (выдержки).....	72
4. E.I. Du Font de Nemours and Company	87

История компании	87
Текущий статус риск-менеджмента	90
Система риск-менеджмента	90
Корпоративная политика	91
Корпоративные директивы	92
Стратегии и процедуры для линейных менеджеров	93
Интеграция риска	94
Внимание на прибыль	96
Как достичь "мирового уровня" в управлении финансовым риском..	100
Резюме	104
С кем мы беседовали	106
Комментарии	106
5. <i>Microsoft Corporation</i>	107
История компании	107
Группа риск-менеджмента	111
Финансовый риск-менеджмент	113
Управление деловыми рисками	115
Выявление деловых рисков с помощью сценарного анализа	118
Измерение и ранжирование деловых рисков	120
Награды за риск-менеджмент	123
Резюме	123
С кем мы беседовали	123
Комментарии	124
6. <i>United Grain Growers Limited</i>	125
История компании	125
Новая экономическая обстановка	126
Становление риск-менеджмента в рамках всего предприятия	129
Проект "Стратегический риск-менеджмент"	131
Привлечение консультантов	132
Определение рисков	132
Количественный анализ рисков и проверка его обоснованности	133
Комплексное финансирование рисков	138
Инфраструктура риск-менеджмента	141
Резюме	141
С кем мы беседовали.....	142
Дополнительная литература	142
7. <i>Unocal Corporation</i>	143
История <i>Unocal</i>	143
Характер рисков <i>Unocal</i>	149
Замена "завода"	149
Инциденты	151
Хеджирование цен	151
Политические риски	152
Анализ чувствительности	152

Глубоководные операции	152
Истоки риск-менеджмента в рамках предприятия	155
Внутренний аудит	155
Профили риска	156
800 вопросов	161
Профиль риска <i>Spirit Energy 76</i>	164
<i>Unocal Geotkermal Indonesia</i>	165
Риск-менеджмент как изменение культуры компании	167
Резюме	170
С кем мы беседовали	170
Дополнительная литература	171
Комментарии	171
Приложение 7.1. Профиль риска <i>Spirit Energy 76</i> (выдержка)	173
Приложение 7.2. Планирование и оценка профиля рисков <i>Unocal Geothermal Indonesia</i> (выдержка)	179
Приложение 7.3. Оценка профиля рисков <i>Unocal Geothermal Indonesia</i> (выдержка)	182
8. Риск-менеджмент: развитие продолжается	185
Исследуемые компании	186
Элементы риск-менеджмента	186
Перспективы	187
Оцените свою организацию	187
Резюме	188
Комментарии	189
Приложение А. Вопросы интервью для анализа риск-менеджмента в рамках всего предприятия.....	191
Приложение В. Источники.....	195
Приложение С. Аннотированная библиография	197
Предметный указатель	206