

Содержание

Предисловие автора

Раздел 1 Введение: проблемы управления операционным риском .

1.1. Рекомендации международного Базельского комитета и система Базель

II

1.2. Требования ЦБР и связанные с ними новые концепции управления

1.2.1.Нормативная база

1.2.2.Новая концепция контроля

1.2.3.Общие элементы контроля как процесса управления

1.3.Методологические проблемы управления операционным риском

1.4.Ответы на вопросы

Раздел 2. Организационные основы управления операционным риском

2.1.Основные понятия и определения

2.2.Принципы управления операционным риском

2.2.1.Задачи создания среды управления

2.2.2.Задачи управления риском

2.3.Методы управления операционным риском

2.4.Организационно-функциональная структура управления операционным
риском

2.5.Система внутренней нормативной документации

2.6.Корпоративное управление и роль внутреннего аудита в управлении
рисками

2.7.Ответы на вопросы

2.8.Самоконтроль

Раздел 3 Управление операционным риском: процессный подход

3.1. Основные понятия и определения

3.2. Декомпозиция задачи управления операционным риском

3.3. Стратегия управления операционным риском

3.4. Анализ и оценка операционного риска

3.4.1. Идентификация рисков

3.4.2. Оценка рисков

3.4.3. Отчет о рисках

3.5. Принятие решения и разработка мер реагирования на риск

3.5.1. Принятие решения

3.5.2. Разработка мероприятий

3.6. Мониторинг и контроль операционного риска

3.7. Ответы на вопросы

3.8. Самоконтроль

Раздел 4. Методы оценки операционного риска

4.1. Методики измерения операционного риска

4.2. Базовый метод показателей

4.3. Стандартизованный метод

4.3.1. Стандартизованная методика TSA

4.3.2. Альтернативный стандартизованный метод

4.4. Усовершенствованные методы измерения

4.5. Внутренняя рейтинговая модель для измерения операционного риска

4.6. Моделирование потерь методом Монте-Карло

4.7. Мэппинг

4.8. Ответы на вопросы

4.9. Самоконтроль

Раздел 5. Процессно-ориентированная модель анализа операционного риска

5.1. Технологический процесс и операционный риск

5.1.1. Определения

5.1.2. Стандарт качества организации управления операционным риском

5.2. Модели бизнес-процессов на основе международных стандартов

ИСО/МЭК 15504 и IDEF0

- 5.2.1.Общая характеристика стандарта ИСО/МЭК 15504.
- 5.2.2.Общая характеристика семейства стандартов IDEF
- 5.3. Основные этапы построения бизнес-процессов
 - 5.3.1. Этап 1. Построение «эталонной» модели и модели «как есть»
 - 5.3.2. Этап 2. Реструктуризация бизнес-процессов
- 5.4. Аттестация бизнес-процессов на основе Международных стандартов внутреннего аудита
 - 5.4.1.Общие сведения
 - 5.4.2.Характеристики основных функций
- 5.5. Построение структурных моделей бизнес-процессов для анализа операционного риска
- 5.6.Дискуссия
- 5.7.Самоконтроль

Раздел 6. Экспертная оценка операционного риска с применением структурных и логических моделей

- 6.1. Общие положения и определения
 - 6.1.1.Понятия и определения Fuzzy Logic
 - 6.1.2.Двухгрупповая классификация операционного риска для проведения экспертных оценок
- 6.2.Модели и алгоритмы нечеткого вывода
- 6.3.Расчет ожидаемых потерь бизнес-процесса с применением ФСА
- 6.4. Результаты практического применения экспертного анализа операционного риска
 - 6.4.1.Схема алгоритма анализа бизнес-процессов
 - 6.4.2.Измерение «процесс»
 - 6.4.3.Измерение зрелости процесса
 - 6.4.4.Упрощенная модель оценки ПОР
 - 6.4.5.Результаты процесса аттестации бизнес-процессов
 - 6.4.6.Заключение по результатам аттестации

6.5. Самоконтроль

Раздел 7. Инструментальные средства анализа и управления операционным риском

7.1. Программные продукты операционного риск-менеджмента, присутствующие на российском рынке

7.1.1. Универсальные программные средства анализа бизнес-процессов и операционных рисков

7.1.2. Инструментальные средства анализа и управления рисками информационных систем

7.1.3. Специализированные системы управления операционным риском

7.2. Практика моделирования и анализа бизнес-процессов на основе BPwin

7.2.1. Основные приемы работы с пакетом BPwin

7.2.2. Порядок декомпозиции общей схемы функциональной модели

7.2.3. Стоимостной анализ и свойства, определяемые пользователем (UDP)

7.3. Практика построения экспертной процедуры оценки риска на основе Fuzzy Logic Toolbox

7.4. Система управления операционными рисками банка IIG ULTOR

7.4.1. Функциональные возможности модуля LDC

7.4.2. Функциональные возможности модуля QSA

7.4.3. Функциональные возможности модуля KRI

7.4.4. Функциональные возможности поддерживающих модулей

7.4.5. Нефункциональные особенности

7.5. Самоконтроль

Список литературы

Приложения

Приложение 1. Классификация ЦБР направлений деятельности кредитной организации

Приложение 2. Траектория развития банка

Приложение 3. Классификатор событий

Приложение 4. Алгоритм расчета валового дохода для определения величины регулятивного капитала на покрытие операционного риска в рамках Базового индикативного подхода

Приложение 5. Требования ИСО/МЭК 15504 к проведению аттестаций бизнес-процессов

Приложение 6. Примеры структурных моделей бизнес-процесса «Развитие информационных технологий банка»