

<<信用风险相依模型及其应用研究>>

图书基本信息

书名：<<信用风险相依模型及其应用研究>>

13位ISBN编号：9787802470163

10位ISBN编号：7802470161

出版时间：2008-2

出版时间：知识产权

作者：欧阳资生

页数：197

字数：140000

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问：<http://www.tushu007.com>

<<信用风险相依模型及其应用研究>>

内容概要

本书从信用风险度量研究领域存在的实际问题出发，进行了债券市场风险和信用风险度量的建模和实证研究，得出了一些有意义的结论，并提出了一些有针对性的政策建议。

<<信用风险相依模型及其应用研究>>

作者简介

欧阳资生，男，1967年8月生，湖南邵阳人，1997年毕业于浙江大学概率统计专业，获理学硕士学位，2004年毕业于中国人民大学统计学院统计学专业，获经济学博士学位。

同年进入湖南大学管理科学与工程博士后科研流动站从事科研工作。

现任湖南商学院副教授、信息系副主任。

主要研究领域涉及应用统计学、风险管理、保险精算学、计量经济学等方面。

先后在《统计研究》、《应用数学学报》、《数理统计与管理》、《应用概率统计》、《高校应用数学学报A, B》、《统计与决策》、《财政理论与实践》等学术期刊上公开发表论文二十多篇，主持完成湖南省自然科学基金、湖南省社会科学基金等六项课题。

书籍目录

第1章 绪论

- 1.1 本书研究的背景和意义
 - 1.1.1 本书研究的背景
 - 1.1.2 本书研究的意义
- 1.2 债券风险度量与管理研究的现状和文献综述
 - 1.2.1 国内外对债券的信用风险度量的研究
 - 1.2.2 国内外对债券市场风险度量的研究
- 1.3 本书研究的主要内容

第2章 信用风险度量与管理的理论和方法评判

- 2.1 信用风险因子与风险损失
 - 2.1.1 违约概率
 - 2.1.2 预期损失
 - 2.1.3 非预期损失
 - 2.1.4 经济资本
 - 2.1.5 损失分布
- 2.2 违约相依性
 - 2.2.1 产生相依性的原因
 - 2.2.2 相关性和其他相依性的度量方法
 - 2.2.3 违约相依性的一些经验结果
- 2.3 组合信用风险管理方法及其评判
 - 2.3.1 几种主要的信用风险组合模型
 - 2.3.2 五种信用组合风险管理模型对我国的启示
- 2.4 极值理论在信用资产组合管理中的应用
 - 2.4.1 极值理论的重要应用
 - 2.4.2 极值理论回顾
 - 2.4.3 极值理论在信用风险分析中的应用

第3章 信用等级转移方法比较研究

- 3.1 追踪信用等级转移的方法
- 3.2 评级的稳定性和周期性
- 3.3 信用转移研究结果的比较
- 3.4 与信用评级相关的问题
- 3.5 国外信用评级方法研究对我国的启示

第4章 国债收益率的广义Pareto分布拟合

- 4.1 极值理论在风险管理中的重要应用
- 4.2 统计建模
 - 4.2.1 极值理论基本模型回顾
 - 4.2.2 GPD模型的定义及其极限定理
 - 4.2.3 风险度量
 - 4.2.4 厚尾分布的诊断
 - 4.2.5 门限值的初步选取
 - 4.2.6 GPD模型的检验原理
- 4.3 国债收益率的极值测度研究
 - 4.3.1 国债收益率的基本统计描述
 - 4.3.2 国债收益率的极值分布
 - 4.3.3 国债收益率的极值VaR

<<信用风险相依模型及其应用研究>>

4.4 对用极值理论估计VaR的几点说明

第5章 股票、国债和企业债券的极值风险比较研究

5.1 问题的提出

5.2 统计建模

5.2.1 厚尾分布的定义

5.2.2 利用指数回归模型计算VaR的原理

5.2.3 利用指数回归模型计算VaR的算法

5.3 股票、国债和企业债券指数极值风险的测算与比较

5.3.1 股票、国债和企业债券指数的收益率的基本统计描述

5.3.2 股票、国债和企业债券指数的收益率的极值分布

5.3.3 基于指数回归模型的三种指数的收益率的VaR

5.4 结果比较和说明

第6章 基于copula方法的国债市场相依风险度量

6.1 问题的提出

6.2 copula与相依结构

6.2.1 copula的概念及其性质

6.2.2 几种常用的Copula函数

6.2.3 其他相依性度量方法与Copula的关系

6.2.4 利用copula计算累积联合概率——一个例子

6.3 国债组合风险度量的copula的选取

6.3.1 数据分析

6.3.2 copula参数估计的原理和方法

6.3.3 经验copula的计算和合适的copula的选取

6.4 两种国债的组合风险度量

第7章 完善我国债券信用风险监管体系的策略分析

7.1 我国运用信用风险度量与管理技术的重要条件已逐步完备

7.1.1 外部条件逐步具备

7.1.2 金融机构内部条件正逐步成熟

7.2 加强信用制度建设, 建立完善的信用体系

7.2.1 完善并健全相关法律法规, 为促进信用制度建设提供有力依据

7.2.2 加强金融机构在信用制度建设中的监督与服务功能

7.2.3 建立多层次的信用管理体系

7.3 构建我国企业债券信用风险的全程监控体系

7.3.1 前期的控制机制

7.3.2 中期的监控机制

7.3.3 后期的保障机制

总结与展望

参考文献

后记

<<信用风险相依模型及其应用研究>>

版权说明

本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问:<http://www.tushu007.com>