

《信用风险度量与管理》

图书基本信息

书名：《信用风险度量与管理》

13位ISBN编号：9787500583028

10位ISBN编号：7500583028

出版时间：2005-7

出版社：中国财经

作者：瑟维吉尼

页数：372

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介以及在线试读，请支持正版图书。

更多资源请访问：www.tushu111.com

《信用风险度量与管理》

内容概要

《信用风险:度量与管理》作者长期任职于全球最有影响力的风险管理公司之一标准普尔公司的风险管理公司定量分析和产品服务部，多年从事风险管理工作，积累了大量的数据和丰富的经验。作者从微观经济学、货币银行学、金融学和风险管理等多个角度分析了金融风险的产生，介绍了当前信用风险度量与管理的最前沿的理论和方法，对今后的研究热点和重点进行了展望。

《信用风险:度量与管理》将信用风险度量与管理的理论和方法完美地结合在一起，是信用风险管理研究人员必备的工具书，对从业人员和高等院校师生也有很高的参考价值。

《信用风险度量与管理》

作者简介

阿诺·德·瑟维吉尼（Arnaud de Servigny）标准普尔风险管理公司定量分析和产品服务部驻欧洲总裁，在欧洲各种会议和培训班中的发言广受欢迎，撰写和发表多本关于金融和信用风险方面的专著与论文。 奥利维尔·雷劳特（Olivier Renault）就职于标准普尔风险管理公司定量分析和产品服务部，擅长资产组合建模。在加盟标准普尔之前，奥利维尔博士是伦敦经济学院的金融讲师，主要讲授衍生品和风险管理方面的课程。

《信用风险度量与管理》

书籍目录

前言引言第一章 信用、金融市场和微观经济学1.1 厂商理论中债务的角色1.2 银行中介理论结论第二章 外部评级和内部评级2.1 评级和外部评级机构2.2 关于外部评级的评论和批评2.3 信用风险的内部评级或评分评级的方法结论第三章 违约风险：定量的计算方法3.1 通过结构模型评估违约风险3.2 信用评分结论第四章 违约损失率4.1 一些定义4.2 应该使用什么指标来度量回收率？4.3 回收率的历史和决定因素4.4 不可交易债务的回收率4.5 随机回收率的重要性4.6 回收率函数的拟合4.7 从证券价格中提取回收率结论第五章 违约相依性5.1 产生相依性的原因5.2 相关性和其他相依性的度量方法5.3 违约相依性——一些经验结果结论第六章 信用风险组合模型6.1 为什么需要信用风险组合模型？6.2 模型的分类6.3 对一些商业模型的回顾6.4 其他一些方法6.5 经风险调整后的绩效度量方法（PAPM）6.6 组合损失的压力测试结论第七章 信用风险管理和战略资本金配置7.1 评级机构了解战略资本金配置吗？7.2 银行资本金意味着什么？7.3 配置业务的权益资本金的各种静态方法7.4 绩效的度量、资本金成本和动态的股权资本金配置第八章 收益率差价8.1 公司差价结论第九章 结构化产品与信用衍生品9.1 信用衍生品9.2 抵押负债债务结论第十章 监管结束语

《信用风险度量与管理》

媒体关注与评论

· 违约风险的定量分析方法 · 损失分布的数据分析和建模 · 银行资本金配置和证券化的独特策略

“德·瑟维吉尼（de Servigny）和雷劳特（enault）为信用风险分析撰写了一本宝贵的参考书，整本书将数据和理论结合得天衣无缝，数学模型恰到好处。本书把经济学、定价、结构化和资本配置等方面艺术性地结合在一起。” ——杰米尔·巴兹（Jamil Baz），荷兰银行全球固定收益研究院院长

《信用风险度量与管理》

编辑推荐

《信用风险：度量与管理》是标准普尔公司信用风险度量与管理的权威著作。信用风险是最古老的金融风险之一，几乎每时每刻都会出现在整个社会活动中，每位市场经济的参与者都无法逃避信用风险。信用风险管理对保持商业银行乃至国家金融体系的稳定具有十分重要的作用。加入WTO后，我国银行业将面临巨大的冲击，信用风险管理将是其首当其冲的任务。引进国外先进的信用管理理论、方法与模型对我国开展信用风险的度量与管理是十分必要的。

《信用风险度量与管理》

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:www.tushu111.com