第一图书网, tushu007.com

<<信用风险的博弈分析与度量模型>>

图书基本信息

书名：<<信用风险的博弈分析与度量模型>>

13位ISBN编号：9787501783021

10位ISBN编号：7501783020

出版时间：2008-1

出版时间：中国经济出版社

作者：叶蜀君

页数：290

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

内容概要

信用风险的破坏性、联动性和不确定性给经济主体带来了严重的经济损失，导致各类企业出现流动性危机。
同时，信用风险也是导致区域性乃至全球性金融危机的根本原因之一。
因此，对信用风险进行有效地度量和控制，成为了各国学术界、金融机构、政府共同关注的焦点。
本书沿着“概念—机理—理论—模型—应用”的逻辑主线展开研究，从信息经济学角度，运用博弈论、纳什均衡、演进式博弈等分析问题的思想、方法分析了信用风险产生的微观机理，分析说明信用风险的客观存在不以人的意志为转移并充满不确定性。
在此基础上，本书还研究了信用风险的度量方法，包括传统的方法、新型的度量模型、度量模型的新发展，分析了各种方法与模型的局限性，总结了信用风险度量方法的演变过程。
此外，本书还以信用突发事件为切入点，研究了信用突发事件与信用风险变动的关系，构建了以突变理论为基础的信用风险度量的数理模型。

作者简介

叶蜀君，女，教授。
获清华大学技术经济专业硕士学位，北京交通大学管理科学与工程专业博士学位，现在北京交通大学经济管理学院工作。
主要研究领域为金融理论与政策、投资与融资、信用与信用风险管理。

曾获得清华大学“光华奖”、铁道部“精品课”三等奖、北京交通大学优秀教师、北京交通大学“国际金融”优秀主讲教师等荣誉。
在国内外专业学术期刊上发表学术论文40余篇，其中部分论文被ISTP国际检索机构检索。
主持和参加科研项目22项，其中国家自然科学基金项目3项，部级项目6项，出版著作8部。

书籍目录

绪论　0.1 问题的缘起　0.2 研究意义与研究目标　0.2.1 研究意义　0.2.2 研究目标　0.3 研究思路、研究内容及研究的关键问题　0.3.1 研究思路　0.3.2 研究内容　0.3.3 研究的关键问题第1章 信用、风险、信用风险的辨析　1.1 信用　1.1.1 信用的内涵及其概念界定　1.1.2 信用、信誉、诚信的差别　1.1.3 信用产生的动力基础　1.2 风险　1.2.1 风险一词的由来　1.2.2 对风险解释的不同观点　1.2.3 风险的概念界定　1.3 信用风险　1.3.1 信用风险的内涵与概念界定　1.3.2 信用风险的外延及其本质　1.4 本章小结第2章 信用风险度量技术的兴起与度量方法　2.1 信用风险度量技术的兴起　2.1.1 信用风险的级联放大效应　2.1.2 信用风险度量技术兴起的原因　2.1.3 信用风险度量方法的演变　2.2 传统的信用风险度量方法　2.2.1 专家法　2.2.2 评级方法　2.2.3 信用评分法　2.3 KMV信用风险度量模型　2.3.1 KMV模型构建的理论基础　2.3.2 KMV模型的预期违约概率及其图解　2.3.3 KMV模型的假设前提与度量信用风险的过程　2.3.4 KMV模型的违约距离的计算　2.4 信用风险附加度量模型（Credit Risk＋）　2.4.1 信用风险附加模型构建的思路　2.4.2 信用风险附加模型的假设　2.4.3 信用风险附加模型的应用　2.5 信用度量术模型（Credit Metrics）　2.5.1 信用度量术模型构建的理论基础　2.5.2 信用评级与信用度量术模型的关系　2.5.3 信用度量术模型的框架图及其解要　2.6 信用组合观点模型（Credit Portfolio View）　2.6.1 信用组合观点模型的构建前提　2.6.2 信用组合观点模型的认识　2.7 信用风险度量方法的评述　2.7.1 传统方法的评述　2.7.2 信用风险度量模型的比较综述　2.7.3 信用风险度量模型在我国的适用性　2.8 既有度量信用风险模型局限中刻画的研究空间　2.9 本章小结第3章 信用风险产生的微观机理　3.1 信息不对称的信用风险分析　3.1.1 信用的博弈与信息经济分析　3.1.2 信用关系的博弈分析　3.1.3 不对称信息产生的信用风险　3.2 不完全契约的信用风险分析　3.2.1 不完全契约的基本理论　3.2.2 不完全契约下产生的信用风险　3.3 信用风险的博弈分析　3.3.1 信用风险的一次式博弈分析　3.3.2 信用风险的演进式博弈分析　3.4 演进博弈框架下信用风险的变动　3.4.1 信用风险变动的充分、必要条件　3.4.2 信用风险产生因素甄别　3.5 本章小结第4章 信用突发事件对信用风险的影响　4.1 信用突发事件的概念界定　4.1.1 突发事件　4.1.2 信用突发事件　4.2 信用突发事件与信用风险突变　4.2.1 信用突发事件与信用风险突变的区别　4.2.2 信用突发事件与信用风险变动关系　4.2.3 多因素耦合的信用风险变动　4.3 信用突发事件的分布情况　4.3.1 分布特点　4.3.2 引入泊松过程描述信用突发事件　4.4 信用突发事件对信用风险影响的分布情况　4.5 信用突发事件对信用风险影响的度量模型　4.5.1 模型构建的思路　4.5.2 构建的模型　4.5.3 两个模型的作用　4.6 本章小结第5章 信用风险影响因素的三层次物元模型与可拓分析　5.1 可拓学的理论方法　5.1.1 物元理论　5.1.2 可拓集合与关联函数　5.1.3 可拓方法　5.2 信用风险影响因素的物元模型　5.2.1 宏观影响因素的物元模型　5.2.2 行业影响因素的物元模型　5.2.3 公司经营状况的物元模型　5.3 信用风险影响因素的可拓分析　5.3.1 宏观因素可拓分析　5.3.2 行业因素可拓分析　5.3.3 宏观经济周期与行业轮动对公司影响的可拓分析　5.3.4 公司经营状况的可拓分析　5.4 本章小结第6章 信用风险度量指标的可拓识别　6.1 信用风险度量的物元分析　6.1.1 信用风险度量的物元模型　6.1.2 信用风险度量物元的可拓搜索　6.1.3 信用风险度量物元模型的可拓识别与流程框图　6.2 可拓识别在信用风险度量指标分析中的应用　6.2.1 可拓识别的数据库与数据的整理　6.2.2 待识别的物元模型　6.2.3 信用风险度量指标的可拓识别　6.3 本章小结第7章 以突变理论为基础的信用风险度量　7.1 突变理论的思想　7.2 突变理论的基本原理与数理模型　7.2.1 基本原理　7.2.2 数理模型　7.3 突变理论的应用领域　7.3.1 自然科学领域中的应用　7.3.2 经济领域中的应用　7.4 突变理论在信用风险度量中应用　7.4.1 信用风险的突变　7.4.2 突变理论在信用风险度量中应用的适用性　7.5 本章小结第8章 以突变理论为基础的信用风险度量模型构建与应用　8.1 模型的构建　8.1.1 模型构建的基础—突变级数法　8.1.2 模型构建的思路　8.1.3 指标体系的建立及其模型　8.2 构建模型的应用　8.2.1 样本与样本数据　8.2.2 样本企业的可拓识别结果与分析　8.2.3 突变级数法在计算机中的实现　8.2.4 数据修正与信用度量值计算　8.2.5 选取的81家上市公司信用风险度量结果　8.3 本章小结第9章 结论与展望　9.1 主要工作及结论　9.2 创新之处　9.3 尚待解决的问题及研究展望参考文献后记

章节摘录

第1章 信用、风险、信用风险的辨析　　信用是商品生产、货币流通、市场交易发展到一定阶段的产物。
信用关系反映了商品所有者之间的经济关系，它是建立在商品交换与货币流通基础上的。
构建信用关系的各环节中，任何一方出现信用问题会导致信用风险，阻碍市场经济的发展。
　　不论是在发达国家，还是在发展中国家，都存在信用风险。
信用风险直接影响社会经济生活的各个方面，影响一国的宏观经济决策和经济发展，甚至影响全球经济的稳定与发展，它已经成为一个全球性的问题。
　　信用风险也是金融机构面临的最主要的风险。
因此，对信用风险的度量与管理是金融机构管理的主要内容。
巴塞尔协议也鼓励银行开发信用风险度量模型，以提高度量的准确性，加强银行业的风险管理和银行监管。
　　众多的社会学家、法学家、经济学家等理论工作者加入到对信用问题的研究和讨论中。
但是，什么是信用?什么是风险？
什么是信用风险？
一直没有统一的说法，因此，在研究“信用风险的博弈分析与度量模型”问题之前，首先对信用、风险、信用风险进行解释和说明，并对本书涉及的信用、风险、信用风险概念进行界定。

第一图书网, tushu007.com

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