

<<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>