

<<信用衍生品>>

图书基本信息

书名：<<信用衍生品>>

13位ISBN编号：9787030331724

10位ISBN编号：7030331729

出版时间：2012-1

出版时间：科学出版社

作者：史永东,赵永刚,武军伟

页数：215

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>

## &lt;&lt;信用衍生品&gt;&gt;

## 内容概要

《信用衍生品:原理、定价及应用》是各类企业普遍面临的风险,而信用衍生品是迄今为止管理信用风险最为有效的市场化金融工具。

他山之石,可以攻玉,目前我国信用衍生品的发展和研究还处于起步阶段,借鉴国际经验和教训有助于我国建立健康、完善和有效的信用衍生品市场,而定价理论研究则是所有工作的基石。

基于此,《信用衍生品:原理、定价及应用》首次在国内对信用衍生品的定价理论和应用进行了系统梳理和研究。

《信用衍生品:原理、定价及应用》主要内容分为七部分:第1章介绍《信用衍生品:原理、定价及应用》研究的现实背景和理论价值、研究方法;第2章对信用衍生品的定价理论文献进行了梳理;第3章和第4章研究了单名信用衍生品的结构模型和综合模型;第5章~第8章对组合信用衍生品定价模型进行了扩展;第9章考虑了基于行为金融的信用衍生品定价理论;第10章和第11章,对信用衍生品在美国次贷危机中的作用进行分析,并研究了定价理论的应用;第12章对《信用衍生品:原理、定价及应用》主要工作进行总结。

《信用衍生品:原理、定价及应用》可作为高校金融工程专业教师、学生,以及相关领域研究人员的参考书。

## &lt;&lt;信用衍生品&gt;&gt;

## 书籍目录

## 前言

## 第1章 导论

- 1.1 研究的背景和意义
- 1.2 基本概念界定
- 1.3 研究方法和本书结构
- 1.4 主要贡献和进一步研究的问题

## 第2章 信用衍生品定价理论文献回顾及评价

- 2.1 结构模型
- 2.2 简化模型
- 2.3 综合模型
- 2.4 经验事实模型
- 2.5 小结

## 第3章 信用衍生品定价的结构模型

- 3.1 引言
- 3.2 基于GBM的信用衍生品定价结构模型
- 3.3 基于AJD过程的信用衍生品定价结构模型
- 3.4 AJD过程下具有动态回收率的结构模型
- 3.5 小结

## 第4章 信用衍生品定价的综合模型

- 4.1 引言
- 4.2 一个简单的综合模型
- 4.3 资产过程带跳跃的综合模型
- 4.4 跳跃扩散过程下具有时变跳跃强度的综合模型
- 4.5 时变跳跃强度下具有动态回收率的综合模型
- 4.6 小结

## 第5章 基于Copula函数的组合信用衍生品定价模型

- 5.1 引言
- 5.2 Copula函数的定义和相关预备知识
- 5.3 常见的Copula函数
- 5.4 最佳Copula函数选取的一致性原则
- 5.5 基于高斯单因素Copula的组合定价模型
- 5.6 基于随机相关性的Copula模型拓展
- 5.7 基于KJD分布的因素Copula模型
- 5.8 小结

## 第6章 基于VG分布的一般Copula模型

- 6.1 引言
- 6.2 相关研究综述
- 6.3 标准因素Copula模型
- 6.4 VG过程
- 6.5 基于VG分布的因素Copula模型

## <<信用衍生品>>

- 6.6 基本模型扩展一：基于随机关联
- 6.7 基本模型扩展二：基于交易对手风险
- 6.8 本章小结

### 第7章 基于LevyCopula的组合信用衍生品定价模型

- 7.1 引言
- 7.2 相关研究综述
- 7.3 LevyCopula的定义与性质
- 7.4 多维Levy过程模拟
- 7.5 LevyCopula在组合信用衍生品定价中的应用
- 7.6 本章小结

### 第8章 基于Levy过程的组合信用衍生品动态定价模型

- 8.1 引言
- 8.2 相关研究综述
- 8.3 基于Levy过程的组合信用衍生品动态定价模型
- 8.4 基本模型在组合信用衍生品定价中的应用
- 8.5 本章小结
- 附录

### 第9章 参与者行为对信用衍生品定价的影响

- 9.1 引言
- 9.2 跳跃扩散过程下违约的内生机制
- 9.3 逆向选择和道德风险对信用衍生品定价的影响
- 9.4 小结

### 第10章 信用衍生品在美国次贷危机中的作用

- 10.1 信用衍生品的风险类型
- 10.2 美国次贷危机中基于信用衍生品的风险传导
- 10.3 次贷危机中信用衍生品的作用评价
- 10.4 小结

### 第11章 信用衍生品在我国的应用研究

- 11.1 我国信用衍生品的发展路径
- 11.2 我国信用衍生品市场的制度建设
- 11.3 信用衍生品与国内出口企业应收账款风险管理
- 11.4 信用衍生品与中小企业融资
- 11.5 CDO与房地产贷款风险管理
- 11.6 小结

### 第12章 总结与展望

- 12.1 本书的主要贡献
- 12.2 政策借鉴
- 12.3 进一步研究的问题

参考文献

致谢

<<信用衍生品>>

<<信用衍生品>>

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>