

<<商业银行信用风险管理研究>>

图书基本信息

书名：<<商业银行信用风险管理研究>>

13位ISBN编号：9787115143808

10位ISBN编号：7115143803

出版时间：2007-1

出版时间：人民邮电出版社

作者：石晓军

页数：231

字数：270000

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>

## <<商业银行信用风险管理研究>>

### 内容概要

本书主要介绍了近年来信用风险度量，定价与管理的最新研究成果及其在商业银行中的应用。主要内容包括商业银行信用风险管理的理论基础、商业银行信用风险度量模型与实证、商业银行资产定价与实证、商业银行信用风险组合管理与实证、新巴塞尔协议与商业银行资本配置、信用衍生工具在商业银行信用风险管理中的运用。

本书适合于财经、金融专业人士阅读，也可作为金融风险管理及相关金融专业的教材。

## <<商业银行信用风险管理研究>>

### 作者简介

石晓军，管理学博士，北京航空航天大学经济管理学院副教授。

主要研究领域包括金融工程（信用风险管理）及产业经济学。

在《管理科学学报》、《系统工程理论与实践》、《数量经济技术经济研究》、《中国管理科学》、《财经研究》、《科学研究》、《研究与发展管理》等核心期刊

## <<商业银行信用风险管理研究>>

### 书籍目录

前言第1章 商业银行信用风险来源 一、资产负债表 二、主权债券与金融机构存款 三、客户贷款 四、表外工具 五、小结第2章 商业银行信用风险管理最优策略 一、商业银行风险管理的动机 二、商业银行信用风险管理最优策略决策第2章 商业银行信用风险管理演进的逻辑 一、商业银行信用风险管理：传统与现代 二、信用风险的信息不对称根源 三、传统信用管理作为一种信息不对称矫正机制 四、信用风险集中 五、分散化困境 六、专业化与分散化悖论 七、困境与悖论的解决 八、小结第4章 内部评级：第一道栅栏 一、内部评级的主要内容 二、稳健因子信用判别模型及实证研究 三、小结第5章 Logistic违约率模型及最优样本配比与分界点 一、引述 二、实证比较策略 三、Logistic模型的计量 四、实证结果 五、实证结果分析第6章 边界Logistic违约率模型及实证研究 一、边界Logistic与一般Logistic抽样分布性质的比较 二、边界Logistic模型的极大似然估计 三、实证研究设计 四、估计结果 五、结果分析第7章 结构化模型下的违约概率估计第8章 基于期权与基于会计信息信用模型的一致性研究第9章 等级迁移：动态掌握信用风险的关键技术第10章 科学定价：平衡风险与收益的利器第11章 组合管理：风险的分散第12章 信用风险的转移：信用衍生工具的应用第13章 资本：最后的守夜人参考文献

<<商业银行信用风险管理研究>>

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>