

<<信用风险评估>>

图书基本信息

书名：<<信用风险评估>>

13位ISBN编号：9787302093855

10位ISBN编号：7302093857

出版时间：2004年10月1日

出版时间：清华大学出版社

作者：Manuel Ammann

译者：杨玉明

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;信用风险评估&gt;&gt;

## 内容概要

## 目 录

第1章 引言 11.1 动机 21.2 研究目标 91.3 结构安排 11第2章 或有要求权评估 142.1 离散时间市场中的评估模型 152.2 连续时间下的评估 212.3 连续时间市场中的应用 292.4 在离散时间市场中的应用 472.5 小结 52第3章 信用风险模型 543.1 信用风险债券定价 553.2 含交易对手风险的衍生产品的定价 773.3 信用衍生产品定价 833.4 经验证据 863.5 小结 87第4章 含交易对手违约风险的衍生产品的公司价值定价模型 894.1 信用风险模型 904.2 确定的负债 914.3 随机负债 994.4 高斯利率和确定的负债 1054.5 高斯利率和随机负债 1124.6 脆弱远期合约 1164.7 数例 1174.8 小结 1314.9 命题的证明 133第5章 含信用风险的或有要求权的混合定价模型 1635.1 一般的信用风险框架 1635.2 应用 1725.3 脆弱期权的价格 1825.4 观察到的期限结构的复原 1845.5 风险债券的无违约期权 1865.6 数例 1885.7 计算的成本 1975.8 小结 199第6章 信用衍生产品的定价 2016.1 信用衍生工具 2026.2 信用衍生工具的评估 2056.3 复合定价法 2106.4 数例 2186.5 利用简化模型给利差衍生工具定价 2236.6 作为交易期权的信用衍生产品 2286.7 含交易对手违约风险的信用衍生产品 2366.8 小结 247第7章 结论 2507.1 总结 2517.2 实际应用 2537.3 研究前景 254附录A 鞅理论中的实用工具 256A.1 概率基础知识 256A.2 函数类型 258A.3 鞅 259A.4 布朗运动 260A.5 随机积分 263A.6 测度转换 268

<<信用风险评估>>

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>