

<<商业银行信贷风险统计与纳什均衡策略>>

图书基本信息

书名：<<商业银行信贷风险统计与纳什均衡策略>>

13位ISBN编号：9787501771332

10位ISBN编号：7501771332

出版时间：2005-9

出版时间：中国经济出版社

作者：邹新月

页数：218

字数：150000

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>

## <<商业银行信贷风险统计与纳什均衡策略>>

### 内容概要

本书在国有商业银行信贷风险统计与纳什均衡策略研究过程中，一方面借鉴国外学者关于信贷风险理论研究的最新成果；另一方面综合运用经济学、管理学、统计学、博弈理论的知识与原理，在商业银行信贷风险管理方法的引用研究上有所创新，首次明确提出商业银行信贷市场存在“羊群行为”、“非贝叶斯法则”、“过度反应”等行为金融学现象，并就其产生机理进行理论研究。

界定其在信贷市场中的表现特征，这样拓展了行为金融理论的应用范围，丰富了行为金融的研究成果，这为我国商业银行在未来完善的市场经济体制下制定防范信贷风险的决策措施提供重要的理论参考价值。

## 作者简介

邹新月，1965年4月生，教授，硕士生导师。

主要研究方向是金融产业风险管理与经济统计分析。

主持国家社会科学基金课题1项，中国博士后科学基金1项，国家统计局重点课题、湖南省自然科学基金等省部级课题5项，作为主要研究者参与国家课题研究2项、省部级课题研究12项；在《中国

## <<商业银行信贷风险统计与纳什均衡策略>>

### 书籍目录

前言第一章 导论 第一节 问题提出 第二节 研究意义 第三节 研究方法 第四节 研究框架第二章 商业银行信贷风险管理的历史变迁 第一节 商业银行信贷风险管理的起源 一、资产风险管理理论 二、负债风险管理理论 三、资产负债风险管理理论 四、风险资产管理理论 第二节 商业银行信贷风险管理理论综述 一、传统的计划经济体制下的信贷风险管理 二、有计划的商品经济体制下的信贷风险管理 三、社会主义市场经济体制下的信贷风险管理 第三节 我国商业银行信贷风险管理的历程第三章 商业银行信贷风险统计分析中的几个经济学问题 一、道德风险问题 二、逆向选择问题 三、机制设计问题 四、抵押担保贷款问题 五、寻租行为问题第四章 商业银行信贷风险统计分析理论模型 第一节 信贷风险与投资收益率、企业信用之间的数理描述 第二节 商业信贷风险度的探讨第五章 商业信贷风险统计分析实证研究 第一节 VaR方法在银行信贷风险评估中的应用 第二节 LR模型在银行信贷评估中的应用 第三节 信贷企业信用等级模糊综合评判 第四节 典型判别分析法评估企业信用风险第六章 商业银行信贷风险防范的博弈策略 第一节 我国信贷市场不完全信息动态博弈分析 第二节 负债企业信贷风险防范的博弈策略 第三节 WTO条件下中国商业银行的博弈策略第七章 国有商业银行信贷风险现状及防范对策 第一节 我国商业银行信贷风险现状 第二节 我国商业银行信贷管理体制 第三节 商业银行的规模经济和范围经济 第四节 商业银行信贷市场行为金融范式 第五节 我国商业银行不良贷款的成因及治理对策 第六节 国有商业银行信贷风险体制成因及防范对策结束语参考文献后记

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>