第一图书网, tushu007.com

<<贷款企业的违约风险测度>>

图书基本信息

书名：<<贷款企业的违约风险测度>>

13位ISBN编号：9787502451578

10位ISBN编号：7502451579

出版时间：2010-3

出版时间：冶金工业出版社

作者：贾文学

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

第一图书网, tushu007.com

内容概要

本书依据经济学和管理学相关理论，给出了一个企业违约率测度理论框架和模型。
研究结果表明，该模型有助于商业银行测度贷款企业违约率，提高信用风险管理能力。
本书共分6章，主要内容包括绪论、违约率测度的理论回顾、企业违约率测度研究的理论框架、基于企业财务理论的违约率测度研究、基于行业周期和市场集中度及地区环境变量的违约率测度研究、结论与展望。
附录为企业违约率测度研究的相关数据，并给出了违约率测度模型的输出结果。
　本书可供从事经济、金融、管理等行业的相关人员阅读，也可供从事金融研究的科研人员以及大专院校相关专业师生参考。

<<贷款企业的违约风险测度>>

书籍目录

1　绪论　1.1　问题提出　　1.1.1　美国次级债务危机与信用违约率　　1.1.2　我国商业银行信用风险管理现状与挑战　　1.1.3　我国商业银行违约率测度现状及问题提出　1.2　研究意义　　1.2.1　违约率测度研究的意义　　1.2.2　研究成果的实际价值　1.3　主要内容及研究方法　　1.3.1　本研究的相关界定　　1.3.2　主要内容　本章小结2　违约率测度的理论回顾　2.1　企业违约相关概念的明晰　　2.1.1　信用　　2.1.2　信用风险与违约风险　　2.1.3　信用评价与违约率测度　　2.1.4　违约认定标准与企业财务困境　　2.1.5　概念评述及其本书的概念体系　2.2　企业违约成因研究的相关文献　　2.2.1　国外相关文献　　2.2.2　国内相关文献　　2.2.3　关于违约成因研究的评述　2.3　企业违约率测度理论模型与实证研究的相关文献　　2.3.1　基于灾害理论的研究　　2.3.2　基于宏观经济理论的研究　　2.3.3　基于产业组织的文献　　2.3.4　基于区域经济的研究文献　　2.3.5　基于公司内部治理理论的研究文献　　2.3.6　基于现代公司财务理论的研究　　2.3.7　基于公司历史财务数据的研究　2.4　违约率测度过程中关键环节争议　　2.4.1　违约认定标准　　2.4.2　违约成因和违约过程研究　　2.4.3　违约样本数据选择　　2.4.4　违约预测的变量探寻　　2.4.5　违约预测的建模技术　　2.4.6　违约预测的模型评价　　2.4.7　违约预测的可靠性和可信性评价　　2.4.8　违约预测的模型与银行风险管理程序相融合　问题　本章小结3　企业违约率测度研究的理论框架　3.1　贷款企业违约本质分析　　3.1.1　还款意愿与企业违约　　3.1.2　还款能力与企业违约　3.2　企业违约的外部环境分析　　3.2.1　宏观环境的PESTEL要素分析　　3.2.2　行业环境的五要素分析　　3.2.3　战略集团的移动壁垒分析　　3.2.4　企业外部环境的违约分析框架　3.3　企业违约的内部运行机制分析　　3.3.1　企业本质　……4　基于企业财务理论的违约率测度研究5　基于行业周期和市场集中度及地区环境变量的违约率测度研究6　结论与展望附录参考文献

第一图书网, tushu007.com

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