

<<高级信用风险分析>>

图书基本信息

<<高级信用风险分析>>

内容概要

信用风险一直是银行和其他金融机构关心的主要话题。对待信用风险的传统方法是由信用风险部门根据过去的数据进行统计估计。然而，在最近几年，随着金融市场的迅速发展以及金融工具的日益复杂化，这种方法已经显得无法适应了。

在《高级信用风险分析》一书中，两位专家向大家展示了大量有关信用风险定价和管理的最新高级建模技术，另外还将他们在实践中进行的各种应用拿出来同大家探讨。

从全书的内容看，其阅读对象应该是金融专业的研究生和金融机构的高级风险管理人员。

<<高级信用风险分析>>

作者简介

迪迪埃·科森（Didier Cossin），瑞士洛桑HEC的金融学教授和洛桑国际管理发展研究所（IMD）的客座教授。

他先前在哈佛大学执教，并因优秀的授课能力而获得德里克·博克奖。

此外，他还曾经是麻省理工大学富布赖特研究人员。

他的博士学位是在哈佛大学获得的，他还在巴黎大学学习过多年。

于格·皮罗特（Hugues Pirotte）是FinMetrics的金融工程师和创立人之一，该公司主要为金融风险、绩效衡量及评估提供咨询和培训。

他的博士学位是在洛桑大学的HEC获得的。

在那里，他完成了关于信用风险的博士学位论文，并获得了金融和管地学位。

于格·皮罗特也在多所学校讲过课：洛桑大学（金融管理研究所）、日内瓦大学以及国际管理研究生院（日内瓦）。

他在很多一流杂志上发表过论文。

<<高级信用风险分析>>

书籍目录

译者序第1章 引言常用符号参考文献第一部分 信用风险定价第2章 现代信用风险定价介绍参考文献第3章 Merton的方法：结构模型背后的启示3.1 或有要求权分析（CCA）框架的最初版本：Merton（1974）3.2 利率的风险结构3.3 Merton模型中的违约概率和隐含回收率3.4 比较静态3.5 关于Merton模型的一些早期经验考察3.6 计算必要的输入变量：初步的评论3.7 债券定价实践：法国资本市场参考文献第4章 金融工程技术发展4.1 付息债券4.2 偿还优先等级不同的债务发行4.3 具有安全条款的债券4.4 可转换证券4.5 可赎回债券4.6 互换4.7 进一步的工程：跳跃 - 扩散方法（Zhou，1997）参考文献第5章 随机利率和信用风险第6章 关于破产内生性的深度考虑第7章 简化式/混合方法第二部分 衍生品中的信用风险第8章 互换信用风险定价第9章 期权中的信用风险：敏感期权第三部分 理论综述和经验证据第10章 引言第11章 文献综述第12章 经验证据第四部分 关于结构模型的一个说明第13章 引言第14章 定价模型第15章 比较静态第16章 实践运用和最后的议题第五部分 抵押、市价调整及其对信用风险的影响第17章 引言第18章 确定扣减率和为具有风险抵押的信用风险定价的结构方法第19章 作为脉冲控制问题的信用风险抵押控制第六部分 信用风险管理第20章 高级管理工具第21章 运用信用衍生产品进行财务结构管理附录附录A It 引理附录B 利率模型回顾参考文献

<<高级信用风险分析>>

编辑推荐

这是第一次对信用风险模型进行的全面而详尽的阐述。

对于那些希望理解现代信用风险管理基础的学生和风险管理从业者来说,《高级信用风险分析》绝对必要。

——迈克尔·克鲁奇 CIBC风险管理部 在信用风险研究领域,《高级信用风险分析》的讨论令人印象深刻。

几乎每一个方面都被涵盖了:结构模型、简化形式模型、衍生证券的信用风险以及经验结果,都得到了详细、深入的分析。

对于那些希望超越表象的信用风险专家们,应该仔细研读《高级信用风险分析》。

——雅米尔·巴兹 雷曼兄弟固定收益研究部主管 在过去几年里,对信用风险的测度和管理方法经历了一个革命性的变化。

高级信用风险定价和管理模型的发展,以及复杂的信用衍生品市场的崛起,都要求银行业和投资者重新考虑他们以前使用的方法。

在有关现代信用风险管理的概念和方法上,迪迪埃·科森和于格·皮罗特为我们提供了一个全面和综合的分析。

——盖伊·库格兰 J·P·摩根欧洲资产组合研究部主管 《高级信用风险分析》对各种受到信用风险影响的金融工具的估值结果进行了综合。

其涵盖面非常广泛。

因此,对于业界和有志于从事该领域的研究生来说,《高级信用风险分析》可以作为一本有用的教材。

。

——苏雷什 M·孙达森 哥伦比亚商学院教授

<<高级信用风险分析>>

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>