

<<信用产品全面指南>>

图书基本信息

书名：<<信用产品全面指南>>

13位ISBN编号：9787310021260

10位ISBN编号：7310021266

出版时间：2004-12

出版时间：南开大学

作者：金雪军

页数：508

字数：394000

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>

<<信用产品全面指南>>

内容概要

全书围绕金融工程中的信用风险管理这一核心问题，通过分析资本市场信用风险和构建信用风险管理框架，系统地介绍了各类金融衍生工具的信用风险构成、信用风险管理以及针对信用风险的定价方法。

全书共分为8章：第1章回顾了信用风险管理的相关概念；第2章介绍了固定收入工具的随机风险敞口这一概念，并分析了几种典型风险敞口的特征以及影响风险敞口的两类因素；第3章是在第2章的基础上将违约过程引入敞口分布，介绍了计算信用组合风险的方法，并通过一期和多期模型来具体说明相关因素对计算信用组合风险的影响；第4章是对第3章的补充，介绍了信用风险管理的一些基本内容；第5章介绍了信用衍生工具及其定价的一些基本内容；在第6章中讨论了信用衍生产品的定价和对冲问题，使用标准违约互换作为对冲对应方违约和信用利差风险的基本工具，并引入可变风险敞口和随机违约次数，同时还考虑了基于单一投资和投资组合两种情况下的合约定价；第7章将信用元素融入可转换债券的定价中，分析了可转换债券的信用风险及其对可转换债券定价的影响；最后一章讨论了与信用相关的三个话题，即市场非流动性的影响、套期保值投资非连续性的再平衡和市场参与者中存在的信息不对称。

此外，在附录中摘录了6篇来自风险杂志或风险书籍的比较重要的相关论文，作为对本书的补充。

<<信用产品全面指南>>

作者简介

安哥拉·阿万涅提斯是希腊艾格纳提银行风险部的负责人。他是该银行资产组侯管理分部的董事会成员，同时也是资产负债管理委员会和审计委员会委员。在此之前，Angelo曾于1997年成立了帕瑞巴斯全球银行，并管理其中的数量信用、保险和风险研究。他负责为信用衍生工具、可转换债

<<信用产品全面指南>>

书籍目录

- 出版说明译者简介译者序作者简介简介第一部分 信用风险管理 第1章 信用风险概论 1。
- 1 信用风险的要素 1。
 - 2 决定组合信用风险的因素 1。
 - 3 管理信用风险的传统方法 1。
 - 4 市场风险对信用风险 1。
 - 5 历史数据 1。
 - 6 违约损失分布的案例 1。
 - 7 信用风险模型 1。
 - 8 结信纸 第2章 风险敞口度量 2。
 - 1 简介 2。
 - 2 风险敞口模拟 2。
 - 3 典型风险敞口 2。
 - 4 总结 第3章 信用风险管理框架 3。
 - 1 信用损失分布和未预期损失 3。
 - 2 损失分布的推导 3。
 - 3 例子——一期模型 3。
 - 4 多时期模型 3。
 - 5 贷款对等 3。
 - 6 结论 附录A 贷款对等风险敞口公式的推导 附录B 例子模拟运算法则 第4章 信用风险管理的高级技巧 4。
 - 1 损失分布的分析式近似 4。
 - 2 蒙特卡罗加速技术 4。
 - 3 极值理论 4。
 - 4 边际风险 4。
 - 5 组合优化 4。
 - 6 信用利差模型 4。
 - 7 结论第二部分 信用风险的定价和对冲 第5章 信用衍生工具 5。
 - 1 简介 5。
 - 2 基本信用产品 5。
 - 3 信用定价的基本设想 5。
 - 4 基本信用 5。
 - 5 信用利差期权 5。
 - 6 多重基本产品 附录A 附录B 基于附录A中等级转换矩阵的历史利差的近似计算术语表人名表

<<信用产品全面指南>>

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>