

图书基本信息

书名：<<信用评级理论方法、模型与应用研究>>

13位ISBN编号：9787030337689

10位ISBN编号：7030337689

出版时间：2012-4

出版时间：科学出版社

作者：朱顺泉

页数：168

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>

## 内容概要

《信用评级理论方法、模型与应用研究》主要内容包括：（1）信用评级的相关概念、历史与制度；（2）信用评级的程序、方法、指标与机构；（3）企业信用评级与企业债券评级的传统方法；（4）信用评级模型；（5）信用风险计量模型；（6）基于因子统计分析的我国上市公司信用评级估模型及其应用研究；（7）基于神经网络方法的信用评级模型及其应用研究；（8）基于最小二乘支持向量机方法的上市公司信用评级及应用研究；（9）基于期权定价理论的上市公司信用评级及应用研究；（10）基于Copula函数的企业（银行）内部评级法预警应用研究；（11）资本结构作为信用风险信号的博弈模型的构建与应用研究。

## 作者简介

朱顺泉，男，汉族，湖南邵阳人，2001年毕业于中南大学商学院，获管理科学博士学位，2002~2004年在上海财经大学应用经济学博士后流动站从事博士后研究工作。

曾先后学习或工作于湖南大学、湖南财经学院、中南大学、上海财经大学、暨南大学。

现为广东财经政法大学金融学院教授，硕士生导师。

主要研究方向为信用评级、投资学、金融工程、公司金融财务等。

独立出版著作10余部，代表性著作有《创业投融资主体的机制设计、控制权分配与应用研究》、《金融投资学》、《金融工程理论与应用》、《公司金融财务学》、《统计与运筹优化应用》等，发表学术论文90余篇，主持完成省部级课题3项。

在投资组合优化（非线性规划、智能算法应用）、金融衍生品定价计算（有限差分、随机模拟、非线性方程组迭代法应用）、企业信用评级（多元统计、神经网络、支持向量机、期权定价评估）、创业投资管理机制等方面有较深入的研究。

书籍目录

前言

第1章 信用评级的相关概念、历史与制度

- 1.1 信用、信用风险和信用管理的概念
- 1.2 信用评级的概念、特点、作用与分类
- 1.3 信用评级的发展历程
- 1.4 国外的信用评级制度
- 1.5 我国的信用评级制度
- 1.6 我国信用评级的相关法规

第2章 信用评级的程序、方法、指标与机构

- 2.1 信用评级程序
- 2.2 信用评级原则
- 2.3 信用评级方法
- 2.4 信用评级指标
- 2.5 信用评级标准
- 2.6 国外著名的信用评级机构介绍
- 2.7 国内主要的信用评级机构介绍

第3章 企业信用评级与企业债券评级的传统方法

- 3.1 商业银行与企业信用评级
- 3.2 企业信用评级的指标体系
- 3.3 评定企业信用等级的一种简易方法
- 3.4 贷款企业信用评级报告案例
- 3.5 企业债券评级的传统方法

第4章 信用评级模型

- 4.1 信用评级模型的国内外研究现状
- 4.2 5C模型
- 4.3 LAPP法
- 4.4 SWOT分析模型
- 4.5 Chesser 信用评分模型
- 4.6 信用评分模型
- 4.7 消费贷款的评分模型
- 4.8 统计方法和神经网络方法在信用评级中应用的比较分析

第5章 信用风险计量模型

- 5.1 信用风险计量模型概述
- 5.2 风险价值VaR模型
- 5.3 信用监控KMV模型
- 5.4 信用计量Credit Metrics 模型
- 5.5 信贷资产组合模型
- 5.6 信用风险Credit Risk+模型
- 5.7 死亡率模型
- 5.8 信用风险计量模型的简要述评

第6章 基于因子分析法的我国上市公司信用评级模型及其应用研究

- 6.1 引言
- 6.2 样本的选取
- 6.3 财务比率的选取
- 6.4 模型的建立

## 6.5 结果检验

## 6.6 结论

## 第7章 基于Logistic回归模型的上市公司信用评级建模及其应用研究

## 7.1 上市公司信用识别研究的现状

## 7.2 样本选取

## 7.3 上市公司信用评级研究模型的选取

## 7.4 基于Logistic回归模型的上市公司信用评级实证研究

## 7.5 结论与建议

## 第8章 基于神经网络方法的信用评级模型及其应用研究

## 8.1 反向传播神经网络的拓扑结构

## 8.2 反向传播神经网络的学习算法

## 8.3 反向传播神经网络的学习程序

## 8.4 反向传播神经网络模型在企业信用评级中应用

## 8.5 反向传播神经网络模型在现金流量因素分析中应用

## 8.6 基于径向基函数神经网络RBF方法的信贷企业信用评级

## 8.7 基于学习向量量化LVQ网络的信用评级建模及应用

## 第9章 基于最小二乘支持向量机方法的上市公司信用评级及应用研究

## 9.1 目前信用评估方法问题

## 9.2 支持向量机方法

## 9.3 最小二乘支持向量机方法

## 9.4 变量选择与建模样本

## 9.5 最小二乘支持向量机实验建模过程与模拟结果

## 9.6 结果分析与结论

## 9.7 基于支持向量机的信用评级多分类

## 第10章 基于市场价格与期权定价模型的上市公司违约概率预测及应用研究

## 10.1 KMV模型的基本思路

## 10.2 参数设置

## 10.3 应用研究

## 10.4 结论

## 第11章 基于相依函数Copula的企业（银行）内部评级法预警及应用研究

## 11.1 基于正态分布产生的随机抽样

## 11.2 因子模型

## 11.3 二元相依函数Copular 的代数形式

## 11.4 多元相依函数Copula与因子Copula模型

## 11.5 基于相依函数Copula的信用贷款组合应用

## 11.6 基于相依函数Copula内部评级法预警

## 11.7 企业、政府银行的风险暴露

## 11.8 违约概率的估测

## 11.9 历史违约率

## 11.10 利用股价来估计违约概率

## 第12章 资本结构作为信用风险信号的动态博弈模型的构建及应用研究

## 12.1 不完全信息动态博弈模型

## 12.2 信号博弈的精煤炼贝叶斯均衡

## 12.3 不完全信息动态博弈的进一步讨论

## 参考文献



编辑推荐

《信用评级理论方法、模型与应用研究》由科学出版社出版。

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>