

<<信用风险>>

图书基本信息

书名：<<信用风险>>

13位ISBN编号：9787543219380

10位ISBN编号：7543219387

出版时间：2011-6

出版时间：格致出版社 上海人民出版社

作者：托马斯.R.比莱茨基 马雷克.卢特考斯基 译 唐齐鸣 译

页数：516

译者：唐齐鸣,黄苒,杨龙,熊洁敏

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>

<<信用风险>>

内容概要

本书的主要目的是全面总结信用风险研究领域的过去发展，同时提出该领域的最新进展。本书的一个重要方面在于试图缩短信用风险研究中数学理论与金融实践之间的差距，这些将作为本书数学建模研究的动机所在。

本书主要分三部分：第一部分主要是用传统的公司价值方法对公司债务进行估值以及套期保值；第二部分系统地提供了另一种信用风险建模所需的技术工具，即允许为不可料的违约随机时间或其他信用事件建模的简约方法；第三部分专门从不同方面对简约型方法进行了研究。

<<信用风险>>

书籍目录

第一部分 结构方法

1 信用风险导论

1.1 公司债券

1.2 可损权益

1.3 信用衍生品

1.4 信用风险的数量模型

2 公司债务

2.1 可违约权益

2.2 偏微分方程(PDE)方法

2.3 公司债务的默顿(Merton)方法

2.4 默顿方法的扩展

3 首次经过时间模型

3.1 首次经过时间的特性

3.2 布莱克-考克斯(Black—Cox)模型

3.3 最优资本结构

3.4 随机利率模型

3.5 研究新进展

3.6 相关的违约：结构方法

第二部分 风险过程

4 随机时间的风险函数

4.1 自然滤子的条件期望

4.2 连续风险函数的有关鞅

4.3 鞅表示定理

4.4 概率测度的变换

4.5 风险函数的鞅特性

4.6 随机时间的补偿元(器)

5 随机时间的风险过程

5.1 风险过程

5.2 鞅表示定理

5.3 概率测度的变换

6 鞅风险过程

6.1 鞅风险过程

6.2 风险过程和 的关系

6.3 鞅表示定理

6.4 鞅不变性的情形

6.5 给定风险过程的随机时间

6.6 泊松过程和条件泊松过程

7 几种随机时间的情形

7.1 几种随机时间的最小值

7.2 概率测度的变换

7.3 Kusuoka的反例

第三部分 简约型建模方法

8 基于强度的可违约权益估值

8.1 可违约权益

8.2 使用风险过程进行的估值

<<信用风险>>

- 8.3 使用鞅方法进行的估值
- 8.4 可违约权益的套期保值
- 8.5 一般简约型方法
- 8.6 含状态变量的简约型模型
- 9 条件独立的违约
 - 9.1 一篮子信用衍生品
 - 9.2 违约相关和条件概率
- 10 相互依赖的违约
 - 10.1 相互依赖的强度
 - 10.2 一篮子信用衍生品的鞅方法
- 11 马尔可夫链
 - 11.1 离散时间的马尔可夫链
 - 11.2 连续时间的马尔可夫链
 - 11.3 连续时间的条件马尔可夫链
- 12 信用转移的马尔可夫模型
 - 12.1 JLT马尔可夫模型及其扩展
 - 12.2 条件马尔可夫模型
 - 12.3 相关的转移
- 13 希斯-加罗-默顿(Heath-Jarrow—Morton)型模型
 - 13.1 含违约的HJM模型
 - 13.2 含信用转移的HJM模型
 - 13.3 信用衍生品的应用
- 14 可违约市场利率
 - 14.1 含有违约风险的利率合约
 - 14.2 含有单方违约风险的多期利率协议
 - 14.3 多期可违约的远期名义利率
 - 14.4 含有单方违约风险的可违约互换
 - 14.5 含有双方违约风险的可违约互换
 - 14.6 可违约远期互换利率
- 15 市场利率建模
 - 15.1 无违约市场利率模型
 - 15.2 可违约远期伦敦银行同业拆借利率的建模
- 参考文献导引
- 参考文献
- 基本符号注释
- 名词中英文对照表
- 译后记

<<信用风险>>

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>