

<<公司动态财务危机预警研究>>

图书基本信息

书名：<<公司动态财务危机预警研究>>

13位ISBN编号：9787563520473

10位ISBN编号：7563520473

出版时间：2010-7

出版时间：北京邮电大学出版社

作者：陈磊

页数：103

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>

<<公司动态财务危机预警研究>>

内容概要

随着中国市场经济的进一步深化，激烈的竞争使一些企业不可避免地会陷入财务危机，而一旦企业发生危机，就会威胁经济生活中的方方面面，甚至金融市场的稳定，因此，近来对于企业财务危机的研究受到越来越多的关注。

有效地预测企业财务危机是商业银行进行信贷风险管理中的重要环节，也是证券市场投资人减少承担企业经营风险的重要手段。

随着中国上市公司信息披露制度的不断完善，中国上市公司经营的透明度在逐步提高，财务信息的真实性和可靠性也在逐渐提高，这些条件的具备使得采用一些国际上经典的或最新的方法对企业财务危机的预测成为可能。

本书尝试将经典以及最新的模型和中国的实际相结合，对中国上市公司的财务危机预测进行了有益的探索。

本书适合金融从业人员及经济学、管理学研究生学习或参考。

<<公司动态财务危机预警研究>>

书籍目录

第1章 绪论 1.1 本书研究的背景、目的、意义 1.2 财务危机的相关概念 1.2.1 财务危机预警的概念 1.2.2 财务危机的定义 1.3 主要研究内容与本书结构安排 1.3.1 主要研究内容 1.3.2 本书的结构安排

第2章 经典财务危机静态预测模型的综述及其局限性 2.1 基于判别类模型的理论及其局限性 2.1.1 单变量判别模型 2.1.2 多变量判别模型 2.2 基于Logistic模型的理论及其局限性 2.2.1 基本理论及文献综述 2.2.2 Logistic模型的局限性 2.3 基于非参数模型的理论及其局限性 2.3.1 基于神经网络模型的理论及其局限性 2.3.2 基于支持向量机模型的理论及其局限性 2.3.3 基于分类树模型的理论及其局限性 2.4 基于市场数据模型的理论及其局限性 2.4.1 Merton的风险债权的期权理论方法 2.4.2 KMV的理论方法 2.5 经典模型的总结 第3章 基于财务模型和市场模型的财务危机预测模型比较研究 3.1 问题的引出和研究思路 3.2 基于财务数据的经典模型 3.2.1 Altman模型 3.2.2 F分数模型 3.2.3 Ohlson模型 3.2.4 基于财务模型的计算及比较 3.3 基于市场数据的经典模型 3.3.1 GARCH模型相关理论 3.3.2 权益价值波动率的求解 3.4 两类模型比较研究 3.5 本章小结 第4章 中国上市公司动态生存时间研究 4.1 问题的引出和研究思路 4.2 本书所应用的马尔可夫链的相关原理 4.2.1 随机过程的相关概念 4.2.2 马尔可夫链的相关概念 4.3 转移概率及平均步长的定义及应用 4.3.1 转移概率基础 4.3.2 平均步长理论基础 4.4 我国上市公司的实证分析 4.4.1 公司财务等级的定义 4.4.2 转移概率的计算 4.4.3 动态生存时间的计算 4.5 本章小结 第5章 基于Cox比例危险模型的财务危机预测研究 5.1 问题的引出和研究思路 5.2 生存分析的相关概念 5.2.1 生存函数 5.2.2 生存函数的概率密度函数 5.2.3 危险率函数 5.2.4 生存函数间的转换关系 5.3 Cox比例危险模型基本概念 5.4 基于Cox比例危险模型的财务危机预测研究 5.4.1 财务危机的定义及样本选取 5.4.2 对财务比率的主成分分析 5.4.3 危险函数模型的建立 5.5 本章小结 第6章 基于累积和控制图模型的财务危机动态预测研究 6.1 问题的引出和研究思路 6.2 财务危机变量的动态特点及其描述 6.3 统计过程控制(SPC)的相关理论 6.3.1 统计过程控制的相关概念 6.3.2 累积和控制图模型CUSUM 6.3.3 累积和控制图在财务危机预测中的理论模型 6.4 基于累积和控制图模型的财务危机预测研究 6.4.1 样本及财务比率的选择 6.4.2 模型各参数的估计 6.4.3 累积和控制图模型的建立 6.4.4 累积和控制图模型对建模样本的回判效果检验 6.4.5 累积和控制图模型预测效果的检验 6.5 本章小结 第7章 基于CUSUM和EWMA的财务危机动态预测比较研究 7.1 问题的引出和研究思路 7.2 基于指数加权移动平均控制图模型的财务危机预测研究 7.2.1 样本的定义及相关参数的估计 7.2.2 指数加权移动平均控制图模型的建立 7.2.3 EWMA模型对建模样本的回判效果检验 7.2.4 指数加权移动平均控制图模型预测效果的检验 7.2.5 两个模型对预测样本的预测效率比较 7.3 本章小结 第8章 公司多等级财务危机预测研究 8.1 问题的引出和研究思路 8.2 多等级财务危机的定义 8.3 预测危机状态1模型的确定 8.4 预测危机状态2模型的确定 8.4.1 危机状态2的定义及样本的选择 8.4.2 危机状态2模型参数的估计 8.4.3 危机状态2指数加权移动平均控制图模型的建立 8.5 模型预测效果的检验 8.6 本章小结 参考文献

<<公司动态财务危机预警研究>>

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>