

<<贷款定价与违约风险>>

图书基本信息

书名：<<贷款定价与违约风险>>

13位ISBN编号：9787565408557

10位ISBN编号：7565408557

出版时间：2012-6

出版时间：东北财经大学出版社有限责任公司

作者：毛捷

页数：211

字数：177000

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>

## <<贷款定价与违约风险>>

### 内容概要

毛捷所著的《贷款定价与违约风险(利率风险结构研究)》探讨以下问题：以非标准化的信贷市场作为分析对象，利率风险结构具有哪些规律性的特征？这些规律能为实际工作提供哪些重要的政策建议？通过回答上述问题，笔者的研究推进了对利率风险结构的理论研究，为后续开展有关利率风险结构的实证研究和政策分析，更好地利用利率与风险之间存在的内在关联来完善我国的利率形成机制，提供了依据和基础。

## <<贷款定价与违约风险>>

### 书籍目录

- 1 导论
  - 1.1 问题的提出、研究意义与目的
  - 1.2 研究内容、思路与方法
  - 1.3 研究框架
  - 1.4 创新点
  - 1.5 本章附录
- 2 贷款定价与违约风险研究综述
  - 2.1 经典利息理论及其蕴含的贷款定价思想
  - 2.2 违约风险与贷款定价的相关文献
  - 2.3 贷款定价的其他文献
- 3 我国金融机构贷款定价行为的现状及存在的问题
  - 3.1 制度环境
  - 3.2 现状分析
  - 3.3 存在的问题
- 4 贷款定价与违约风险：考虑决策者内在偏好
  - 4.1 贷款定价与跨期选择
  - 4.2 经验事实
  - 4.3 基于亚式期权方法的贷款定价模型
  - 4.4 本章案例研究
  - 4.5 本章小结
  - 4.6 本章附录
- 5 贷款定价与违约风险：考虑借款企业软预算约束
  - 5.1 传统期权定价方法存在的缺陷
  - 5.2 贷款定价两资产择差期权模型的建立
  - 5.3 贷款定价两资产择差期权模型的分析
  - 5.4 考虑抵押担保
  - 5.5 本章案例研究
  - 5.6 本章小结
  - 5.7 本章附录
- 6 贷款定价与违约风险：考虑资本管制
  - 6.1 巴塞尔资本协议的背景考察
  - 6.2 巴塞尔资本协议与贷款定价的文献补充
  - 6.3 一个参照模型——不考虑违约风险
  - 6.4 巴塞尔资本协议下的贷款定价模型——考虑违约风险
  - 6.5 本章小结
  - 6.6 本章附录
- 7 结论、政策建议与展望
  - 7.1 主要结论
  - 7.2 政策建议
  - 7.3 存在的不足与下一步研究的展望
- 参考文献
- 后记

<<贷款定价与违约风险>>

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>