

《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

出版社：东北财经大学出版社有限责任公司

作者：毛捷

页数：211

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介以及在线试读，请支持正版图书。

更多资源请访问：www.tushu000.com

《贷款定价与违约风险》

内容概要

《贷款定价与违约风险-利率风险结构研究》，本书首先结合现有文献，构建利率风险结构的一个基准模型，为后续理论分析提供研究基础；其次，在基准模型的基础上，逐步引入软预算约束、资本管制等实际因素，将理论模型不断逼近现实，得出更为丰富、更具政策指导意义的研究结论；再次，利用某家大型商业银行的贷款定价模型开展案例研究，以深化上述理论研究；最后，提出有针对性的、可操作的政策建议。

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:www.tushu000.com