



首页
概况
研究机构
学者介绍
成果文库
文献数据
培训教育
对外交流

□ 您的位置: 首页 → 数技经济研究杂志 → 现实经济问题研究

信贷资产组合保险策略定价研究

【摘要】本文探讨了信贷资产组合保险策略在信用风险管理领域的地位。基于CreditMetrics模型,提出了信贷资产组合保险策略的定价算法,这是对主流风险计量模型的一种全新尝试。处理的过程对CreditMetrics的VaR技术做了一些细节上的变换,通过蒙特卡洛模拟得到了较理想的运算结果。最后对模型的实施提出了合理的建议。

关键词 信用风险 保险 资产组合 定价 蒙特卡洛模拟

Search the Web

Find It

地址: 北京市建国门内大街5号 邮政编码: 100732 电话及传真: 010-65125895、010-65137561

版权所有 (c) 中国社会科学院数量经济与技术经济研究所

联系我们 E-mail to: iqte@cass.org.cn