

科技进步理论与管理

信用风险模型比较研究

田新时,彭丹

华中科技大学经济学院,华中科技大学经济学院 湖北武汉430074

收稿日期 修回日期 网络版发布日期 接受日期

摘要 对三类著名的信用风险模型:结构化模型、简约化模型、混合模型进行了比较研究,分别指出了它们的特点和优缺点,同时,分析了这些定量模型在我国应用时存在的问题,提出了提高我国信用风险管理水平的几点建议。

关键词 [信用风险](#) [结构化模型](#) [简约模型](#) [混合模型](#) [随机强度](#)

分类号

DOI:

对应的英文版文章: [2004-01-028](#)

通讯作者:

田新时

作者个人主页: [田新时;彭丹](#)

扩展功能

本文信息

- ▶ [Supporting info](#)
- ▶ [\[PDF全文\]\(181KB\)](#)
- ▶ [\[HTML\]\(0KB\)](#)
- ▶ [参考文献\[PDF\]](#)
- ▶ [参考文献](#)

服务与反馈

- ▶ [把本文推荐给朋友](#)
- ▶ [加入我的书架](#)
- ▶ [加入引用管理器](#)
- ▶ [引用本文](#)
- ▶ [Email Alert](#)
- ▶ [文章反馈](#)
- ▶ [浏览反馈信息](#)

相关信息

- ▶ [本刊中 包含“信用风险”的 相关文章](#)
- ▶ 本文作者相关文章
  - [田新时](#)
  - [彭丹](#)

