

债市“排雷”



[债市“排雷” 下载链接1](#)

著者:联合资信评估有限公司

出版者:中国金融出版社

出版时间:2019-1-1

装帧:平装

isbn:9787504996862

版本: 第1版, 平装, 中国金融出版社

作者介绍:

联合资信评估有限公司（简称“联合资信”）是中国全国性的评级机构，业务范围广泛、信誉度高、资质完备。联合资信秉承“专业、责任、创新、坚持”的理念，致力于为投资者、监管机构和市场参与各方提供独立、客观、公正、科学的信用评级结果，服务了一大批中国特大型央企和地方龙头企业，赢得了市场参与各方的普遍肯定和信任，树

立了良好的社会形象，确立了在市场中的公信力、很好不错性和影响力，为中国资本市场的健康稳定发展，发挥了积极作用。

目录: 理论与研究篇

第一章 违约与信用评级概述

节 信用风险与信用评级

一、 信用风险

二、 信用评级

第二节 违约概述

一、 国际上对于违约的界定

二、 中国对于违约的界定

三、 信用评级与违约的关系

第三节 违约处置和回收率

一、 违约处置和回收方式

二、 回收率相关概念

三、 回收率评级思路

第四节 信用评级质量检验方法

一、 违约率检验

二、 利差检验

三、 等级迁移

四、 利差、等级迁移、违约率与信用等级的关系

第五节 信用风险缓释

一、 信用风险缓释类型

二、 信用风险缓释工具

附录： CDS 隐含评级

第二章 全球债券市场违约研究

节 全球债券市场信用状况

一、 全球债券市场发展历程

二、 全球债券市场发展现状

三、 全球债券市场信用状况

第二节 国际三大评级机构全球企业信用风险研究

一、 国际三大评级机构全球企业违约率研究

二、 国际三大评级机构全球企业债券回收率研究

三、 国际三大评级机构全球企业等级迁移情况

第三节 主权违约原因与违约特点研究

一、 主权国家违约原因分析

二、 主权国家违约特点研究

三、 主权国家违约的启示

第三章 我国债券市场违约研究

节 我国债券市场信用状况

一、 我国债券市场发展历程

二、 我国债券市场发展现状

三、 我国债券市场“刚兑信仰”的逐步打破

第二节 我国债券市场信用风险分析

一、 我国债券市场信用风险概况

二、 我国债券市场信用风险主要特点

三、 我国债券市场信用风险发生的主要原因

第四章 我国债券市场违约后处置与回收

节 我国债券违约回收情况

第二节 我国债券违约处置方式分析

一、 无担保债券的违约处置方式

二、 有担保债券的违约处置方式

三、 总结

第三节 影响债券违约回收率因素分析

- 一、有无担保
- 二、企业性质
- 三、企业是否上市
- 四、地区分布
- 五、宏观和行业特征

第五章 信用风险度量模型

第一节 基于Probit 模型的我国企业违约风险实证研究

- 一、Probit 模型基本原理
- 二、基于Probit 模型的企业违约风险实证研究
- 三、结论及建议

第二节 基于Logit 回归模型的我国债券市场违约预测实证研究

- 一、Logit 模型基本原理
- 二、基于Logit 模型的企业违约风险实证研究
- 三、基于KMV 模型的企业违约风险测度研究
- 四、实证方法的局限性

实践与案例篇

第一章 材料行业

第一节 化工

- 一、常州永泰丰化工有限公司
- 二、江苏绿陵润发化工有限公司
- 三、浙江华欣新材料股份有限公司
- 四、达州玖源化工有限公司
- 五、四川广汉士达炭素股份有限公司
- 六、云南云维股份有限公司
- 七、达州市天盟塑料有限公司
- 八、内蒙古博源控股集团有限公司

第二节 金属、非金属与采矿

- 一、中国中钢股份有限公司
- 二、河南三力炭素制品有限公司
- 三、淄博宏达矿业有限公司
- 四、云南天浩稀贵金属股份有限公司

第三节 容器与包装

珠海中富实业股份有限公司

第二章 资本货物行业

第一节 机械

- 一、二重集团(德阳) 重型装备股份有限公司
- 二、中国第二重型机械集团公司
- 三、江苏舜天船舶股份有限公司
- 四、春和集团有限公司
- 五、大连机床集团有限责任公司

第二节 综合类

- 一、华盛江泉集团有限公司
- 二、亿阳集团股份有限公司
- 三、亿利资源集团有限公司

第三节 建筑与工程

- 一、中国城市建设控股集团有限责任公司
- 二、五洋建设集团股份有限公司

第四节 电气设备

保定天威集团有限公司

第三章 能源行业

石油、天然气与供消费用燃料

- 一、江苏恒顺达生物能源有限公司
- 二、安徽省福文新能源有限公司
- 三、四川圣达集团有限公司
- 四、中煤集团山西华昱能源有限公司
- 五、云南煤化工集团有限公司
- 六、内蒙古霍林河煤业集团有限责任公司

第四章 食品、饮料与烟草行业

- 一、中基健康产业股份有限公司
- 二、哈尔滨惠佳贝食品有限公司
- 三、南京雨润食品有限公司
- 四、内蒙古奈伦集团股份有限公司

第五章 半导体与半导体生产设备行业

- 一、江西赛维LDK 太阳能高科技有限公司
- 二、北京康特荣宝电子有限公司
- 三、保定天威英利新能源有限公司

第六章 运输行业

节 航空货运与物流

武汉国裕物流产业集团有限公司

第二节 交通基础设施

丹东港集团有限公司

第七章 其他行业

节 技术硬件与设备行业——电子设备、仪器和元件

北京地杰通信设备股份有限公司

第二节 汽车与汽车零部件行业——汽车

沈阳铭辰汽车有限公司

第三节 耐用消费品与服装行业——家庭耐用消费品

青岛三特电器集团有限公司

第四节 公用事业行业——燃气

信阳市弘昌管道燃气工程有限责任公司

第八章 中小企业集合债、中小企业集合票据

- 一、常州高力彩钢板有限公司、顶呱呱彩棉服饰有限公司、江苏旺达纸业股份有限公司
- 二、湖南省丰康生物科技股份有限公司、湖南省雪丽造纸有限公司
- 三、江苏中显集团有限公司、扬州赛尔达尼龙制造有限公司
- 四、淮安嘉诚高新化工股份有限公司、淮安华尔润化工有限公司
- 五、宁德市夏威食品有限公司、重汽集团福建专用车有限公司
- 六、福安市珍华工艺品有限公司、福安市振中电器制造有限公司
- 七、福建鑫久铝合金压铸有限公司、福建省福安市万利漆包线有限公司
- 八、四川省宜宾市昌明机械有限公司、宜宾金川电子有限责任公司

· · · · · (收起)

[债券“排雷”](#) [下载链接1](#)

标签

金融

信用评级

固定收益

债券

信用评级机构

信用研究

信用债

评论

后面一半都在堆砌数据，财务表格。一个公司写个一两页，太浅。一是实货肯定不会说出来，二可能是毕竟也没有啥实货。

意义不大。

[债市“排雷”](#) [下载链接1](#)

书评

里面就是介绍了一些基础知识，包括信用风险以及一些常用的模型。
后面有一大堆案例，但是案例介绍很简单，只有一个简单的分析。
既没有总结性的内容，也没有关键点的判断。
实际上用处不大，没有很有用的内容在里面。
有一些失望，因为毕竟是评级公司写的，还期望有一些使用的...

[债市“排雷”](#) [下载链接1](#)