

INDICE

PRÓLOGO	7
ACERCA DE LOS AUTORES	9
PARTE I: RIESGO DE CRÉDITO	11
CAPÍTULO 1: El riesgo de crédito en la gestión de carteras de renta fija <i>J. L. Martín y A. Trujillo</i>	13
CAPÍTULO 2: Los modelos de valoración de opciones en la gestión del riesgo de crédito: ¿Una alternativa?	37
<i>J. L. Martín y A. Trujillo</i>	
CAPÍTULO 3: Los modelos estructurales y la probabilidad de insolvencia: aplicación a las empresas del IBEX-35	69
<i>J. L. Martín y A. Trujillo</i>	
CAPÍTULO 4: El rating y la fijación de precios en préstamos comerciales: Aplicación mediante un modelo LOGIT	89
<i>J. L. Martín y A. Trujillo</i>	
CAPÍTULO 5: La matriz de transición de calificaciones como instrumento de gestión del riesgo de crédito	123
<i>J. L. Martín, C. Téllez y A. Trujillo</i>	
CAPÍTULO 6: Los contratos derivados crédito en la gestión de carteras de préstamos comerciales	145
<i>J. L. Martín y A. Trujillo</i>	
CAPÍTULO 7: Determinación de las calificaciones crediticias soberanas: modelos de aproximación lineal y de tipo LOGIT	161
<i>J. L. Martín y C. Téllez</i>	
PARTE II: RIESGO DE MERCADO	187
CAPÍTULO 8: El <i>stress-testing</i> en las metodologías VeR	189
<i>J. L. Martín y J. M. Feria</i>	
CAPÍTULO 9: El efecto diversificación en términos de VeR relativo calcu- lado por simulación Montecarlo	211
<i>J. L. Martín y J. M. Feria</i>	

PARTE III: RIESGO OPERACIONAL.....	239
CAPÍTULO 10: El riesgo operacional en el nuevo acuerdo de Basilea.. <i>J. L. Martín y E. J. Jiménez</i>	241
PARTE IV: EL NUEVO ACUERDO DE BASILEA.....	259
CAPÍTULO 11: La nueva propuesta del Comité de Basilea para la medición de riesgos	261
<i>J. L. Martín y R. Samaniego</i>	
CAPÍTULO 12: El nuevo Acuerdo de Basilea y la gestión del riesgo de crédito	281
<i>J. L. Martín y A. Trujillo</i>	