

1. Record Nr.	UNINA9910464346603321
Autore	Chan-Lau Jorge A
Titolo	Currency mismatches and corporate default risk [[electronic resource] ] : modeling, measurement, and surveillance applications / / prepared by Jorge A. Chan-Lau and Andre O. Santos
Pubbl/distr/stampa	[Washington, D.C.], : International Monetary Fund, Research Dept., c2006
ISBN	1-4623-4273-6 1-4527-7435-8 1-283-51638-1 9786613828835 1-4519-0982-9
Descrizione fisica	1 online resource (32 p.)
Collana	IMF working paper ; ; WP/06/269
Altri autori (Persone)	SantosAndre O
Soggetti	Corporations - Finance Default (Finance) Electronic books.
Lingua di pubblicazione	Inglese
Formato	Materiale a stampa
Livello bibliografico	Monografia
Note generali	"December 2006."
Nota di bibliografia	Includes bibliographical references.
Nota di contenuto	""Contents""; ""I. INTRODUCTION""; ""II. WHY DO CURRENCY MISMATCHES MATTER?""; ""III. THE STRUCTURAL APPROACH TO DEFAULT RISK""; ""IV. THE DIFUSION MODEL""; ""V. THE JUMP-DIFFUSION MODEL""; ""VI. THE DOUBLE EXPONENTIAL JUMP-DIFFUSION MODEL""; ""VII. SURVEILLANCE APPLICATIONS""; ""VIII. CONCLUSIONS""; ""REFERENCES""