

1. Record Nr.	UNINA9910464563203321
Autore	Chan-Lau Jorge A
Titolo	Idiosyncratic and systemic risk in the European corporate sector [[electronic resource]] : CDO perspective / / prepared by Jorge A. Chan-Lau and Yinqiu Lu
Pubbl/distr/stampa	[Washington, D.C.], : International Monetary Fund, 2006
ISBN	1-4623-4072-5 1-4519-9642-X 1-283-51193-2 9786613824387 1-4519-0901-2
Descrizione fisica	1 online resource (18 p.)
Collana	IMF working paper ; ; WP/06/107
Altri autori (Persone)	LuYinqiu
Soggetti	Financial risk - Europe Credit derivatives - Europe Electronic books.
Lingua di pubblicazione	Inglese
Formato	Materiale a stampa
Livello bibliografico	Monografia
Note generali	"April 2006."
Nota di bibliografia	Includes bibliographical references.
Nota di contenuto	""Contents""; ""I. INTRODUCTION""; ""II. A BRIEF PRIMER ON COLLATERALIZED DEBT OBLIGATIONS""; ""III. DEFAULT PROBABILITY AND DEFAULT CORRELATION, IN STCDOS""; ""IV. IDIOSYNCRATIC AND SYSTEMIC RISK IN STCDO TRANCHES""; ""V. DATA AND EMPIRICAL FRAMEWORK""; ""VI. RESULTS""; ""VII. CONCLUSIONS""; ""REFERENCES""