

## 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 .. <i>J. L. Martín y R. Samaniego</i>	261
CAPÍTULO 12: El nuevo Acuerdo de Basilea y la gestión del riesgo de crédito .. <i>J. L. Martín y A. Trujillo</i>	281