

<b>Diário Económico</b> – Universidades AESE e Cranfield desenvolvem modelo de 'pricing' de dívida Autor: N.D. Editora: ST e SF	<b>Id:</b> 1701879 <b>Data Publicação:</b> 10-10-2011 <b>Fonte:</b> Jornal <b>Edição:</b> 5276	<b>Página:</b> 8 <b>Tiragem:</b> 22206 <b>Periodicidade:</b> Aperiódica <b>Idioma:</b> Português	<b>Pais:</b> Portugal <b>Âmbito:</b> Nacional <b>Altura x Largura:</b> 4 cm x 7 cm		
--	---	---	--	--	--

**AESE e Cranfield desenvolvem modelo de 'pricing' de dívida**

Manuel Rodrigues da **AESE** - Escola de Direcção de Negócios está a desenvolver e testar uma extensão do modelo dos prémios Nobel Robert Merton e Myron Sholes para o 'pricing' do risco de crédito de dívida obrigacionista. A capacidade explicativa do modelo desenvolvido chega aos 84% da variação do risco de crédito.