

<<解密对冲基金指数与策略>>

图书基本信息

书名：<<解密对冲基金指数与策略>>

13位ISBN编号：9787121190889

10位ISBN编号：7121190885

出版时间：2013-1

出版时间：电子工业出版社

作者：卢扬洲等 编著

页数：281

字数：405000

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问：<http://www.tushu007.com>

## <<解密对冲基金指数与策略>>

### 内容概要

本书是国内对冲基金策略分类与评级体系研究的第一书。

全书共分为5篇，细分为21章。

第一篇对国外和国内的对冲基金的发展及面临的挑战做了梳理。

第二、三篇对国内外对冲基金分类体系进行了举例及体系构建的研究，并详细介绍了国际市场上成熟的策略分类体系。

主要策略为：股票多空仓策略、宏观策略、事件驱动策略、CTA策略、相对价值策略、基金的基金策略和行业策略。

第四篇对对冲基金指数的发展、编制、维护进行了详细的阐述，并对指数构建进行了全面系统的研究。

第五篇对对冲基金评价体系进行了深入的解剖，对国内主要的基金评级体系进行比较，总结研究出对冲基金评级体系的构建。

## <<解密对冲基金指数与策略>>

### 作者简介

卢扬洲 曾用名

卢强。

国防科技大学计算机硕士，武汉大学管理学博士；上海财经大学金融学博士后，上海财经大学金融学院硕士生导师。

历任高级工程师、证券公司研究员、上市公司副总裁、投资公司副总裁，擅长数量化投资及程序化交易，具有计算机和金融复合背景。

CHP(对冲基金经理职业认证)CAIA(另类投资分析师)：深厚的金融学理论基础和对冲基金的研究功底。

现任深圳市中金阿尔法投资研究有限公司总经理、对冲网研究总监。

## <<解密对冲基金指数与策略>>

### 书籍目录

#### 第1篇 对冲基金简介

##### 第1章 对冲基金概况

###### 1.1 什么是对冲基金

###### 1.2 自营交易

###### 1.3 目前对冲基金的主要特点

###### 1.4 资本容量

###### 1.5 佣金

###### 1.6 对冲基金行业业绩概况

###### 1.7 对冲基金经理

###### 1.8 阿尔法和贝塔

###### 1.9 投资策略

###### 1.10 探索者和边界

###### 1.11 SEC的警觉

###### 1.12 业绩持续性考虑

###### 1.13 资本和业绩持续性

###### 1.14 能力还是机会

###### 1.15 避免损失的重要性

###### 1.16 长期投资下的年收益率递减

###### 1.17 案例：一个对冲基金的创立

###### 1.18 对冲基金运作及服务提供商

###### 1.19 规模及收益

###### 1.20 世界前十大对冲基金

##### 第2章 国内对冲基金发展

###### 2.1 中国基金对冲时代

###### 2.2 对冲基金投资应用

###### 2.3 对冲基金面临的挑战

#### 第2篇 对冲基金分类体系概要

##### 第3章 对冲基金现况

###### 3.1 对冲基金分类内涵

###### 3.2 HFR对冲基金分类体系

###### 3.3 MSCI对冲基金分类体系

##### 第4章 对冲基金分类研究

###### 4.1 国内外对冲基金分类现况

###### 4.2 中国对冲基金分类体系构建

#### 第3篇 对冲基金策略分类体系

##### 第5章 股票多空仓策略

###### 5.1 股票多空仓策略概况

###### 5.2 股票多空仓策略体系

###### 5.3 著名股票投资基金：老虎基金

##### 第6章 全球宏观策略

###### 6.1 全球宏观策略概述

###### 6.2 全球宏观对冲基金新特征

###### 6.3 全球宏观对冲基金投资策略分析

###### 6.4 全球宏观投资绩效分析

##### 第7章 事件驱动策略

## <<解密对冲基金指数与策略>>

- 7.1 事件驱动策略概况
- 7.2 事件驱动策略体系
- 7.3 次贷危机中的大赢家：保尔森对冲基金
- 7.4 事件驱动策略全球表现
- 第8章 管理期货CTA策略
- 8.1 管理期货基金概述
- 8.2 管理期货CTA运作流程
- 8.3 管理期货CTA基金投资策略分析
- 8.4 管理期货CTA基金的绩效分析
- 8.5 管理期货CTA基金在国内的发展
- 第9章 相对价值策略
- 9.1 相对价值策略概况
- 9.2 华尔街最牛对冲基金：大奖章基金
- 9.3 相对价值策略体系
- 第10章 对冲基金的基金
- 10.1 FOF策略概述
- 10.2 FOF投资管理体系
- 10.3 FOF国内发展状况
- 10.4 国内FOF发展建议
- 第11章 行业对冲基金
- 11.1 行业基金简述
- 11.2 海外行业基金
- 11.3 国内行业基金
- 11.4 我国行业基金面临的问题
- 第4篇 对冲基金指数研究与实践
- 第12章 对冲基金指数概述
- 12.1 对冲基金指数内涵
- 12.2 对冲基金指数类型
- 12.3 对冲基金指数数据库
- 第13章 对冲基金指数发展
- 13.1 对冲基金指数发展现况
- 13.2 新兴可投资对冲基金指数
- 13.3 CSFBTronment可投资对冲基金指数
- 13.4 可投资对冲基金指数业绩的比较
- 13.5 HFR公司研究
- 13.6 我国对冲基金指数的发展
- 第14章 对冲基金指数编制及维护
- 14.1 对冲基金指数结构
- 14.2 对冲基金指数计算
- 14.3 HFRI对冲基金指数编制
- 14.4 对冲基金指数维护
- 第15章 国内对冲基金指数介绍与比较
- 15.1 国内四大对冲基金指数
- 15.2 对冲基金指数分析比较
- 第16章 对冲基金指数体系构建研究
- 16.1 对冲基金指数编制方法
- 16.2 中国对冲基金指数体系

<<解密对冲基金指数与策略>>

- 16.3 基准指数与区域指数
- 16.4 可投资对冲基金指数
- 第5篇 对冲基金评价研究与实践
- 第17章 对冲基金评价概况
- 17.1 概念和特征
- 17.2 相关性与回归分析
- 17.3 尾部风险分析
- 17.4 对冲基金历史绩效表现
- 17.5 对冲基金绩效现况
- 第18章 基金业绩评价方法
- 18.1 经典业绩评价方法
- 18.2 VaR业绩评价方法
- 第19章 国内私募业绩评价现况
- 19.1 晨星私募基金业绩评价
- 19.2 融智与好买绩效评价
- 19.3 兴业信托朝阳永续私募绩效评价
- 第20章 国内主要基金评级体系比较
- 20.1 基本评级因素
- 20.2 风险调整收益
- 第21章 对冲基金评级体系构建研究
- 21.1 对冲基金评级体系概要
- 21.2 业绩评价指标体系
- 21.3 业绩评价指标算法
- 21.4 业绩评价方法
- 附录A HFR交易策略分类
- 附录B HFR投资区域分类
- 附录C HFR对冲基金指数结构
- 附录D MSCI对冲基金指数结构
- 附录E 对冲网“基于策略分类的对冲基金指数与评级体系”

<<解密对冲基金指数与策略>>

版权说明

本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问:<http://www.tushu007.com>