第一图书网, tushu007.com

<<一个革命的范式>>

图书基本信息

书名：<<一个革命的范式>>

13位ISBN编号：9787121201899

10位ISBN编号：7121201895

出版时间：2013-6

出版时间：电子工业出版社

作者：卢扬洲,对冲网阿尔法研究中心 编

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

内容概要

《一个革命的范式:对冲基金与另类投资组合策略与理论》内容简介：书中介绍另类投资管理体系内国际先进的阿尔法-贝塔策略，着重讲解主动阿尔法策略和被动贝塔策略在另类投资组合管理中的应用。《一个革命的范式:对冲基金与另类投资组合策略与理论》分为四个部分：第一部分介绍了投资组合管理理论从均值-方差到阿尔法&贝塔范式的综述；第二部分介绍了组合管理的主动阿尔法策略；第三部分介绍了组合管理的被动贝塔策略；书中通过实例讲述阿尔法策略与贝塔策略在投资组合管理中的运用。

《一个革命的范式:对冲基金与另类投资组合策略与理论》适合基金管理人士、对冲基金机构投资者、市场监管者、财富管理从业者、大学教研人员及对财富管理感兴趣的各界人士阅读。

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。
联系邮箱：794457817@qq.com

第一图书网, tushu007.com

书籍目录

第1部分 另类投资组合管理理论综述
第1章 从均值方差范式到阿尔法-贝塔范式的革命 2
1.1 均值-方差范式 2
1.2 阿尔法-贝塔范式与被动管理和主动管理策略 5
第2部分 主动型阿尔法策略
第2章 对冲基金组合基金投资组合构建与优化理论与实践 52
2.1 对冲基金特点 53
2.2 对冲基金投资组合构建与优化的理论研究 54
2.3 文献评述 61
2.4 理论模型构建 62
2.5 实证分析 69
2.6 结论 75
第3章 对冲基金业绩与风险预测理论与实证分析 77
3.1 研究背景 77
3.2 国内外研究现状 82
3.3 研究方法与研究意义 84
3.4 对冲基金业绩与风险预测理论 86
3.5 对冲基金业绩及风险预测神经网络模型构建 92
3.6 对冲基金业绩预测模型实证分析与评估 95
3.7 对冲基金业绩预测模型实证分析与评估 103
3.8 结论及展望 108
第4章 对冲基金风险管理与压力测试 111
4.1 对冲基金风险管理背景 111
4.2 研究目的、方法及内容 121
4.3 对冲基金风险特征 121
4.4 对冲基金压力测试理论模型——LMLC模型 124
4.5 总结 137
第5章 对冲基金下行风险管理理论 138
5.1 对冲基金下行风险度量的意义 138
5.2 对冲基金下行风险管理的实证分析 151
5.3 结论与建议 160
第6章 可转移Alpha策略 162
6.1 可转移ALPHA策略的定义 162
6.2 可转移ALPHA策略的理论基础 173
6.3 资产配置与可转移ALPHA策略 174
6.4 可转移ALPHA策略的执行 180
6.5 可转移ALPHA策略在负债驱动型投资中的应用 196
6.6 可转移ALPHA策略在中国的应用 206
第7章 阿尔法核策略——以捐赠基金为例 208
7.1 大学捐赠基金概述 208
7.2 大学捐赠基金的投资目标及支出策略 212
7.3 当代捐赠基金资产配置模式 218
7.4 运用阿尔法核（ALPHA CORE）进行逆向资产配置 226
7.5 阿尔法核配置策略下的实际表现 245
7.6 总结 247

第一图书网, tushu007.com

第3部分 被动贝塔投资策略
第8章 贝塔-阿尔法（贝塔核心策略） 250
8.1 研究思路 250
8.2 对冲基金收益的驱动力 251
8.3 对冲基金复制的技术 254
8.4 利用另类贝塔策略进行对冲基金复制和管理 256
8.5 复制和对冲基金的未来 274
第9章 对冲基金利润复制理论及运用实效 278
9.1 选题背景和意义 278
9.2 文献综述 280
9.3 模型建立与实证分析 284
附录 对冲网对冲基金指数与分类体系简介 292
参考文献 300

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