

《对冲基金建模与分析——基于MATLAB》

书籍信息

版次：1

页数：

字数：

印刷时间：2015年12月01日

开本：16开

纸张：轻型纸

包装：平装

是否套装：否

国际标准书号ISBN：9787121275432

丛书名：量化投资与对冲基金丛书

编辑推荐

本书以浅显易懂的风格从理论和实践两方面对对冲基金绩效建模与分析进行了全面介绍。通过实际案例、图形和程序的形式来阐述相关内容，是不可多得的优质工具书，懂金融和懂技术的读者都能从中获益。对于想要认真研究衍生品投资的人而言，本书可以帮助打下坚实基础并指引方向，特别是在动荡的投资环境中。

相关推荐：

[《量化投资与对冲基金入门》](#)

内容简介

本书是关于用MATLAB对对冲基金进行建模和分析的入门读物。在对对冲基金的基本概念、分类、相关工具和指标系统介绍的基础上，作者借助实际案例、图形和程序来使读者更清晰明白如何运用MATLAB玩转对冲基金。本书作者拥有丰富的实践经验和学术背景，语言简明严谨，无论是懂金融的还是懂技术的人都能从中得到收获。

目录

第1章 对冲基金行业	1
1.1 什么是对冲基金	2
1.2 对冲基金结构	4
1.2.1 基金行政管理人.....	4
1.2.2 大宗经纪商.....	5
1.2.3 托管人、审计员、律师.....	6
1.3 全球对冲基金行业	7
1.3.1 北美市场.....	8
1.3.2 欧洲市场.....	9
1.3.3 亚洲市场.....	10
1.4 专业投资技术	11
1.4.1 卖空交易.....	11
1.4.2 杠杆.....	13
1.4.3 流动性.....	13第1章

对冲基金行业	11.1 什么是对冲基金
.....	21.2 对冲基金结构
.....	41.2.1
基金行政管理人.....	41.2.2
大宗经纪商.....	51.2.3
托管人、审计员、律师.....	61.3
全球对冲基金行业	71.3.1
北美市场.....	81.3.2
欧洲市场.....	91.3.3
亚洲市场.....	101.4
专业投资技术	111.4.1
卖空交易.....	111.4.2
杠杆.....	131.4.3
流动性.....	131.5
对冲基金的新产品	151.5.1 UCITS III
对冲基金	151.5.2
欧洲通行证.....	181.5.3
卖空限制.....	18第2章
对冲基金数据源	202.1 对冲基金数据库
.....	212.2 主要对冲基金指标
.....	212.2.1
非可投资指数和可投资指数.....	222.2.2
道琼斯瑞士信贷对冲基金指数.....	242.2.3
对冲基金研究公司.....	302.2.4
富时对冲.....	342.2.5
格林威治替代投资.....	352.2.6
晨星替代投资中心.....	382.2.7 EDHEC
风险和资产管理研究中心	412.3 数据库和指数偏差
.....	422.3.1
生存偏差.....	422.3.2
瞬时历史偏差.....	442.4 基准管理
.....	442.4.1
跟踪误差.....	46第3章 统计分析
.....	483.1 基本特性图
.....	493.1.1
增值指数.....	49

[显示全部信息](#)

译者序

随着中国金融市场的逐步完善，交易品种（例如ETF 指数基金、股指期货、股指期权）的逐步丰富，对冲基金开始在中国蓬勃发展。对冲基金在风险收益特征上与传统的主动管理基金、指数基金有所不同，所以从资产配置角度，对冲基金对于中国投资者具有巨大的配置价值。

自2015年起，国内的对冲基金数量已经从起初的几十只，发展到成百上千只。我与同事起初构想创建对冲基金的FOF（Fund Of Fund），即FOHF（Fund Of HedgeFund），通过将不同策略的优秀对冲基金进行投资组合，以进一步优化产品的风险收益特性。但是，国内尚无完善的对冲基金评价体系，为此我们甄选出本书，并借鉴书中的研究系统进行对冲基金的系统性研究。

本书内容简介如下：

第1章介绍对冲基金以及对冲基金行业的发展历程，以便从历史发展的角度熟悉对冲基金的过去。

第2章介绍对冲基金数据源，获取准确、可靠、及时的对冲基金数据对于基金管理人和那些希望量化监管和评估投资回报、绩效的分析师来说非常重要。译者序

随着中国金融市场的逐步完善，交易品种（例如ETF 指数基金、股指期货、股指期权）的逐步丰富，对冲基金开始在中国蓬勃发展。对冲基金在风险收益特征上与传统的主动管理基金、指数基金有所不同，所以从资产配置角度，对冲基金对于中国投资者具有巨大的配置价值。自2015年起，国内的对冲基金数量已经从起初的几十只，发展到成百上千只。我与同事起初构想创建对冲基金的FOF（Fund Of Fund），即FOHF（Fund Of HedgeFund），通过将不同策略的优秀对冲基金进行投资组合，以进一步优化产品的风险收益特性。但是，国内尚无完善的对冲基金评价体系，为此我们甄选出本书，并借鉴书中的研究系统进行对冲基金的系统性研究。本书内容简介如下：第1章介绍对冲基金以及对冲基金行业的发展历程，以便从历史发展的角度熟悉对冲基金的过去。第2章介绍对冲基金数据源，获取准确、可靠、及时的对冲基金数据对于基金管理人和那些希望量化监管和评估投资回报、绩效的分析师来说非常重要。第3章和第4章分别介绍统计分析 with 均值方差最优模式，这些是对冲基金建模与分析不可缺少的理论基础。第5章介绍业绩评价方法，由于对冲基金经理、商品交易顾问（CTA）可以使用杠杆及做空机制（传统基金经理则不能），因此他们的收益率受杠杆及多空投资组合的共同作用影响，为抵消杠杆效应的影响，应在现金（非杠杆）而非投资组合风险的基础上评价基金经理的业绩表现。第6章介绍对冲基金的分类，随着对冲基金的发展，对冲基金种类繁多，为进行有效的业绩评价，应该将某对冲基金与其同类基金进行对比，所以对冲基金分类是必须的。第7章介绍市场风险管理，随着最近金融事件曝光的加强，对冲基金经理面临来自于投资者和监管机构更大的压力，要求更高的管理效率、更强的监管并要评估、报告投资策略中内含的上述市场风险。经验告诉我们衡量并控制极端市场条件对于对冲基金来说至关重要。此书不仅语言表述通俗易懂，而且有理论基础并辅以具体MATLAB程序以便实践，特此向读者进行推荐。郑志勇2015年11月7日于深圳

[显示全部信息](#)

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www.tushupdf.com](http://www.tushupdf.com)