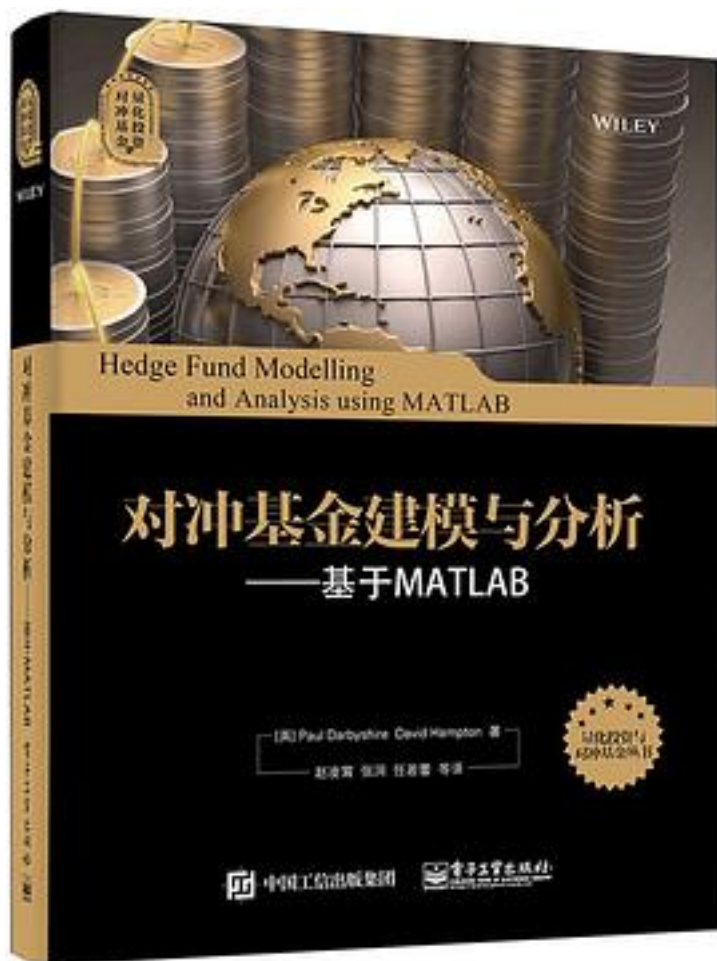


对冲基金建模与分析——基于MATLAB



[对冲基金建模与分析——基于MATLAB 下载链接1](#)

著者:【英】 保罗·达比希尔 (Paul Darbyshire)

出版者:电子工业出版社

出版时间:2015-12

装帧:

isbn:9787121275432

MATLAB
是数值计算、可视化及编程的一种高级语言和互动环境。《对冲基金建模与分析——基

于MATLAB》是在基于MATLAB技术的计算机环境下，对对冲基金建模与分析的一种实践指导。《对冲基金建模与分析——基于MATLAB》共分为7章，主要内容包括对冲基金行业的发展和关键投资技术、对冲基金数据源构造的指数和基准、对冲基金收益率统计分析方法、对冲基金优化问题和风险调整、对冲基金分类和市场风险管理等。《对冲基金建模与分析——基于MATLAB》由浅入深，通过大量图例来帮助读者了解如何运用MATLAB为工具来构建模型分析，可以帮助读者学习操作内置功能并熟悉设计基础的MATLAB在对冲基金领域中的应用。

《对冲基金建模与分析——基于MATLAB》是入门级读物，学生、投资者和想要了解对冲基金的技术人员都能从中获益，也适合有一定基础，想要更系统学习相关内容的人士阅读。

作者介绍:

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
1.5 对冲基金的新产品	15
1.5.1 UCITS III 对冲基金	15
1.5.2 欧洲通行证.....	18
1.5.3 卖空限制.....	18
第2章 对冲基金数据源	20
2.1 对冲基金数据库	21
2.2 主要对冲基金指标	21
2.2.1 非可投资指数和可投资指数.....	22
2.2.2 道琼斯瑞士信贷对冲基金指数.....	24
2.2.3 对冲基金研究公司.....	30
2.2.4 富时对冲.....	34
2.2.5 格林威治替代投资.....	35
2.2.6 晨星替代投资中心.....	38
2.2.7 EDHEC 风险和资产管理研究中心	41
2.3 数据库和指数偏差	42
2.3.1 生存偏差.....	42
2.3.2 瞬时历史偏差.....	44
2.4 基准管理	44
2.4.1 跟踪误差.....	46
第3章 统计分析	48
3.1 基本特性图	49
3.1.1 增值指数.....	49
3.1.2 直方图.....	52

3.2 概率分布	54
3.2.1 总体与样本	55
3.3 概率密度函数	56
3.4 累计分布函数	57
3.5 正态分布	58
3.5.1 标准正态分布	59
3.6 正态性可视化测试	60
3.6.1 检验	60
3.6.2 正态概率图	61
3.7 分布矩	62
3.7.1 期望和标准差	62
3.7.2 偏度	65
3.7.3 峰度	66
3.8 协方差和相关系数	68
3.9 线性回归	72
3.9.1 决定系数	73
3.9.2 残差图	73
3.9.3 Jarque-Bera 检验	78
第4章 均值—方差最优化	82
4.1 投资组合理论	83
4.1.1 均值—方差分析	83
4.1.2 最优化问题	87
4.1.3 夏普比率最大化	93
4.2 有效投资组合	98
第5章 业绩评价	101
5.1 风险调整的理念	102
5.1.1 风险调整后收益	104
5.2 风险调整后的绝对收益指标	107
5.2.1 夏普比率	109
5.2.2 修正夏普比率	110
5.2.3 最大回撤率	112
5.3 市场模型中风险因素调整后收益测度	115
5.3.1 信息比率	116
5.3.2 特雷诺比率	118
5.3.3 Jensen 的 α 值	122
5.3.4 GH1 测度	124
5.3.5 M2 测度	126
5.3.6 GH2 测度	128
5.4 MAR 及LPM 测度	131
5.4.1 Sortino 比率	131
5.4.2 Omega 比率	133
5.4.3 上行潜能比率及排名	135
5.5 多因素资产定价模型的扩展	137
5.5.1 因子的选择	139
第6章 对冲基金的分类	143
6.1 金融工具的基石和投资风格	144
6.2 对冲基金群及其分类	146
6.2.1 测度的定义	147
6.2.2 创建树状图	147
6.2.3 解读树状图	148
第7章 市场风险管理	161
7.1 风险价值	162
7.2 计算VaR 的传统方法	165
7.2.1 历史数据模拟	166

7.2.2 参数方法.....	168
7.2.3 蒙特卡洛模拟.....	170
7.3 调整后的VaR	172
7.4 期望损失	174
7.5 极值理论	180
• • • • • (收起)	

[对冲基金建模与分析——基于MATLAB_下载链接1](#)

标签

量化投资

Matlab

金融

对冲基金

量化

Finance

金融科技

经管

评论

了解一下。

值得反复研读，特别是基金产品的测评与相应的风控

郑志勇还做了不少事啊。

初级入门，技术过时了

适合正在学习投资学、金融学之类课程的学生朋友。虽然很基础，但是写的很清晰。
然而中文翻译实在垃圾，推荐看英文版

翻译的不行很乱，很难读下去

入门级书籍

[对冲基金建模与分析——基于MATLAB 下载链接1](#)

书评

[对冲基金建模与分析——基于MATLAB 下载链接1](#)