

解密对冲基金组合基金 如何承担债市风险、获取股市回报



[解密对冲基金组合基金 如何承担债市风险、获取股市回报_下载链接1](#)

著者:聂军 文芳

出版者:北京大学出版社

出版时间:2018-10

装帧:平装

isbn:9787301299432

对冲基金组合基金 (FOHF) 管理行业的入门书籍。

“书中不仅涵盖了对冲基金的各个策略，还系统性地介绍了组合基金的运作，从投资，运营到风险管理的尽职调查，还包含很多操作层面的具体案例和建议。这本书可以作为开展组合基金业务的投资者的入门指南，也可以为资深的对冲基金投资人提供很好的参考材料。”

作者介绍:

聂军，现任凯思博投资管理（香港）有限公司董事总经理，中国绝对收益投资管理协会创始会长及现任联席会长，海外华人资产管理协会副主席，中国私募投资行业协会副会长。

聂军先生于20世纪90年代进入对冲基金组合基金行业，是最早涉足该业务的华人之一，具有投资全球对冲基金的丰富经验，参与管理过数十亿美元的投资资产。

目录: **部分 对冲基金策略解析

**章 对冲基金的结构

**节 对冲基金的三层结构

第二节 国内私募基金设立中PB “一角独大”

第二章 相关基本概念

**节 收益率、风险和夏普比率

第二节 跌幅、**跌幅及痛苦指数

第三节 做空及做空的风险

第四节 套利

第三章 期权简介

**节 什么是期权

第二节 期权的特征和用途

第三节 常用的期权策略

第四节 期权对冲策略案例

第四章 对冲基金策略概论

**节 对冲基金策略

第二节 策略周期

第五章 对冲基金策略：股市对冲基金策略

**节 股市多/空头策略概论

第二节 股市多/空头策略剖析

第三节 股市多/空头策略的回报及风险来源

第四节 股票市场中性策略

第五节 股票市场中性策略的回报及风险来源

第六节 股市偏空策略

第七节 股市偏空策略的回报及风险来源

第六章 对冲基金策略：事件驱动策略

**节 概论

第二节 并购套利策略

第三节 并购套利策略的回报及风险来源

第四节 特殊情形策略

第五节 特殊情形策略的回报风险及来源

第六节 受压资产策略

第七节 受压资产策略的回报来源

第八节 受压资产策略案例分析

第九节 中国式受压资产策略

第七章 对冲基金策略：相对价值套利策略

**节 概论

- 第二节 可转债套利策略
- 第三节 可转债套利策略的收益及风险特征
- 第四节 可转债套利策略的回报及风险来源
- 第五节 固定收益套利策略
- 第六节 固定收益套利策略的收益及风险特征
- 第七节 固定收益套利策略的回报及风险来源
- 第八章 对冲基金策略：管理期货策略
 - **节 概论
 - 第二节 管理期货策略的收益及风险特征
 - 第三节 管理期货策略的回报及风险来源
 - 第四节 中国市场可期
- 第九章 对冲基金策略：全球宏观策略
 - **节 全球宏观策略
 - 第二节 全球宏观策略的回报来源与风险
 - 第三节 全球宏观策略的风险收益特征
 - 第四节 案例分析
- 第十章 对冲基金策略：新兴市场策略
 - **节 概论
 - 第二节 新兴市场策略的收益及风险特征
 - 第三节 新兴市场策略的回报及风险来源
- 第二部分 对冲基金组合基金
- 第十一章 如何构建对冲基金组合基金（FOHF）
 - **节 FOHF的前世今生
 - 第二节 中国市场FOHF迎来发展良机
 - 第三节 如何构建FOHF
 - 第四节 尽职调查的“三驾马车”
- 第十二章 尽职调查——透彻了解对冲基金的特色
 - **节 尽职调查的目的和挑选对冲基金的四个关键词
 - 第二节 靠排行榜挑选基金不靠谱
 - 第三节 投资*终是人性的体现，兼论风格漂移
 - 第四节 尽职调查“三驾马车”相辅相成，缺一不可
- 第十三章 投资尽职调查——发掘盈利的智慧和技能
 - **节 投资研究团队
 - 第二节 投资理念
 - 第三节 投资技能及特长
 - 第四节 投资流程
 - 第五节 其他
- 第十四章 运营尽职调查——甄别潜在欺诈、识别雷区
 - **节 基金管理公司背景
 - 第二节 公司治理及内部监控
 - 第三节 基金运营团队
 - 第四节 基金
 - 第五节 第三方服务商
- 第十五章 风险管理尽职调查——鉴定投资市场风险因子
 - **节 概论
 - 第二节 风险管理哲学和系统
 - 第三节 风险管理实践流程
 - 第四节 历史风险范畴
- 第十六章 如何运营对冲基金组合基金
 - **节 产品投资指南
 - 第二节 自有数据库
 - 第三节 构建投资组合及仓位调整
 - 第四节 投前、投中、投后的持续监控
 - 第五节 风险管理

第六节 流动性监控
第七节 团队建设
• • • • • ([收起](#))

[解密对冲基金组合基金 如何承担债市风险、获取股市回报_下载链接1](#)

标签

对冲基金

投资

投资理财

finance

评论

“笔者聂军”太自恋了，建议再多写点干货再这么自恋吧。全书都只涉及皮毛，专业和深入的观点太少了，心疼我的钱

入门书籍，对于知道一些唬人的名词还是很有帮助的。

还是一本很不错的FOHF基础入门书籍，不要捧杀。

[解密对冲基金组合基金 如何承担债市风险、获取股市回报_下载链接1](#)

书评

[解密对冲基金组合基金 如何承担债市风险、获取股市回报 下载链接1](#)