

《对冲基金管理人操作守则》

图书基本信息

书名：《对冲基金管理人操作守则》

13位ISBN编号：9787509748978

10位ISBN编号：7509748976

出版时间：2014-1

出版社：社会科学文献出版社

作者：美国管理基金协会

页数：244

译者：张跃文

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介以及在线试读，请支持正版图书。

更多资源请访问：www.tushu000.com

《对冲基金管理人操作守则》

内容概要

基金业在我国金融业中还属于新兴行业，借鉴国外基金业的成功经验，有利于行业的规范和发展。该守则提供了一个基础性规则体系，即可以作为基金管理人进行自我评估的工具，同时也有助于指引和规范基金管理人提高运营管理能力，更好地履行对投资者责任，妥善处理突发的市场事件。本书包括对冲基金业界对2008年金融危机的反思，以及有关国际组织和美国针对对冲基金持续经营所提出的新要求。值得学习和借鉴。

《对冲基金管理人操作守则》

作者简介

张跃文，男，吉林长春人，经济学博士。现任中国社会科学院金融研究所主任、副研究员。曾先后在瑞典斯德哥尔摩经济学院和美国纽约大学斯特恩商学院进行访问研究。主要研究领域为资本市场与公司金融。

《对冲基金管理人操作守则》

书籍目录

引 言 / 001
第一章 信息披露与投资者保护（守则一 ~ 守则十一）
信息披露规则体系 / 003
发行文件中的重要信息披露 / 004
对投资者的责任 / 010
潜在利益冲突——个别协议和平行管理账户 / 017
投资者的参与 / 020
面向对手方的信息披露 / 021
第二章 估值（守则十二 ~ 守则二十三）
估值框架 / 025
估值治理机制 / 026
估值规则的执行 / 030
估值规程 / 031
第三章 风险管理框架（守则二十四 ~ 守则四十五）
风险管理框架 / 041
对冲基金管理人风险管理的总体方法 / 042
风险类别 / 047
第四章 交易与业务运作（守则四十六 ~ 守则六十一）
交易与业务运作框架 / 063
对手方 / 065
现金、保证金和抵押品管理 / 068
关键服务提供商的选择和监控 / 070
核心基础设施和操作准则 / 071
其他基础设施和操作规范 / 073
核心会计流程 / 077
核心信息技术流程 / 079
第五章 合规，冲突与业务运作框架（守则六十二 ~ 守则七十五）
合规，冲突与业务运作框架 / 083
合规文化 / 084
道德准则 / 085
合规手册 / 088
合规职能 / 097
第六章 反洗钱（守则七十六 ~ 守则八十八）
反洗钱框架 / 105
高级管理人员 / 106
投资者甄别规程 / 108
高风险投资者 / 113
受限投资者 / 116
基于风险的投资者监督 / 118
可疑行为报告 / 122
OFAC合规 / 124
第三方对反洗钱程序的执行 / 125
额外的《银行保密法》要求 / 132
员工培训计划 / 133
独立审计 / 134
记录留存 / 135
第七章 业务持续性 / 灾难恢复原则（守则八十九 ~ 守则九十九）

《对冲基金管理人操作守则》

总体原则 / 139

应急计划，危机管理和灾难恢复 / 148

附件

附件一 关于对冲基金管理人风险监控操作的补充信息 / 157

概述：对冲基金管理人所面对的风险 / 159

市场风险 / 165

资金流动性风险 / 179

杠杆 / 186

对手方信用风险 / 198

附件二 对冲基金投资者尽职调查问卷样本 / 200

关于MFA / 201

投资管理人概览 / 202

.业务持续性 / 207

.投资管理人行为概览 / 207

.基金信息 / 208

《对冲基金管理人操作守则》

精彩短评

1、进入新世纪以来，全球金融市场整合步伐加快，资本市场、货币市场、大宗商品市场、衍生品市场和外汇市场的规模迅速扩大，证券品种、投资工具的数量呈几何级数增加。这本书对我们很有帮助。

《对冲基金管理人操作守则》

精彩书评

- 1、书的内容不错，有阅读价值，比国内的无聊的“作家”、“误导砖家”写的书好多了。中国虽然没有成型的对冲基金行业，但国内越来越多的私募基金实际上已经具备了对冲基金的雏形，随着国内金融市场的迅速发育和对外开放，特别是金融衍生产品的不断推出以及融资融券业务的开展，国内金融市场正在变得越来越适合对冲基金生存。所以，称本书是一本教科书并不为过。
- 2、作为新兴行业的基金业，如何以拿来主义的方式借鉴国外成功经验，是当前一个迫切需要解决的问题。该书即是解决这一问题的典范之作。它以七章的内容，为我们提供了一个基金管理人进行自我评估的工具，同时还提供了指引和规范基金管理人提高运营管理能力、更好地履行对投资者责任的范本。值得我们每一个专业人士和对对冲基金感兴趣的人士的阅读和借鉴。
- 3、本书提供了一个基础性规则体系，有助于基金管理人提高运营管理能力，妥善处理突发的市场事件。借鉴国外基金业的成功经验，有利于我国基金行业的规范和发展。特别是对冲基金业界对2008年金融危机的反思，以及有关国际组织针对对冲基金持续经营所提出的新要求。值得我国基金业的学习。
- 4、本书从投资者保护、估值、交易与业务运作、反洗钱和业务持续性等方面，提出了对冲基金管理人在设计基金运作框架和处理具体业务时所应当遵守的基本准则。从本书中可以学到美国管理基金协会的经验，对于我国相关领域的从业者来说，具有重要的参考价值，同时对于规范基金管理者的行为，以及提高防范风险的能力也有一定的借鉴意义。
- 5、对冲基金到底是什么？并不是每个人都能说清楚这个问题。这本书最吸引人的地方在于，用“99条军规”这样看似一目了然的广告吸引人，但是真正购买之后发现并没有明确的从1到99这“99条军规”。而且，毕竟是翻译的图书，有的地方感觉看不太明白。
- 6、美国人虽然有这个军规，还是发生了次贷危机，所以充分说明，人的智慧是无穷的，人可以创造军规，也一定能够绕开军规。所以，还是普通法好啊，因为有了普通法，很多情况你绕不开，因为这是常识有关的法律。

《对冲基金管理人操作守则》

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:www.tushu000.com