

《对冲基金VBA和EXCAL建模分析》

图书基本信息

书名：《对冲基金VBA和EXCAL建模分析》

13位ISBN编号：97871111484177

出版时间：2014-11

作者：保罗·达比希尔,戴维·汉普顿

页数：207

译者：张平平,郑磊

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VBA和EXCAL建模分析》

内容概要

从20世纪90年代索罗斯大受欢迎开始，对冲基金已经从金融市场的一个模糊狭小的利基市场成长为资产管理行业的主要角色，管理规模约有亿美元。在2008年全球金融崩溃之后，以及另一个潜在的、更糟的危机隐约出现之前，基金经理为满足客户对回报的预期所面临的挑战正在变得空前艰巨。为了在当今异常动荡、高风险和不确定的金融市场中生存下来，基金经理、风险分析师和精明的投资者需要充分了解最佳建模和分析技术。《对冲基金VBA和EXCEL建模分析》提供了具体的方法。

本书由两位对冲基金和资产管理行业受人尊重的作者合著，这本应用导向的指南告诉你如何运用学术界和业界最常用的分析工具与技术，理解、识别、管理风险和对一些关键投资策略的回报因子进行量化分析。这本书也适合作为对冲基金和另类投资专业研究生教材。

本书以行业综述开篇，讲述了对冲基金主要类型，以及对冲基金经理最常用到的投资策略。接着讲授了一种关于主要信息来源的重要评估方法，括主要的商业对冲基金数据库，以及由其生产的指数和基准指标。作者指出了每个数据来源的局限性和内在缺陷，在解释和使用综合数据时指明了其中的常见问题与缺点。

这本书提供了对冲基金业绩测量和建模的可视化与理论方法，特别强调了风险调整表现指标和技术，也详细讲述了一系列复杂的风险分析模型和风险管理策略。本书提供了相应的EXCEL和VBA示例及有益于帮助掌握方法的练习题。

《对冲基金VBA和EXCAL建模分析》

作者简介

保罗·达比希尔

在伦敦国王学院获得理论物理学博士学位后，开始在汇丰银行的衍生品和结构产品部门担任量化分析师和交易员。之后他参与了全球几家主要银行一系列交易和风险管理平台的研发与应用。最近几年保罗负责牛津大学行为金融模型研发中的算法设计和分析工作。保罗也为许多私募股权机构、对冲基金和资产管理公提供动态组合优化、交易平台设计、软件工程和风险管理咨询服务。

戴维·汉普顿

从贝尔法斯特皇后大学取得电气工程学博士学位，在加入美洲银行伦敦资本市场部之前，曾在巴黎、纽约和东京接受高等管理学院国际MBA教育。戴维此前在索菲亚安提波利斯SKEMA商学院担任金融学客座教授，为硕士研究生讲授金融工程和EXCEL/VBA编程。在尼斯EDHEC商学院，他曾担任金融经济学专业副主任，负责管理5门理学硕士课程。作为CTA注册的NFA，戴维一直是对冲基金界活跃的顾问师和对冲基金经理，他擅长全球宏观管理期货和多空股权投资。

两位作者是达比希尔-汉普顿公董事。该公是一家专精于对冲基金和另类投资的创新量化研究、咨询和顾问机构。

书籍目录

前言

第1章 对冲基金行业

- 1.1 什么是对冲基金
- 1.2 对冲基金结构
- 1.3 全球对冲基金行业
- 1.4 专业投资技巧
- 1.5 对冲基金的最新发展

第2章 对冲基金的主要策略

- 2.1 单一及多策略对冲基金
- 2.2 对冲基金母基金
- 2.3 对冲基金策略

第3章 对冲基金数据源

- 3.1 对冲基金数据库
- 3.2 主要对冲基金指数
- 3.3 数据库和指数偏差
- 3.4 基准

附录3A 权重分配方式

第4章 统计分析

- 4.1 基本的绩效指标
- 4.2 概率分布
- 4.3 概率密度函数
- 4.4 累积分布函数
- 4.5 正态分布
- 4.6 正态的可视化检验
- 4.7 分布的统计量
- 4.8 几何布朗运动
- 4.9 协方差和相关性
- 4.10 回归分析
- 4.11 投资组合理论

第5章 风险调整收益指标

- 5.1 风险调整收益背后的理念
- 5.2 常见风险调整业绩比率
- 5.3 存在市场基准情况下的常用业绩衡量方法
- 5.4 欧茄比率

第6章 资产定价模型

- 6.1 经过风险调整的二阶矩资产定价模型
- 6.2 多因子模型
- 6.3 因子的选择
- 6.4 动态的回报率分析
- 6.5 马科维茨风险调整评估法

第7章 对冲基金市场风险管理

- 7.1 风险价值
- 7.2 传统计算方法
- 7.3 改进VaR
- 7.4 预期损失
- 7.5 极值理论

参考文献

《对冲基金VBA和EXCAL建模分析》

精彩短评

- 1、非常实用的一本书，针对对冲基金业绩分析。许多内容实际上本科就可以讲，金融基础和统计基础先修课程后都有了。我大学时候上海财大的计算机应用课是很不错的，但是偏管理应用，像这样的金融应用其实应该加进去。原书用的是VBA，但是很多改用excel的公式也能解决，相关实例可以改写之。
- 2、不错，重要的是思想、策略和方法，数学不难。

《对冲基金VBA和EXCAL建模分析》

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