
目录:

第1篇 对冲基金简介	
第1章 对冲基金概况	2
1.1 什么是对冲基金	2
1.2 自营交易	4
1.3 目前对冲基金的主要特点	5
1.4 资本容量	7
1.5 佣金	8
1.6 对冲基金行业业绩概况	8
1.7 对冲基金经理	11
1.8 阿尔法和贝塔	12
1.9 投资策略	13
1.10 探索者和边界	15
1.11 SEC 的警觉	16
1.12 业绩持续性考虑	16
1.13 资本和业绩持续性	17
1.14 能力还是机会	18
1.15 避免损失的重要性	18
1.16 长期投资下的年收益率递减	19
1.17 案例：一个对冲基金的创立	20
1.18 对冲基金运作及服务提供商	20
1.19 规模及收益	21
1.20 世界前十大对冲基金	24
第2章 国内对冲基金发展	25
2.1 中国基金对冲时代	25
2.2 对冲基金投资应用	29
2.3 对冲基金面临的挑战	39
第2篇 对冲基金分类体系概要	

第3章 对冲基金现况	48
3.1 对冲基金分类内涵	48
3.2 HFR 对冲基金分类体系	49
3.3 MSCI 对冲基金分类体系	60
第4章 对冲基金分类研究	64
4.1 国内外对冲基金分类现况	64
4.2 中国对冲基金分类体系构建	66
第3篇 对冲基金策略分类体系	
第5章 股票多空仓策略	74
5.1 股票多空仓策略概况	74
5.2 股票多空仓策略体系	77
5.3 著名股票投资基金：老虎基金	81
第6章 全球宏观策略	84
6.1 全球宏观策略概述	84
6.2 全球宏观对冲基金新特征	89
6.3 全球宏观对冲基金投资策略分析	91
6.4 全球宏观投资绩效分析	95
第7章 事件驱动策略	99
7.1 事件驱动策略概况	99
7.2 事件驱动策略体系	102
7.3 次贷危机中的大赢家：保尔森对冲基金	103
7.4 事件驱动策略全球表现	105
第8章 管理期货 CTA 策略	108
8.1 管理期货基金概述	108
8.2 管理期货 CTA 运作流程	111
8.3 管理期货 CTA 基金投资策略分析	114
8.4 管理期货 CTA 基金的绩效分析	118
8.5 管理期货 CTA 基金在国内的发展	121

第9章 相对价值策略	124
9.1 相对价值策略概况	124
9.2 华尔街最牛对冲基金：大奖章基金	125
9.3 相对价值策略体系	126
第10章 对冲基金的基金	153
10.1 FOF 策略概述	153
10.2 FOF 投资管理体系	157
10.3 FOF 国内发展状况	161
10.4 国内 FOF 发展建议	164
第11章 行业对冲基金	167
11.1 行业基金简述	167
11.2 海外行业基金	168
11.3 国内行业基金	174
11.4 我国行业基金面临的问题	178
第4篇 对冲基金指数研究与实践	
第12章 对冲基金指数概述	182
12.1 对冲基金指数内涵	182
12.2 对冲基金指数类型	183
12.3 对冲基金指数数据库	184
第13章 对冲基金指数发展	188
13.1 对冲基金指数发展现况	188
13.2 新兴可投资对冲基金指数	189
13.3 CSFB/Tronment 可投资对冲基金指数	190
13.4 可投资对冲基金指数业绩的比较	193
13.5 HFR 公司研究	193
13.6 我国对冲基金指数的发展	199
第14章 对冲基金指数编制及维护	201
14.1 对冲基金指数结构	201

14.2	对冲基金指数计算	203
14.3	HFRI 对冲基金指数编制	207
14.4	对冲基金指数维护	214
第 15 章 国内对冲基金指数介绍与比较 217		
15.1	国内四大对冲基金指数	217
15.2	对冲基金指数分析比较	224
第 16 章 对冲基金指数体系构建研究 230		
16.1	对冲基金指数编制方法	230
16.2	中国对冲基金指数体系	233
16.3	基准指数与区域指数	235
16.4	可投资对冲基金指数	236
第 5 篇 对冲基金评价研究与实践		
第 17 章 对冲基金评价概况 240		
17.1	概念和特征	240
17.2	相关性与回归分析	242
17.3	尾部风险分析	243
17.4	对冲基金历史绩效表现	244
17.5	对冲基金绩效现状	246
第 18 章 基金业绩评价方法 250		
18.1	经典业绩评价方法	250
18.2	VaR 业绩评价方法	252
第 19 章 国内私募业绩评价现状 254		
19.1	晨星私募基金业绩评价	254
19.2	融智与好买绩效评价	257
19.3	兴业信托·朝阳永续私募绩效评价	258
第 20 章 国内主要基金评级体系比较 260		
20.1	基本评级因素	261
20.2	风险调整收益	262

第 21 章 对冲基金评级体系构建研究	266
21.1 对冲基金评级体系概要	266
21.2 业绩评价指标体系	267
21.3 业绩评价指标算法	269
21.4 业绩评价方法	272
附录 A HFR 交易策略分类	275
附录 B HFR 投资区域分类	276
附录 C HFR 对冲基金指数结构	277
附录 D MSCI 对冲基金指数结构	278
附录 E 对冲网“基于策略分类的对冲基金指数与评级体系”	279