

<<货币外包>>

图书基本信息

书名：<<货币外包>>

13位ISBN编号：9787300114002

10位ISBN编号：7300114008

出版时间：2010-1

出版时间：中国人民大学出版社

作者：尼尔·雷科德

页数：341

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：<http://www.tushu007.com>

<<货币外包>>

内容概要

货币外包是与机构投资组合的国际分散化并行发展起来的。

《货币外包》的许多分析是从基本原理开始。

对于重要的概念，在使用前就进行详尽解释，以便不具有该主题预备知识的读者独立做出判断。

《货币外包》包括下述主题：消除国际资产组合的货币风险的理论知识；资产收益和货币收益之间的相互影响，以及它对对冲决策的影响；基准的构建和策略作用；最低成本的被动外包；货币市场的结构和“无效情形”；主动外包风格；有约束和无约束（货币的主动外包）。

《货币外包》的目标读者群体是感兴趣的资产管理人，养老基金管理人、投资顾问，托管人或研究者。

<<货币外包>>

作者简介

尼尔·雷科德，货币外包管理人。

他在牛津大学和伦敦大学接受大学教育，在职业生涯的早期阶段，他是英格兰银行（Bank of England）的一名经济学家。

1983年，他成立了Record货币（原来是财务）管理公司（Record Currency（formerly Treasury）Management），目前他已经主持和管理这个公司20年。

他被公认为是货币外包业的一位领军人物。

他撰写了许多关于货币和相关主题的文章，是剑桥Judge学院（Judge Institute in Cambridge）MBA的外聘教员。

<<货币外包>>

书籍目录

第1章 导言 1—1 投资学背景知识第2章 问题 2—1 资产与负债评估、波动率和偿付能力 2—2 养老基金
跨境资产组合投资的历史 2—3 货币波动率 2—4 公司在跨境投资中的相似性第3章 货币对冲 3—1 可用
工具 3—2 期权定价 3—3 布莱克—斯科尔斯模型 3—4 货币期权定价理论的历史 3—5 利率和远期汇率
3—6 货币意外第4章 外汇市场——历史和结构 4—1 外汇市场简史及外汇工具的发展变化 4—2 基本结
构 4—3 客户的类别 4—4 实体和监管问题第5章 国际资产组合的货币对冲理论 5—1 对数正态随机游走
收益率 5—2 “免费午餐” 5—3 对冲与有效边界 5—4 交易成本的含义第6章 被动货币外包 6—1 机制 6
—2 再平衡 6—3 现金流 6—4 成本 6—5 成本附言——利益冲突第7章 货币外包基准 7—1 什么是货币
基准？
7—2 供投资性 7—3 设计 7—4 当前实践 7—5 处理过的例子 7—6 跟踪误差第8章 外包不同类型的资产
8—1 股权 8—2 对冲比率 8—3 债券 8—4 动产 8—5 其他种类的资产第9章 货币市场有效吗？
9—1 无效的种类 9—2 货币市场无效的实例 9—3 中期趋势的经验证据 9—4 远期汇率偏差——另一种
无效情形 9—5 一个成功的总体？
9—6 无效情形的证据概要第10章 主动货币外包——管理风格 10—1 问题 10—2 建模与预测 10—3 主
动管理的风格第11章 主动货币外包——业绩证据 11—1 调查 11—2 谁受损失？
第12章 实施货币外包 12—1 简明的核对表 12—2 实际问题与答案第13章 展望未来 13—1 主动管理风格
的发展 13—2 外包管理人的自然选择 13—3 扩展对冲工具的范围 13—4 无效情形会增加还是会缩减？
参考文献附录 附录1——远期套利的边界条件 附录2——对数正态收益率 附录3——AIMR报告 附录4
——投资指导原则范例译后记

<<货币外包>>

编辑推荐

货币风险管理对有效资产组合管理非常重要。

尼尔·雷科德是这个领域公认的专家。

这《货币外包》全面、及时，并且非常必要。

——Paul Myners，英国2001 HM Treasury Review of Institutional Investment的作者 这《货币外包》非常独特，因为它包括货币外包的很多不同方面，从基准到管理风格再到实施。

尼尔·雷科德把理论和实例很好地结合起来，使这个非常复杂的领域变得容易理解。

这《货币外包》一定会引起广大投资行业专业人士的兴趣。

——James Mitchell，Frank Russell公司高级研究分析师 尼尔-雷科德肯定可以被称为货币外包管理的倡导者，并且利用在这个领域数十年的经验，撰写了这本全面权威的著作，该著作实际上囊括了这个主题值得了解的一切内容，可读性强。

我把这本著作强烈推荐给所有处理国际投资的机构投资者和投资顾问。

——Bill Muysken，Mercer投资咨询公司全球研究部负责人

<<货币外包>>

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:<http://www.tushu007.com>