

<<商品交易顾问>>

图书基本信息

书名：<<商品交易顾问>>

13位ISBN编号：9787810988483

10位ISBN编号：7810988484

出版时间：2007-8

出版时间：上海财经大学出版社

作者：格雷格·格雷戈里乌

页数：449

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>

## &lt;&lt;商品交易顾问&gt;&gt;

## 内容概要

商品交易顾问 (commodity trading advisor, CTA) 是一个历史称谓, 最初代指交易商品期货的投资顾问和商品投资基金 (commodity pool); 而今在期货投资领域, 已经全面代指交易商品, 或 (和) 交易金融衍生产品的投资顾问 (trading advisor, TA) 以及以商品期货或 (和) 金融衍生产品为投资对象的期货投资基金 (futures fund), 亦即管理型期货 (managed futures)。

因此, 尽管本书的书名为《商品交易顾问——风险、业绩分析与选择》, 但《期货投资基金——风险、业绩分析与选择》一名也许更能让广大中国读者明了其全面宗旨和真实内涵。

? 期货投资基金的兴起也许是进入21世纪以来最有影响意义的金融现象之一。

传统上被归于“另类投资”的期货投资基金, 在日益进入主流机构投资者的资产配置序列之际, 也越来越多地受到主流研究方法的检验, 其神秘面纱正在揭去。

《商品交易顾问——风险、业绩分析与选择》正是一本为我们廓清期货投资基金关键认识的权威论文集。

本书的高度在于, 用主流研究方法和大量的数据, 检验了期货投资基金领域许多颇具争议的议题, 对期货投资基金的实践与管理进行了诸多理论精炼和总结。

对于尚处于起步阶段的中国期货界的管理者和投资者而言, 本书尤其为我们提供了宽阔的视野和深邃的思路, 值得我们仔细研读。

## 书籍目录

总序译者前言序前言致谢第一篇 业绩第一章 管理型期货和对冲基金：天作之合引言管理型期货数据股票、债券，加对冲基金或者管理型期货对冲基金加上管理型期货股票、债券、对冲基金和管理型期货管理型期货造成的偏度下降结论第二章 基准CTAs业绩第三章 管理型期货业绩：持续性和收益来源第四章 CTA业绩、存活性偏误和解散频率第五章 运用数据包络分析的CTA业绩评价第六章 市场条件变化中的CTAs业绩第七章 使用数据包络分析的CTAs单一效率和交叉效率第二篇 风险和管理型期货投资第八章 大型对冲基金和CTA交易对期货市场波动率的影响第九章 测度管理型期货的买入波动率策略第十章 管理型期货风险测度方法之间的相互依赖性第十一章 使用三种另类资产管理收益分布中的下跌风险第三篇 管理型期货：投资、佣金与监管第十二章 管理型期货的投资第十三章 管理和激励佣金对CTA业绩的影响：一个注解第十四章 管理型期货基金以及其他信托产品：澳大利亚监管模式第四篇 计划评估、选择和收益第十五章 如何设计商品期货交易计划第十六章 选择合适的CTA：一个或有要求权方法第十七章 CTA与资产组合分散化：时间性研究第十八章 CTA收益的随机游走行为第十九章 收益增进的CTA分散化策略第二十章 将CTA纳入资产配置流程：一个均值修正的风险价值框架第二十一章 CTA收益的ARMA模型第二十二章 CTAs的风险调整后收益：使用修正的夏普比率第二十三章 管理型期货的时间分散功能参考文献

#### 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>