

## فهرست



پیش گفتار.....	۸
<b>فصل اول: آشنایی با صندوق های پوشش ریسک.....</b>	<b>۱۱</b>
۱-۱- چرا این کتاب نوشته شد؟.....	۱۱
۲-۱- اهمیت و ضرورت صندوق های پوششی.....	۱۲
۳-۱- اهداف کتاب.....	۱۲
۴-۱- سؤالاتی که پاسخ داده می شوند.....	۱۳
۵-۱- صندوق پوشش ریسک چیست؟.....	۱۳
۱-۵-۱- واژه شناسی.....	۱۵
۲-۵-۱- تاریخچه.....	۱۵
۳-۵-۱- استراتژی های صندوق های پوشش ریسک.....	۱۶
۴-۵-۱- تفاوت صندوق های پوششی با سایر نهادهای سرمایه گذاری.....	۲۲
۶-۱- روش مورد نظر کتاب.....	۲۳
۷-۱- کاربرد متصور از کتاب.....	۲۵
<b>فصل دوم: ادبیات علمی صندوق های پوششی.....</b>	<b>۲۷</b>
۱-۲- مبانی نظری.....	۲۷
۱-۱-۲- مفهوم ریسک.....	۲۷
۲-۱-۲- فرضیه ی بازار کارآ.....	۳۳
۳-۱-۲- نظریه ی مدرن پرتفو.....	۳۴
۴-۱-۲- مدل قیمت گذاری دارایی های سرمایه ای.....	۳۸
۵-۱-۲- فرضیه ی بازار فراکتالی.....	۴۱
۶-۱-۲- نظریه ی عمومی بازتاب.....	۴۱
۷-۱-۲- مدل سه عاملی فاما-فرنچ (3FFF).....	۴۳

۴۵.....	۲-۲- مطالعات پیشین.....
۴۷.....	فصل سوم: روش بررسی صندوق‌ها.....
۴۷.....	۱-۳- بوم مدل کسب و کار.....
۵۴.....	۲-۳- روش متاسنتر.....
۵۵.....	۱-۲-۳- بررسی روایی با ابزارهای ارزیابی اساسی.....
۵۷.....	۲-۲-۳- استخراج مدل.....
۵۹.....	۳-۳- نگاهی آماری به صندوق‌ها.....
۶۱.....	فصل چهارم: تحلیل صندوق‌های پوششی.....
۶۱.....	۱-۴- بررسی مدل صندوق‌های پوششی موفق.....
۶۱.....	۱-۱-۴- همکاران بریج واتر (ری دالیو).....
۷۱.....	۲-۱-۴- رنسانس تکنولوژی (جیمز سیمونز).....
۷۸.....	۳-۱-۴- مدیریت صندوق سوروس (جورج سوروس).....
۸۳.....	۴-۱-۴- مدیریت میلینیوم (اسرائیل انگلاند).....
۸۶.....	۵-۱-۴- شرکت مدیریتی الیوت (پاول سینگر).....
۸۸.....	۶-۱-۴- مدیریت آپالوسا (دیوید تپر).....
۹۲.....	۷-۱-۴- مدیریت دارایی نقطه‌ی ۷۲ (استیون کوهن).....
۹۵.....	۸-۱-۴- گروه بائوپست (ست کلارمن).....
۱۰۱.....	۹-۱-۴- مدیریت سرمایه‌ی میدان پرشینگ (بیل اکمن).....
۱۰۵.....	۱۰-۱-۴- گرین لایت کاپیتال (دیوید انهورن).....
۱۰۷.....	۱۱-۱-۴- لون پاین کاپیتال (استفن ماندل).....
۱۰۸.....	۱۲-۱-۴- مدیریت سرمایه‌گذاری های بریج (گلن دوپین).....
۱۱۰.....	۱۳-۱-۴- ای کیو آر کاپیتال (کالیف اسنس).....
۱۱۵.....	۱۴-۱-۴- مدیریت سرمایه‌ی اسکولپتور (دانیل اوخ).....
۱۱۸.....	۱۵-۱-۴- مدیریت سرمایه‌گذاری بلوکرست (میکایل پلات).....
۱۲۲.....	۱۶-۱-۴- مدیریت سرمایه‌گذاری یورک (جیمز دینان).....

- ۱۷-۱-۴- مدیریت سرمایه‌گذاری کاپولا (یان هو)..... ۱۲۳
- ۱۸-۱-۴- مشاوران سرمایه‌ی کانپون (جوشوا فریدمن)..... ۱۲۵
- ۱۹-۱-۴- سرمایه‌گذاران جهانی وایکینگ (اوله هالورسون)..... ۱۲۶
- ۲۰-۱-۴- دو سیگما (جان آوردک)..... ۱۲۷
- ۲۱-۱-۴- فارالون کاپیتال (تام استایر)..... ۱۳۰
- ۲۲-۱-۴- پاولسون و همکاران (جان پاولسون)..... ۱۳۳
- ۲۳-۱-۴- شاو و همکاران (دیوید شاو)..... ۱۴۰
- ۲۴-۱-۴- سیتادل (کنت گریفین)..... ۱۴۵
- ۲-۴- سایر صندوق‌های پوششی بررسی شده..... ۱۵۱
- ۱-۲-۴- مدیریت سرمایه‌ی بلندمدت (جان مریوتر)..... ۱۵۱
- ۲-۲-۴- مدیریت سرمایه‌ی دیویدسون کمپنر (ماروین دیویدسون)..... ۱۵۳
- ۳-۲-۴- شرکت مدیریتی ولینگتون (والتر مورگان)..... ۱۵۵
- ۳-۴- سایر صندوق‌های پوششی معروف جهان..... ۱۵۷
- ۴-۴- نتایج آنتروپی برای وزن‌دهی به متغیرهای کمی..... ۱۵۸
- ۵-۴- اثر متغیرهای کیفی بر صندوق‌های پوشش ریسک..... ۱۶۱
- ۱-۵-۴- اثر تابعیت و محل دفتر بر دارایی‌های تحت مدیریت..... ۱۶۱
- ۲-۵-۴- اثر تحصیلات بر نرخ رشد دارایی‌های تحت مدیریت..... ۱۶۲

#### فصل پنجم: مدل صندوق‌های پوششی..... ۱۶۵

- ۱-۵- بوم مدل کسب‌وکار صندوق پوشش ریسک..... ۱۶۵
- ۱-۱-۵- شرکای کلیدی..... ۱۶۷
- ۲-۱-۵- فعالیت‌های کلیدی..... ۱۷۳
- ۳-۱-۵- منابع کلیدی..... ۱۸۵
- ۴-۱-۵- ارزش پیشنهادی..... ۱۹۹
- ۵-۱-۵- روابط با مشتریان..... ۲۱۶
- ۶-۱-۵- کانال‌ها..... ۲۱۷

- ۲۱۸.....بخش‌بندی مشتریان ۷-۱-۵
- ۲۲۱.....جریان‌های درآمدی ۸-۱-۵
- ۲۲۲.....ساختار هزینه ۹-۱-۵
- ۲۲۴.....دسته‌بندی صندوق‌های پوششی با ماتریس فاصله ۲-۵
- ۲۲۵.....نقشه‌ی کدهای صندوق‌های پوششی ۳-۵
- ۲۲۶.....جمع‌بندی ۴-۵
- ۲۲۶.....ارزش‌آیجادی کسب‌وکار پوشش ریسک ۱-۴-۵
- ۲۲۸.....نحوه‌ی ایجاد ارزش پوشش ریسک ۲-۴-۵
- ۲۲۹.....نحوه‌ی تبدیل ارزش پوشش ریسک به درآمد پولی ۳-۴-۵
- ۲۳۱.....پایداری و بقای کسب‌وکار پوشش ریسک ۴-۴-۵
- ۲۳۲.....پیشنهادات برای کسب‌وکار پوشش ریسک در ایران ۵-۵
- ۲۳۵.....منابع