

<<玩转ETF基金>>

图书基本信息

书名：<<玩转ETF基金>>

13位ISBN编号：9787508620336

10位ISBN编号：750862033X

出版时间：2010-5

出版时间：中信出版社

作者：理查德 A.费里

页数：331

译者：熊鹏 曹建海

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>

## <<玩转ETF基金>>

### 前言

当今最热门的个人理财投资话题，莫过于交易所交易指数基金（Exchange-Traded Fund，ETF）。坚定不移地走被动投资路线的人们，酷爱通过ETF投资可以享受到的低成本和多样化；交易员和执著于市场时机的人们，热衷的是交易日当天进行频繁买卖交易的能力，他们希望有越来越多的高度专业化产品的推出，并以此来执行比以往任何时候都要高深得多的投资策略；就连采用主动投资策略的管理者也不甘寂寞，用ETF来实现现金仓位的“证券化”，同时憧憬着运用主动管理策略的ETF遍地开花的未来。

ETF基金享受着史无前例的礼遇

## <<玩转ETF基金>>

### 内容概要

《玩转ETF基金》于2007年首次面世，当时立刻成为关于ETF基金前沿信息的主要来源，而且至今没有遇到一个对手能与之媲美。

最新版向读者介绍了关于不同ETF类型的最新见解，如何甄选、管理ETF的实用指导意见，以及ETF的方方面面。

要想成为一个运筹帷幄的投资者，就必须知道ETF的独特之处，知道ETF是如何运作的，知道哪些基金可能有助于实现投资目标。

最新版将提供给你在制定必胜投资策略中所需要的一切，让你未来赚得钵满盆满！

## <<玩转ETF基金>>

### 作者简介

理查德·A·费里

注册金融分析师、投资组合解决方案有限公司 (Portfolio Solutions,LLC.) 创始人。

之前撰写过四部有关低成本投资的著述，拥有罗德岛大学工商管理学士学位、沃尔什学院金融学硕士学位。

曾在华尔街大公司工作过10年，1999年创建了投资组合解决方案公司。

该公司利用ETF和其他指数基金管理着10亿美元资产，其客户包括个人、非营利机构和公司养老金计划。

## &lt;&lt;玩转ETF基金&gt;&gt;

## 书籍目录

序 前言 第一部分 ETF基金入门 第一章 ETF基金的过去、现在和未来 成长中的ETF行业  
 共同基金的简史 ETF的未来 小结 第二章 解读ETF基金 像基金一样运行却像股票一样  
 交易 封闭式基金的难题 ETF如何解决麻烦 小结 第三章 交易所交易产品的类别  
 交易所交易产品的世界 汇总交易所交易投资组合 小结 第四章 投资ETF基金的优劣  
 ETF基金的优势 ETF基金的劣势 ETF的特征指南 小结 第五章 主动型ETF基金  
 主动管理型ETF的先行者 不同于主动型开放式基金 主动管理型ETF的优势 主动管理型ETF  
 的劣势 小结 第二部分 证券投资指数的原理和方法 第六章 基准指数和策略指数 基准指  
 数的定义 策略指数的定义 什么是好的基准指数？  
 详解基准指数 详解策略指数 关于指数的不同看法 小结 第七章 指数构造方法图  
 指数必须遵守规则 指数构造方法图 基准指数和策略指数 小结 第八章 成份股筛  
 选 成份证券选择方法类型 被动选股 过滤选股 数量选股 找出恰当的选股方法  
 小结 第九章 指数的权重确定方法 市值加权 基本面加权 固定权重 非市值权重  
 策略和风格倾向 小结 第三部分 投资者如何挑选不同风格的ETF基金？  
 第十章 美国基准指数基金和风格ETF基金 整体市场基准指数和风格指数 基准指数ETF基  
 金 美国股票型策略指数ETF基金 美国基准和风格ETF基金示例 小结 第十一章 全球股  
 票型ETF基金 国际化投资的优势 国际化投资的劣势 主要的国际和全球市场指数 国际  
 交易指数 小结 第十二章 部门和行业ETF基金 行业ETF的发展 部门和行业划分 交  
 易型行业指数 房地产投资信托（REIT）ETF 行业ETF的部分列表 小结 第十三章 特  
 色ETF基金 主题投资 主动管理型指数 杠杆和空头ETF基金 用ETF基金对冲风险  
 特色ETF基金列表 小结 第十四章 固定收益ETF基金 债券市场结构 国债指数 房屋  
 抵押贷款 资产担保证券 投资级公司债券 高收益公司债券 综合指数 巴克莱综合  
 债券指数 市政债券ETF 国际性固定收益ETF 优先股ETF 固定收益ETF清单 小结  
 第十五章 商品和货币ETF基金 商品基础知识 商品ETF 商品指数 新基金的进展  
 商品ETF的缺点 货币 期货ETF的未来 商品和货币基金清单 小结 第四部分 运用ETF  
 基金进行投资组合管理 第十六章 组合管理策略概述 被动投资 生命周期投资 主动投  
 资 特殊投资组合 ETF基金投资禁忌 小结 第十七章 被动投资管理 买入、持有、再  
 平衡 核心/探测策略 被动投资组合的实际收益 预测 小结 第十八章 生命周期投资  
 管理 生命周期模型 人生各阶段的ETF基金投资组合 小结 第十九章 主动投资管理  
 名义收益与风险调整收益 自上而下策略 自下而上分析 动能投资 技术分析 切记  
 谨慎 小结 第二十章 特殊投资组合管理 ETF独一无二的特征 用ETF来降低行业风险  
 配对交易和市场中性策略 货币对冲和投机 税负亏损收益 未来ETF策略 小结 第二  
 十一章 ETF基金投资技巧 挑选托管机构的选择 ETF交易份额 资产位置安排 ETF再平  
 衡 聘用投资经理 小结 附录A 指数构成方法图缩略语清单 附录B ETF资源列表

## <<玩转ETF基金>>

### 章节摘录

ETF可以像股票一样在交易所进行交易。

与股票不同的是，ETF的股份总数可每天发生变化，这是由于ETF在不断地发行新股或赎回旧股。ETF公司持续发行或赎回旧股的能力，使得ETF的股份价格与ETF的成份证券价值趋于一致。一种套利机制保证了ETF股份价格与ETF成份证券的资产净值不会有较大的差别。

本章内容涵盖了ETF背后的运作和管理过程，以及使ETF市场有效运行的重要市场参与者。本章内容也涵盖了ETF股份的发行与赎回过程、股份在交易所的交易过程以及ETF行业所使用的产品标志符号。

本章浓缩了大量有用信息

## <<玩转ETF基金>>

### 媒体关注与评论

“在《ETF手册》中，理查德阐述了ETF的方方面面、指数创建的微妙细节，甚至是根据ETF制定财务方案的各种策略。

他甚至更进一步，针对这些新的载体建议了一种创新型分类和思维方式。

总而言之，他为大家完成了所有难活、苦活和背景调查工作，以便投资者带着一肚子知识踏入这一激动人心的新天地。摘自星晨集团董事总经理唐·菲利普斯为本书所作“序言”。“《ETF手册》是理解交易所交易指数基金的一本全面指南，而ETF是越来越多的投资者和顾问们的首选投资工具。

这本书充分体现了理查德的信息量丰富、通俗易懂的写作风

<<玩转ETF基金>>

编辑推荐

ETF一鸣惊人的表现，掀起了投资行业一次新的革命！

全球ETF投资领域的王者之书 业界公认的熟谙掌握ETF投资实务的标准参考书 星晨集团董事总经理唐·菲利普斯倾情作序推荐！

ETF相关主题全囊括，是投资者甄选、管理ETF，制定创新型投资策略和必胜组合的权威指南。



<<玩转ETF基金>>

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>