

## <<证券投资基金绩效评价>>

### 图书基本信息

书名：<<证券投资基金绩效评价>>

13位ISBN编号：9787810984348

10位ISBN编号：7810984349

出版时间：2005-10

出版时间：上海财经大学出版社

作者：蔡明超

页数：225

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>

## <<证券投资基金绩效评价>>

### 内容概要

《证券投资基金绩效评价：理论与实务》共分7章，包括绪论、基金风险调整绩效的理论探讨与实证研究、基金的风格调整绩效分析、指数基金的投资绩效评价、基金绩效的分析、绩效报酬设计对基金绩效的影响、影响基金绩效的其他因素探讨。

主要内容如下： 1、基金风险调整绩效。

作者在参数方法的基础上提出了基于投资者效用函数和随机变量二阶矩的广大风险调整绩效指标，该指标可以将各种风险调整绩效指标统一起来。

2、基金的风格调整后绩效。

风格调整能够将基金绩效中的更多非基金经理因素去除，是基金绩效评估发展的趋势。

3、基金专项能力的分解与分析。

成功的资产组合管理是基金管理人在证券分析、证券选择、板块配置、类别配置、时机选择等过程协调运作的结果。

4、影响基金绩效的基金经理报酬设计的因素分析。

基金管理报酬的设计通过基金投资的积极程度或者购买股票的风险程度影响基金的绩效。

5、影响基金绩效的其他因素分析。

另外，本书还探讨了投资成本、投资集中度、换手率与资产规模等其他因素对基金业务的影响。

## &lt;&lt;证券投资基金绩效评价&gt;&gt;

## 书籍目录

序前言约定符号说明1 绪论1.1 西方证券投资基金业与基金评估业1.1.1 西方证券投资基金业发展1.1.2 西方基金评估产业现状1.2 基金绩效评估及影响因素的研究现状1.2.1 基金绩效的风险调整技术及主要研究成果1.2.2 投资风格识别与风格调整后的基金绩效1.2.3 基金绩效的分解与专项能力1.2.4 影响基金绩效的因素分析1.3 中国证券投资基金的发展与绩效评估研究状况1.3.1 中国证券投资基金业与基金评估业1.3.2 国内学者关于基金绩效的研究1.4 本书研究的动机、内容与研究创新1.4.1 本书研究的动机1.4.2 本书研究的主要内容与创新2 基金风险调整绩效的理论探讨与实证研究2.1 基金风险调整绩效的参数方法2.1.1 参数方法下基金风险调整绩效指标的构造2.1.2 参数方法下各种基金风险调整绩效指标的比较2.1.3 基于二阶矩参数的广义风险调整绩效指标(GRAP)的提出2.2 非参数方法下的基金绩效评估2.2.1 参数方法的不足之处2.2.2 安全第一准则在基金绩效评估中的应用2.2.3 修正的Sharpe比率与高阶矩参数逼近法的引入2.3 中国证券投资基金风险调整绩效的实证分析2.3.1 样本的选择2.3.2 研究方法与结果分析2.4 我国证券投资基金风险调整绩效分析中普遍存在的问题2.4.1 绩效的显著性与数据评估期问题2.4.2 基金的业绩与计算方法3 基金的风格调整绩效分析3.1 资产组合管理过程与投资风格定义3.2 投资风格的分类及其在绩效评估中的意义3.2.1 投资风格的分类3.2.2 投资风格分析在绩效评估中的意义3.3 基金投资风格的事后识别方法3.3.1 基于市值与成长性的风格箱识别方法3.3.2 投资风格识别的多因素回归模型3.3.3 未知风格基准下聚类分析法的提出3.4 风格调整绩效的计算方法3.4.1 已知基准风格下风格调整绩效的计算方法3.4.2 类基准方法下的风格调整绩效3.5 中国证券投资基金风格识别及风格调整绩效的实证分析3.5.1 中国证券投资基金约定的投资风格3.5.2 中国证券投资基金的投资风格识别3.5.3 中国证券投资基金风格调整绩效的实证结果与分析4 指数基金的投资绩效评价4.1 指数基金的发展状况4.2 指数编制原理与指数基金追踪方法4.3 指数基金运作的理论基础4.3.1 有效市场假设理论与投资策略的辩证关系4.3.2 中国市场效率的实证检验4.4 我国指数基金投资绩效的实证分析5 基金绩效的分解5.1 基金经理能力分解理论探讨与研究意义5.2 基金经理能力分解的统计方法5.2.1 择时能力与择股能力的判断方法5.2.2 现金管理能力与资产切换能力的分解5.3 基金经理能力的持续性判断方法5.4 中国证券投资基金经理能力的实证分析5.4.1 择时能力和择股能力分析5.4.2 现金管理能力和资产切换能力5.4.3 持续能力分析6 绩效报酬设计对基金绩效的影响6.1 基金经理的固定报酬定价与基金经理行为6.2 基金经理浮动报酬定价与基金经理行为6.2.1 简单浮动报酬定价与基金经理行为6.2.2 有上下限的浮动报酬定价与基金经理行为6.2.3 多基准下的满意绩效期权与基金经理行为6.3 从报酬定价看我国证券投资基金行为与绩效6.3.1 我国常见的资产组合管理报酬设计方法6.3.2 我国基金报酬设计中存在的问题6.3.3 改革我国基金报酬设计的对策7 影响基金绩效的其他因素探讨7.1 证券投资基金的投资成本与绩效7.1.1 投资基金的交易成本与基金的绩效7.1.2 免费搭车引起的方案执行成本与基金的绩效7.1.3 开放式基金的流动性管理成本7.1.4 特定基金的风格执行成本与基金的绩效7.2 投资组合距离度与基金业绩7.2.1 基金家族的投资决策模式对基金投资集中程度的影响7.2.2 基于经典资产组合理论的投资距离度及性质7.2.3 投资距离度与基金绩效关系的实证分析7.3 影响基金绩效因素的横截面分析7.3.1 基金费用、规模、换手率与基金绩效7.3.2 影响中国证券投资基金绩效的多因素实证分析附录一 本书有关的数据库、程序与基金评估信息系统附录二 影响中国证券投资基金绩效的政策法规大事记参考文献

## <<证券投资基金绩效评价>>

### 编辑推荐

本书采用规范与实证相结合的方法，集中研究了基金绩效评估的技术与影响基金绩效效果的因素，内容包括绪论、基金风险调整绩效的理论探讨与实证研究、基金的风格调整绩效分析、指数基金的投资绩效评价、基金绩效的分析、绩效报酬设计对基金绩效的影响、影响基金绩效的其他因素探讨。

<<证券投资基金绩效评价>>

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>