

<<中国证券投资基金运行研究>>

图书基本信息

书名：<<中国证券投资基金运行研究>>

13位ISBN编号：9787513002660

10位ISBN编号：7513002665

出版时间：2012-1

出版时间：知识产权出版社

作者：宋煜凯

页数：218

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>

## <<中国证券投资基金运行研究>>

### 内容概要

证券投资基金已成为我国证券市场上最重要的机构投资者之一。

由宋煜凯编著的《中国证券投资基金运行研究》重点阐述和研究了证券投资基金的投资行为、投资理念、投资风格和管理水平，并认为它们对证券市场的走势，乃至整个市场的结构化和制度化的完善都起到了举足轻重的作用。

《中国证券投资基金运行研究》开拓了中国证券投资基金研究的新领域，具有一定的创新价值。

## <<中国证券投资基金运行研究>>

### 作者简介

宋煜凯，1963年生，辽宁抚顺人；经济学博士，博士后；现为沈阳建筑大学管理学院教师，副教授。1986年6月毕业于辽宁师范大学历史系，获历史学学士；1993年6月毕业于辽宁大学历史系，获历史学硕士；1997年毕业于辽宁大学经济管理学院，获经济学博士；2007年东北财经大学经济学博士后出站。

曾供职沈阳市证券监督管理委员会；曾任中国新技术创业投资公司沈阳证券营业部总经理；辽宁华邦投资有限公司总经理。

从事金融证券工作十余年，具有丰富的实践经验。

主要研究投资基金、证券市场、房地产金融、项目融资等。

出版专著《中国投资基金发展与规范》，发表多篇学术论文，主持辽宁省社科基金课题1项。

# <<中国证券投资基金运行研究>>

## 书籍目录

### 第一章 引言

- 1.1 研究背景与研究意义
  - 1.1.1 研究背景
  - 1.1.2 研究意义
- 1.2 本书的研究方法
  - 1.2.1 用历史主义和逻辑主义相结合的方法
  - 1.2.2 用实证方法与规范方法相结合的方法
  - 1.2.3 用静态分析与动态分析相结合的方法
- 1.3 研究思路和研究框架

### 第二章 中国证券投资基金发展综述

- 2.1 国外证券投资基金的兴起及发展
- 2.2 美国证券投资基金的发展现状
  - 2.2.1 美国基金业最近发展趋势评述
  - 2.2.2 美国基金业发展的回顾与思索
- 2.3 国外投资基金对国内证券投资基金的启示
  - 2.3.1 建立以公司型为主、契约型为辅的组织体制
  - 2.3.2 在投资基金流动形态上逐步从封闭型走向开放型
  - 2.3.3 投资基金设立规模的大型化
  - 2.3.4 投资基金种类逐步走向专一型
  - 2.3.5 证券型投资基金与创业型投资基金并举发展
- 2.4 国内证券投资基金发展轨迹
  - 2.4.1 摸索阶段
  - 2.4.2 规范阶段
  - 2.4.3 匀速发展阶段
  - 2.4.4 快速发展阶段
- 2.5 国内证券投资基金快速发展的原因
- 2.6 国内证券投资基金现状概述
  - 2.6.1 国内基金公司
  - 2.6.2 国内合资基金公司
  - 2.6.3 私募基金
- 2.7 证券投资基金业运行状况
  - 2.7.1 市场份额
  - 2.7.2 市场集中度
  - 2.7.3 进入壁垒
- 2.8 证券投资基金面临的问题及应对策略
  - 2.8.1 制度建设
  - 2.8.2 市场环境
  - 2.8.3 基金规模
  - 2.8.4 基金结构

### 第三章 国内证券投资基金运行机理

- 3.1 我国证券投资基金运行机制问题分析
  - 3.1.1 基金在运行机制中存在的问题
  - 3.1.2 基金运行机制中问题的根源
- 3.2 完善我国基金运行机制的建议
  - 3.2.1 借鉴美国公司型基金治理模式

## <<中国证券投资基金运行研究>>

### 3.2.2 完善证券投资基金机制的建议

## 第四章 基金投资行为研究

### 4.1 基础理论研究-传统金融理论与行为金融学理论

#### 4.1.1 传统金融理论——有效市场假设与现代证券投资组合

#### 4.1.2 行为金融学理论

#### 4.1.3 “羊群行为”的理论研究

### 4.2 我国证券投资基金的“羊群行为”实证研究

#### 4.2.1 关于“羊群行为”研究的文献概述

#### 4.2.2 我国基金“羊群行为”的实证检验

#### 4.2.3 主要检验结论

#### 4.2.4 关于“羊群行为”的成因分析

#### 4.2.5 避免基金“羊群行为”的建议

### 4.3 基金的投资行为对市场的影响

#### 4.3.1 基金投资与个人投资之间的相互影响

#### 4.3.2 基金行为对股价的影响

#### 4.3.3 整体基金的仓位变动与市场波动的相关性

#### 4.3.4 基金行为的市场功能

### 4.4 基金的投资策略与操作理念研究

#### 4.4.1 基金的投资策略综合评述

#### 4.4.2 我国基金的投资理念研究

#### 4.4.3 简述“后股改”时代的价值投资理念

## 第五章 开放式基金流动性风险管理问题的研究

### 5.1 风险管理概述

#### 5.1.1 风险概念

#### 5.1.2 风险管理的过程

#### 5.1.3 风险管理的目标及原则

### 5.2 金融风险

#### 5.2.1 金融风险的必要性

#### 5.2.2 金融风险的特点

#### 5.2.3 金融风险的种类

### 5.3 开放式基金的流动性风险

#### 5.3.1 开放式基金的流动性风险

#### 5.3.2 开放式基金的资产流动性风险分析

#### 5.3.3 由主成分分析得到的综合指标

### 5.4 因赎回而引起的开放式基金流动性风险

#### 5.4.1 开放式基金赎回行为的研究

#### 5.4.2 我国基金巨额赎回概况

### 5.5 基金巨额赎回风险的防范和管理

#### 5.5.1 针对基金的巨额赎回几点建议

#### 5.5.2 开放式基金的现金预留

#### 5.5.3 运用极值理论对开放式基金赎回量建立模型

## 第六章 我国私募证券投资基金运行研究

### 6.1 私募基金概述

#### 6.1.1 私募基金的含义界定

#### 6.1.2 私募基金与公募基金的制度结构比较

### 6.2 我国私募基金的发展现状和存在的问题

#### 6.2.1 我国私募基金的发展历程

## <<中国证券投资基金运行研究>>

6.2.2 我国私募基金的组织形式

6.2.3 我国私募基金发展中所存在的问题

6.3 我国私募基金的运行特征和发展意义

6.3.1 我国私募基金在证券市场运行中的地位

6.3.2 我国私募基金的资金来源

6.3.3 我国私募基金的运行特征

6.3.4 我国私募基金运行的市场效应与风险

6.3.5 发展我国私募基金的意义

6.4 建立和完善我国私募基金发展的法律与监管体系

6.4.1 我国私募基金的立法

6.4.2 发展我国私募基金的政策建议

第七章 结论

7.1 研究的主要结论和创新点

7.2 研究中存在的不足

主要参考文献

章节摘录

3.2.2.4加强托管人的监督职能 基金托管人的引入是基金管理公司相对于证券公司更加规范化的一个重要原因,进一步加强托管人的监督职能对于促进基金管理公司规范运作将产生十分积极的推动作用。

应当努力激励基金托管人对基金管理人进行监督。

可以考虑在相关法律法规中明确规定,如果出现基金管理人的内部控制问题,应当由基金托管人与基金管理人一同承担责任。

在这种责任体制下,一旦基金托管人监督不力,其就会与基金管理人一同承担赔偿责任,立法可以以此作为威慑,促使基金托管人积极行使监督权。

加强基金托管人对基金管理人的监督力度。

可以考虑赋予基金托管人对基金管理人的独立诉讼权。

我国现行基金立法并未赋予基金托管人对基金管理人的过错行为代表基金提起诉讼的权利,弱化基金托管人对基金管理人的监督力度,如果增加该项诉讼权,有利于对基金管理人形成强有力的约束机制。

应当强化基金托管人对基金管理人的检查权,立法应当明确赋予基金托管人随时自行或者委托社会中介机构检查基金管理人财务会计报表的权利,并且考虑建立一套基金经理人定期向基金托管人汇报基金操作情况的报告制度,以有利于基金托管人的监管。

.....

<<中国证券投资基金运行研究>>

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>