

<<中国开放式基金绩效评价>>

图书基本信息

书名：<<中国开放式基金绩效评价>>

13位ISBN编号：9787562524458

10位ISBN编号：7562524459

出版时间：2010-3

出版时间：中国地质大学出版社

作者：段文军

页数：200

字数：182000

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>

## <<中国开放式基金绩效评价>>

### 内容概要

基金绩效评价，主要是指对证券投资基金的投资绩效的评价。

评价的主要目的是为了帮助投资者综合评价基金在过去一段时间内取得的投资成果，分析基金管理人的投资管理能力和投资风格，从而为判断基金的未来表现提供依据。

一个公正、实用的基金绩效评价体系的建立，对我国基金投资的发展是非常必要的。

证券投资绩效相关研究对评估基金投资绩效及投资者选择投资对象有十分重要的作用，有关评价方法及应用的研究已引起广泛的关注。

同迅速发展的证券投资基金市场相比，有关基金绩效评价的研究在我国却发展得相对滞后。

随着证券投资基金业的迅速发展，特别是基金品种的不断丰富，我国现阶段相对滞后的基金绩效评价研究越来越难以适应基金市场的进一步发展。

建立一套科学、完备的评价体系，使市场各方能够对基金的绩效和投资效果进行客观评价，不仅具有很高的理论价值，对于我国证券投资基金业的健康发展来说，也有着非常重要而紧迫的现实意义。

## <<中国开放式基金绩效评价>>

### 书籍目录

第一章 绪论 第一节 研究背景及目的 第二节 基金绩效评价的内容考察及国内外研究综述 一、基金绩效评价的内容及指标 二、国外基金绩效的研究 三、我国基金绩效的研究 第三节 研究方法 & 创新之处 一、研究方法 二、本书创新之处

第二章 证券投资基金相关理论文献回顾 第一节 金融市场及其理论发展 一、金融市场及其分类 二、金融市场理论 第二节 现代投资理论 一、投资组合理论 二、资本市场理论 三、有效市场假说 第三节 投资管理理论 一、投资管理概述 二、股票组合管理 三、债券组合管理

第三章 证券投资基金资产组合理论——基金绩效评价的理论依据分析 第一节 马科维茨均值一方差模型 第二节 资本资产定价模型(CAPM) 第三节 基金资产组合的风险来源及风险收益匹配 一、收益风险的方差表述 二、收益风险的标准差表述 第四节 总结

第四章 基金绩效评价的传统方法及其实证分析 第一节 几个经典绩效评价指标 一、Sharpe比绩效评价指标 二、Treynor比绩效评价指标 三、Jensen 绩效评价指标 四、以上3个绩效评价指标间的相互关系 五、估价比率(appraisal ratio)绩效评价指标 六、传统绩效评价方法的适用性研究 七、传统绩效评价指标的局限性分析 第二节 传统绩效评价方法实证分析 一、样本基金选取 二、投资收益率的确定 三、无风险收益率的确定 四、市场基准组合的确定 第三节 实证结果 一、回归分析 二、Sharpe比绩效评价指标实证结果分析 三、Treynor比绩效评价指标实证结果分析 四、Jensen 绩效评价指标实证结果分析.....

第五章 传统基金绩效评价方法的创新及其实证分析

第六章 中国基金证券选择和市场时机选择能力的评价

第七章 中国基金绩效的持续性研究

第八章 本书研究的主要结论和若干思考

附录：数学推导参考文献

<<中国开放式基金绩效评价>>

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>