第一图书网, tushu007.com

<<中国证券投资基金评价研究>>

图书基本信息

书名：<<中国证券投资基金评价研究>>

13位ISBN编号：9787030196644

10位ISBN编号：7030196643

出版时间：2007-8

出版时间：科学出版社

作者：赵秀娟

页数：347

字数：425000

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

内容概要

本书是一部以系统工程方法论指导的基金评价研究专著，从独立第三方的角度力求完整地分析和解决中国证券投资基金市场中的评价问题。
在分析成熟市场已有的评价理论和经验的同时，不仅注重在理论框架上有重要的创新，而且致力于针对我国年轻的基金市场构建有效而合理的评价体系，在研究思路、模型开发、理论方法、实证检验等方面都有创新和突破，包括开展了一些在国际上基金评价研究领域属于开创性的研究工作，尤其是指出了用效率和行为研究的思路来评价证券投资基金业，并首次真正完整地构建了我国证券投资基金业的评价体系。
一方面从单支基金评价到基金经理评价，再到基金管理公司的核心竞争力评价、市场评价，由小到大，层层推进；另一方面从基金的风险度量开始，到业绩评价、效率评价、行为评价、持续性评价，特别是在充分考虑我国基金业的实际特点后，有针对性地构建合理的模型进行研究，分析逐步深入，为市场参与各方都提供了一个可以参照的范例和评价思路。
　本书既可供金融业界人士，从事管理学、金融学、经济学等有关领域的高等院校师生和研究人员阅读与参考，也适用于对基金评价感兴趣的其他读者(包括广大投资者)参考。

书籍目录

丛书序序言第一篇 总 论　第1章 引论　1.1 中国证券投资基金市场概述　1.2 基金评价的研究意义　1.3 本书的主要内容　第2章 证券投资基金评价方法综述　2.1 基金的绝对收益水平　2.2 基金的风险水平　2.2.1 标准差　2.2.2 卢系数　2.2.3 下跌风险度量　2.2.4 相对风险度量　2.2.5 VaR　2.3 基金评价的基准组合　2.4 基金风险调整的收益水平　2.5 基金业绩来源分析　2.5.1 对基金经理市场时机把握能力的考察　2.5.2 基于风险补偿的Fama分解　2.5.3 基于投资操作环节业绩贡献的基金业绩归属分析　2.6 基金业绩的持续性分析与预测　2.7 基金的风格检验方法　2.7.1 基于组合的风格分析　2.7.2 基于回报的风格分析　2.8 其他方法　2.9 国内外现有评价体系介绍　2.9.1 晨星评级体系　2.9.2 标准普尔的评级系统Micropal　2.9.3 我国主要的基金评级体系　2.10 本章小结第二篇 基金产品评价研究　第3章 基金风险指标的改进　3.1 问题的提出　3.2 VaR　3.2.1 VaR的定义　3.2.2 VaR的优点与限制　3.3 证券投资基金收益率正态性检验　3.3.1 样本　3.3.2 正态性检验　3.4 非对称（Asymmetric）Laplace分布　3.4.1 定义　3.4.2 非对称Laplace分布的一些主要特性　3.5 非对称Laplace分布下的VaR　3.6 非对称Laplace分布数据的拟和与检验　3.7 本章小结　第4章我国证券投资基金业绩的持续性研究　4.1 考察基金业整体持续性的常用方法　4.1.1 双向表　4.1.2 回归法　4.2 基金业绩持续性检验　4.2.1 数据与方法　4.2.2 检验结果　4.3 两种新的持续性检验方法　4.3.1 转移矩阵　4.3.2 整体持续性指标　4.4 本章小结　第5章 基于DEA的基金业绩评价　5.1 文献回顾　5.2 数据包络分析（DEA）　5.2.1 CCR模型　5.2.2 BCC模型　5.3 基金DEA评价的几个关键问题　5.3.1 概念模型的选择　5.3.2 数量模型的选取　5.3.3 充分的分析　5.4 本章小结　第6章 基于基金特征的PCPC评价模型　6.1 类别变量的嵌入　6.2 部分不可控　6.3 偏好信息的引入　6.4 PCPC模型　6.4.1 定义　6.4.2 性质　6.4.3 变形　6.4.4 分析方法　6.5 实证分析　6.5.1 单期评价　6.5.2 多期综合评价　6.5.3 基金管理信息的深层次挖掘　6.6 本章小结　第7章 相对吸引程度和相对进步程度评价　7.1 问题的提出　7.2 背景模型　7.3 锥性背景模型　7.3.1 偏好下的集合划分　7.3.2 偏好下的吸引程度度量　7.3.3 偏好下的进步程度度量　7.3.4 对偶模型　7.3.5 进一步讨论　7.4 开放式基金的实证分析　7.4.1 样本与输入输出　7.4.2 实证模型　7.4.3 不同等级的划分　7.4.4 相对吸引程度度量　7.4.5 相对进步程度度量　7.5 本章小结　第8章 多期投资管理水平评价　8.1 投资基金的效率方法论　8.2 多期投资管理水平变化的度量　8.3 基于PCPC模型的Malmqtlist指数求解　8.4 开放式基金多期投资管理效率变动分析　8.5 本章小结第三篇 基金经理与基金公司评价研究　第9章 基金经理的投资行为研究　9.1 引言　9.2 开放式基金净值增长率被拉升了吗?　9.2.1 问题的提出与相关文献　9.2.2 研究方法　9.2.3 样本数据　9.2.4 净值增长率的月末和季末效应　9.2.5 不同业绩组的日历效应　9.2.6 日历末前后各5个交易日的净值增长率异动　9.3 中国证券投资基金羊群效应的研究　9.3.1 相关文献回顾　9.3.2 研究方法　9.3.3 数据处理　9.3.4 实证检验　9.3.5 近3年基金“羊群行为”比较　9.4 本章小结　第10章 基金经理业绩的评价　10.1 引言　10.2 我国基金经理市场概述　10.3 基金经理的投资能力评价　10.3.1 数据准备　10.3.2 收益率的计算方法　10.3.3 绝对投资业绩排名　10.3.4 择时选股能力　lO.4 基金经理个人特征对业绩的影响有多大?　10.4.1 相关文献综述　10.4.2 关于研究目标和范围的界定　10.4.3 基金数据的选取过程　10.4.4 基金经理个人特征的提取　10.4.5 几个假设　10.4.6 研究方法　10.4.7 实证检验结果分析　10.5 本章小结　第11章 投资管理模式的评价研究　11.1 引言　11.2 基金经理的更换　11.3 集中管理　11.4 关于投资管理模式的讨论　11.5 本章小结　第12章 基金管理公司的核心竞争力　12.1 引言　12.2 基金管理公司核心竞争力的内涵　12.2.1 投资研发能力　12.2.2 营销服务能力　12.3 核心竞争力评价方法的开发　12.3.1 定性指标的模糊化　12.3.2 模糊DEA模型　12.3.3 带子系统的DEA模型　12.3.4 多系统模糊DEA模型　12.3.5 基金类别的模糊函数设定　12.3.6 概念模型　12.4 实证分析　12.4.1 各大投资管理团队概况　12.4.2 评价结果　12.5 本章小结第四篇 基金市场评价研究　第13章 我国基金市场的国际比较　13.1 证券投资基金信息披露的国际

比较 13.1.1 我国证券投资基金信息披露的情况介绍 13.1.2 国际信息披露标准和中国基金披露差异对比表 13.1.3 我国基金信息披露存在的缺憾及建议 13.2 证券投资基金监管的国际比较 13.2.1 美、英、日三国监管体系介绍 13.2.2 我国基金监管体系 13.2.3 对形成合理监管模式的几点建议 13.3 本章小结总结与展望参考文献附录附录一 中国证券投资基金业大事记（1997～2006）附录二 证券投资基金业绩持续性报告之2005年上半年度附录三 证券投资基金业绩持续性报告之2005年附录四 证券投资基金业绩持续性报告之2006年上半年度附录五 证券投资基金业绩持续性报告之2006年

第一图书网, tushu007.com

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