

证券投资基金绩效评价



[证券投资基金绩效评价_下载链接1](#)

著者:蔡明超

出版者:上海财经大学出版社

出版时间:2005-10

装帧:简装本

isbn:9787810984348

全书共分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。

作者介绍:

目录:

[证券投资基金绩效评价_下载链接1](#)

标签

金融

评论

[证券投资基金绩效评价_下载链接1](#)

书评

[证券投资基金绩效评价_下载链接1](#)