

# 《证券投资基金业绩评价研究》

## 书籍信息

版次：1

页数：

字数：240000

印刷时间：2014年03月01日

开本：12k

纸张：胶版纸

包装：平装

是否套装：否

国际标准书号ISBN：9787514142112

## 内容简介

随着中国经济的发展、资本市场的日益完善，证券投资基金作为机构投资者对证券市场的影响越来越大。但是，证券投资基金是否像宣传的那样能够专家理财、分散投资、获得超过市场的回报，这一直受到人们的质疑。而对于基金的业绩表现及其在资本市场中所起的作用引起了各界广泛的关注。虽然，随着基金的迅猛发展，有关基金业绩评价文章也经常见诸报端，而且专门从事基金评价的机构也已经出现，但是这些研究大都是简单引用国外方法和指标来进行的业绩评价的，并没有新的理论和方法的提出；同时在实证方面也没有考虑中国基金发展的实际情况以及中国相关政策对基金的影响，从而导致所进行的业绩评价不仅实证结果上有显然的偏差，在理论上也没有任何创新。如何结合中国基金的实际情况，采用新的理论对基金业绩进行评价，不仅具有很高的理论价值，对于中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。

## 作者简介

范新安，1977年9月生，男，河南修武人。博士，副教授，注册会计师。现任教于郑州升达经贸管理学院会计系。在10余年的教学和学习期间，认真完成各项教学任务，教学效果良好。先后为本科生讲授初级会计学、中级财务会计、会计手工试验等课程。作为主要成员，讲授的《初级会计学》被评为省级精品课程。科研方面，在《财会月刊》、《财会通讯》、《中国软科学》等核心期刊上发表论文10余篇，主持厅级项目项，参与省厅级科研项目5项，主持校级教改项目1项。2012年度河南省高等学校青年骨干教师资助计划资助对象；2013年度河南省教育厅学术技术带头人。目前主要研究方向：公司理财与风险管理、公司金融、财务会计。

## 目录

### 第一章 绪论

#### 第一节 选题背景及意义

#### 第二节 研究方法

#### 第三节 研究框架及内容

#### 第四节 创新点

## 第二章 文献综述

### 第一节 国外基金业绩评价文献综述

一、国外基金总体业绩评价研究

二、国外基金选股择时能力研究

三、国外基金业绩持续性研究

四、对国外基金业绩评价的评述

### 第二节 国内基金业绩评价文献综述

一、对国外基金业绩评价方法的引入及综述第一章 绪论 第一节 选题背景及意义

第二节 研究方法 第三节 研究框架及内容 第四节 创新点

第二章 文献综述 第一节 国外基金业绩评价文献综述 一、国外基金总体业绩评价研究

二、国外基金选股择时能力研究三、国外基金业绩持续性研究

四、对国外基金业绩评价的评述第二节 国内基金业绩评价文献综述

一、对国外基金业绩评价方法的引入及综述二、国内基金总体业绩评价研究

三、国内基金选股择时能力研究四、国内基金业绩持续性研究

五、对国内基金业绩评价的评述第三节 本章小结

## 第三章 基金总体业绩评价研究及实证分析 第一节 基金总体业绩评价指标

一、经典的基金总体业绩评价指标二、基金总体业绩评价指标的发展

第二节 基于保险成本的基金总体业绩评价指标 一、基金总体业绩评价中的风险计量

二、基于保险成本的基金总体业绩评价研究第三节 基金总体业绩评价实证分析

一、实证样本及数据来源二、实证结果及分析第四节 本章小结

## 第四章 基金选股择时能力研究及实证分析 第一节 基金选股择时能力的检验方法

一、基金选股择时能力检验的参数方法二、基金选股择时能力检验的非参数方法

三、基金选股择时能力检验最新的研究方法第二节 基金选股择时能力整体特征分析

一、中国基金选股能力整体分析二、中国基金择时能力整体分析

三、中国基金羊群效应分析第三节 基金个体选股择时能力实证分析

一、数据来源及方法二、实证结果及分析第四节 本章小结

## 第五章 基金持续性研究及实证分析 第一节 基金持续性检验方法 一、横截面回归法

二、基于双向表的检验方法三、史毕尔曼秩相关系数检验法四、扫描统计量法

第二节 基金持续性的理论解释 一、数据质量假说二、股票惯性假说

三、基金经理才能假说第三节 基金持续性实证分析 一、横截面分析二、秩相关分析

三、交叉积比率分析四、扫描统计量分析第四节 本章小结

## 第六章 结论与展望 第一节 本研究结论 第二节 未来展望 附录A中国基金一览表

附录B 样本基金及代码对照表 参考文献

[显示全部信息](#)

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www.tushupdf.com](http://www.tushupdf.com)