

《投资绩效测评：评估和结果呈报》

图书基本信息

《投资绩效测评：评估和结果呈报》

内容概要

在过去的20年中，投资业绩衡量、报告和评估的重要性日益凸显。随着资本市场数据服务越来越多、定量分析技术的发展以及全球投资业绩标准（Global Investment Performance Standards, GIPS[®]）越来越为业界所接受和认可，绩效测评已经成为有效资产管理的一个重要组成部分，这也部分归功于投资业绩衡量证书（Certificate in Investment Performance Measurement, CIPM）项目的开展。在此基础上，业绩衡量已经成为投资人士公认的专业领域之一。

这就是为什么《投资绩效测评：评估和结果呈报》成为CFA协会机构投资系列（CFA Institute Investment Perspectives Series）第二个核心议题的原因。CFA协会在刊印行业领先的思想著作方面，有着悠久的传统。这本新的文集，可以为那些每天需要面对瞬息万变的投资管理挑战的读者，提供无与伦比的指导。

本书中的文章，都来自CFA协会研究基金会、金融分析师杂志、CFA协会会议论文集季刊、CFA杂志和投资业绩评价证书课程。这些文章的作者，全是一些当今业内最有影响力的思想领袖（专业人士和受人尊敬的学者），是一些毕生专注于投资业绩评价的人士。

这一应时而生的文集共分为5个部分，从业绩衡量、归因和评估的角度，为业绩评价领域打开了广阔的视野。通过本书，你能熟悉与业绩评价相关的几乎所有内容，从时间与价值加权收益率的算法到业绩评价的相关技术，一应俱全。

在信息丰富的概述后，本书的内容还包括：

第二部分：业绩衡量。该部分提供了强化读者相关基础的必要知识，主要是两个方面的内容——基准的理论基础和基准管理中要面对的权衡问题。

第三部分：业绩归因。该部分讨论了归因分析各方面的问题，重点是决定投资组合业绩的主要因素。

第四部分：业绩评价。该部分讨论了对冲基金的风险和回报、基金管理变革与股票投资风格转变等问题。

第五部分：全球投资业绩标准。该部分回顾并说明了全球投资业绩标准的主要内容，主要强调了一些在GIPS[®]标准实施中的操作性问题。

本书集中了多位经验人士的宝贵见解，可以作为你提升投资业绩衡量、对衡量结果进行报告和评价等多方面能力的实用指南。

《投资绩效测评：评估和结果呈报》

作者简介

《投资绩效测评：评估和结果呈报》

书籍目录

《投资绩效测评：评估和结果呈报》

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：www.tushu000.com