

投资基金重点考点分析：第十五章基金绩效衡量 PDF转换可能丢失图片或格式，建议阅读原文

https://www.100test.com/kao_ti2020/39/2021_2022__E6_8A_95_E8_B5_84_E5_9F_BA_E9_c33_39327.htm 第十五章 基金绩效衡量

基本内容：本章主要介绍了基金绩效衡量的目的与意义；熟悉衡量基金绩效需要考虑的因素；基金净值收益率的几种计算方法；基金业绩衡量风险调整的必要性；风险调整衡量的方法；择时能力衡量的方法；绩效贡献的分析方法。具体对基金绩效衡量的目的与意义、衡量基金绩效需要考虑的因素、绩效衡量问题的不同视角、基金净值收益率的几种计算方法、基金业绩的收益率衡量、风险调整绩效衡量的方法、择时能力衡量的方法、绩效贡献的分析方法进行了详细介绍。

学习要求：了解基金绩效衡量的目的与意义；熟悉衡量基金绩效需要考虑的因素；熟悉基金净值收益率的几种计算方法；了解基金业绩衡量风险调整的必要性；熟悉风险调整衡量的方法；了解择时能力衡量的方法；熟悉绩效贡献的分析方法。

#8226. 第二节 基金净值收益率的计算 重点内容：基金净值收益率的几种计算方法。 考点分析：简单收益率的计算，时间加权收益率的计算，算术平均收益率与几何平均收益率的计算，年化收益率的计算。

#8226. 第四节 风险调整绩效衡量方法 重点内容：对基金收益率进行风险调整的必要性，三大经典风险调整收益衡量方法，三种风险调整衡量方法的区别和联系，经典绩效衡量方法存在的问题，风险调整收益衡量的其他方法。 考点分析：对基金收益率进行风险调整的必要性，特瑞诺指数，夏普指数，詹森指数，三种风险调整衡量方法的区别和联系。

#8226. 第六节 绩效贡献分析 重点内容

：资产配置选择能力与证券选择能力的衡量，行业或部门选择能力的衡量。 考点分析：资产配置选择能力与证券选择能力的衡量，行业或部门选择能力的衡量。 100Test 下载频道开通，各类考试题目直接下载。详细请访问 www.100test.com