

目 錄

	頁次
第一章 緒 論.....	1
第一節 研究背景.....	1
第二節 研究動機.....	8
第三節 研究目的.....	10
第四節 研究流程.....	11
第五節 研究架構.....	13
第二章 中國基金市場介紹及文獻回顧.....	14
第一節 中國共同基金市場的介紹.....	15
第二節 中國公募基金公司綜合量化評估報告.....	19
第三節 企業社會責任的發展及對績效之影響.....	21
第四節 基金特徵對基金績效之影響.....	28
第五節 投信公司特徵對其基金績效之影響.....	30
第六節 Fama and French 三因子模型.....	32
第三章 研究方法與實證模型.....	34
第一節 變數操作性定義.....	34
第二節 分量迴歸模型(quantile regression).....	38
第四章 資料來源與處理.....	41
第五章 實證結果與分析.....	42
第一節 各變數之基本敘述統計.....	42
第二節 普通最小平方法迴歸估計結果.....	45
第三節 分量迴歸估計結果.....	47
第六章 結論與未來研究建議.....	52
第一節 研究結論.....	52

第二節 未來研究建議.....	54
參考文獻.....	55

表 目 錄

	頁次
【表 1-1-1】晨星 2012 第四季中國基金公司綜合量化評分前 20 名基金公司	7
【表 2-1-1】中國基金依「基金投資標的」不同之分類比較.....	15
【表 2-1-2】中國基金依「基金種類」不同之分類比較.....	16
【表 2-1-3】中國開放式基金與封閉式基金比較.....	17
【表 2-1-4】中國各類型共同基金檔數及規模比較表.....	18
【表 3-1-1】Fama and French 三因子模型投資組合區分.....	36
【表 5-1-1】各變數基本敘述統計量表.....	43
【表 5-1-2】Pearson 相關性檢定與共線性檢定.....	44
【表 5-2-1】普通最小平方法迴歸估計結果.....	46
【表 5-3-1】全樣本分量迴歸估計結果.....	48
【表 5-3-2】社會責任組之分量迴歸估計結果.....	50
【表 5-3-3】不具社會責任組之分量迴歸估計結果.....	51

圖 目 錄

	頁次
【圖 1-1-1】近十年中國基金公司總數變動情形.....	5
【圖 1-1-2】近五年中國基金公司總數成長率.....	6
【圖 2-2-1】晨星對中國公募基金公司綜合量化評估報告評分方法概覽.....	20