

Malmquist指数在中国证券投资基金业评价中的应用

赵秀娟,张洪水

收稿日期 修回日期 网络版发布日期 接受日期

摘要 将Malmquist效率指数引入到投资基金评价中,以刻画我国投资基金业投资组合管理效率在不同市场环境下的动态变化,旨在为基金业的发展提供决策借鉴. DEA静态评价发现:就平均而言,股票型基金和债券型基金在熊牛转换的市场环境下管理效率变化较大.而通过Malmquist指数的分解,发现近两年中国证券投资基金管理状况是优化的,拉动基金投资组合管理效率不断增长的主要原因是产品运作方式创新、经营方式创新和管理制度创新以及规模效率的提高.

关键词 [基金](#) [业绩](#) [效率](#) [相对有效性](#) [Malmquist](#)

分类号

DOI:

对应的英文版文章: [2010040646](#)

通讯作者:

作者个人主页: 赵秀娟;张洪水

扩展功能

本文信息

- ▶ [Supporting info](#)
- ▶ [PDF](#) (577KB)
- ▶ [\[HTML全文\]](#) (0KB)
- ▶ [参考文献\[PDF\]](#)
- ▶ [参考文献](#)

服务与反馈

- ▶ [把本文推荐给朋友](#)
- ▶ [加入我的书架](#)
- ▶ [加入引用管理器](#)
- ▶ [引用本文](#)
- ▶ [Email Alert](#)

相关信息

- ▶ [本刊中 包含“基金”的 相关文章](#)
- ▶ 本文作者相关文章
 - [赵秀娟](#)
 - [张洪水](#)