

عنوان مقاله:

ارزیابی صندوق های سرمایه گذاری مشترک برگزیده موجود در بازار سرمایه ایران با روشی ترکیبی از VIKOR ، TOPSIS و تکنیک مشابهت

محل انتشار:

فصلنامه تحقیقات مالی، دوره 17، شماره 2 (سال: 1394)

تعداد صفحات اصل مقاله: 24

نویسندگان:

محمد رضا صادقی مقدم - استادیار، مدیریت صنعتی، دانشکده مدیریت، دانشگاه تهران، تهران، ایران

رضا علی بخشی - کارشناس ارشد MBA، دانشکده مدیریت، دانشگاه تهران، تهران، ایران

الهام خلیلی - دکتری مدیریت مالی، دانشکده مدیریت و حسابداری، دانشگاه علامه طباطبائی، تهران، ایران

خلاصه مقاله:

مقاله حاضر هم زمان دو هدف را دنبال می کند. از یک سو با بهره گیری از روش های تصمیم گیری چند معیاره TOPSIS،VIKOR و تکنیک مشابهت تلاش دارد توانایی روش های یادشده در رتبه بندی صندوق های منتخب از میان صندوق های مشترک در بازار سرمایه ایران را بیازماید و از سوی دیگر در ارزیابی صندوق ها، سه دسته شاخص های عمومی ارزیابی عملکرد صندوق ها (عمر، ارزش خالص هر واحد سرمایه گذاری، خالص ارزش دارایی ها، درصد دارایی های نقدی و درصد بازدهی)، شاخص های ارزیابی عملکرد تعدیل شده با ریسک (شارپ، ترینر و جنسن) و شاخص های ارزیابی عملکرد تعدیل شده با ریسک با لحاظ نیم واریانس (شارپ و ترینر تعدیل شده و جنسن تعدیل شده با نیم بتا) را به صورت مجزا و نیز با هم را بررسی می کند تا توان این سه رویکرد در ارزیابی صندوق ها با شاخص های مختلف مقایسه شود. در انتها، نتایج این مقایسه با سه رویکرد بیان شده و تصمیم های سرمایه گذاران حرفه ای و غیرحرفه ای ارزیابی شده است.

کلمات کلیدی:

بورس اوراق بهادار تهران، تصمیم گیری چندمعیاره، رتبه بندی صندوق ، صندوق سرمایه گذاری مشترک

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1395023>

