

عنوان مقاله:

ارزیابی رتبه بندی صندوق های سرمایه گذاری مشترک در ایران

محل انتشار:

فصلنامه اقتصاد مالی، دوره 10، شماره 36 (سال: 1395)

تعداد صفحات اصل مقاله: 18

نویسنده:

امید علی عادلی - استادیار و عضو هیات علمی دانشکده مدیریت، دانشگاه قم، قم، ایران.

خلاصه مقاله:

صندوق های سرمایه گذاری مشترک ابزار مناسبی برای افراد حقیقی و حقوقی به منظور سرمایه گذاری در اوراق بهادار هستند. ارزیابی عملکرد و رتبه بندی این صندوق ها می تواند راهنمای مفیدی جهت سرمایه گذاران باشد. هدف از مطالعه حاضر رتبه بندی صندوق های سرمایه گذاری مشترک در ایران است. به این منظور از داده های آماری دوره زمانی ابتدای بهمن ۱۳۸۹ تا انتهای دی ماه ۱۳۹۴ (دوره ۵ ساله) استفاده شده است. ابتدا صندوق های سرمایه گذاری منتخب بر مبنای روش های سنتی و تحلیل پوششی داده ها رتبه بندی و سپس با توجه به تعدد معیارها به منظور رتبه بندی کامل صندوق ها از تکنیک تاپسیس استفاده شده است. ورودی شامل انواع معیارهای ریسک و خروجی شامل نرخ بازده و نسبت دوره برتر بوده اند. بعد از رتبه بندی صندوق ها بر اساس ۸ معیار، به منظور لحاظ همه معیارها در رتبه بندی از روش تاپسیس استفاده شده است. نتایج حاکی از آن است که از بین ۱۷ صندوق مورد بررسی صندوق های فیروزه، بورسیران و آگاه در رتبه های اول تا سوم بوده و صندوق های پیشگام، کارگزاری بانک کشاورزی و گنجینه رفاه در رتبه های آخر قرار داشته اند.

کلمات کلیدی:

تاپسیس، تحلیل پوششی داده ها، صندوق های سرمایه گذاری مشترک، نسبت شارپ، نسبت ترینور. طبقه بندی، JEL : G۲۲، G۲۳۰

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1570272>

