

## عنوان مقاله:

ارزیابی عملکرد صندوق های سرمایه گذاری مشترک در سهام و اوراق بهادار با درآمد ثابت

## محل انتشار:

نخستین همایش بین المللی جامع مدیریت ایران (سال: 1394)

تعداد صفحات اصل مقاله: 9

## نویسنده:

مهسا حسینی - دانشجوی دکتری مدیریت، گرایش مدیریت مالی، دانشگاه آزاد اسلامی- واحد تهران شمال

## خلاصه مقاله:

هدف از این پژوهش، ارزیابی عملکرد صندوق های سرمایه گذاری مشترک در سهام و اوراق بهادار با درآمد ثابت است. بدین منظور داده های مورد نیاز از اول آذرماه 1390 تا پایان آبانماه 1393 جمع آوری و سپس معیارهای عملکرد شارپ، سورتینو و پتانسیل مطلوب محاسبه شدند. نتایج حاصل از پژوهش نشان می دهد به طور میانگین: بین عملکرد صندوق های سرمایه گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت، تفاوت معنی داری وجود ندارد؛ بین عملکرد صندوق های سرمایه گذاری در سهام (در اندازه بزرگ) تفاوت معنی داری وجود ندارد؛ صندوق های سرمایه گذاری در سهام، بهتر از صندوق های سرمایه گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت عمل می کنند؛ در حالی که بین عملکرد صندوق های سرمایه گذاری در سهام با عملکرد بازار بر اساس معیار شارپ تفاوت معنی داری وجود ندارد، بر اساس معیارهای سورتینو و پتانسیل مطلوب صندوق های سرمایه گذاری در سهام پایین تر از بازار عمل می کنند.

## کلمات کلیدی:

صندوق های سرمایه گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت، صندوق های سرمایه گذاری در سهام، معیار شارپ، معیار سورتینو، معیار پتانسیل مطلوب

## لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/487232>

