

عنوان مقاله:

کاربرد مدل‌های دو مرحله‌ای تحلیل پوششی داده‌ها در ارزیابی کارایی صندوقهای سرمایه‌گذاری مشترک-مطالعه موردی

محل انتشار:

نهمین کنفرانس ملی تحلیل پوششی داده‌ها (سال: 1396)

تعداد صفحات اصل مقاله: 15

نویسندگان:

فاطمه رخشان - دانشکده ریاضی، دانشگاه علم و صنعت ایران

مریم معصومی هژیر - دانشکده ریاضی، دانشگاه علم و صنعت ایران

خلاصه مقاله:

در بررسی عملکرد و کارایی نسبی به ویژه در سطح سازمانی، مدل‌های تحلیل پوششی داده‌های سنتی، تفاوت‌های گسترده و مهم فعالیتها را به صورت عوامل جداگانه تشخیص نمی‌دهند و بنابراین نمی‌توانند عواملی را که ممکن است منبع اصلی ناکارایی باشند، شناسایی کنند. هدف از انجام تحقیق حاضر، ارزیابی عملکرد نسبی 18 خانواده صندوق سرمایه‌گذاری مشترک در ایران طی سالهای 1392 و 1393، با اجرای یک مدل تحلیل پوششی داده‌ها (DEA) دو مرحله‌ای است به طوری که کارایی کلی هر واحد تصمیم‌گیرنده به دو جزء کارایی مدیریت عملیاتی و کارایی مدیریت سبد سرمایه‌گذاری تجزیه میشود. نتایج نشان میدهد که باتجزیه کارایی کلی به دو جزء، میتوان خانواده‌هایی را که عملکرد بد و ناکافی و آنهایی را که عملکرد خوبی داشتند، مشخص کرد. همچنین تصاویر مرزی برای خانواده‌های با عملکرد ضعیف برآورد شده تا مدیران سبد سرمایه‌گذاری بتوانند صندوقها را نسبت به دیگر صندوقها، مدیریت کنند. نتایج ارزیابی خانواده صندوقهای سرمایه‌گذاری مشترک در ایران نشان میدهد که این خانواده‌ها عملکردضعیفی در مدیریت عملیاتی دارند که این به معنی مدیریت ضعیف هزینه‌های صندوق است.

کلمات کلیدی:

تحلیل پوششی داده‌ها، خانواده صندوقهای سرمایه‌گذاری مشترک، مدیریت عملیاتی، مدیریت سبد سرمایه‌گذاری

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/678431>

