

عنوان مقاله:

بررسی تغییرات کارایی خانواده صندوق های سرمایه گذاری مشترک در سال های 92 و 93 با استفاده از مدل دو مرحله ای تحلیل پوششی داده ها

محل انتشار:

دهمین کنفرانس بین المللی انجمن تحقیق در عملیات ایران (سال: 1396)

تعداد صفحات اصل مقاله: 17

نویسندگان:

محمد رضا علیرضایی - دانشیار دانشگاه علم و صنعت، دانشکده ریاضی

مریم معصومی هژیر - کارشناسی ارشد ریاضی کاربردی، دانشگاه علم و صنعت، دانشکده ریاضی،

فاطمه رخشان - دانشجوی دکتری دانشگاه علم و صنعت، دانشکده ریاضی

خلاصه مقاله:

در بررسی عملکرد و کارایی نسبی به ویژه در سطح سازمانی، مدل های تحلیل پوششی داده های سنتی، تفاوت های گسترده و مهم فعالیت ها را به صورت عوامل جداگانه تشخیص نمی دهند و بنابراین نمی توانند عواملی را که ممکن است منبع اصلی ناکارایی باشند، شناسایی کنند. هدف از انجام تحقیق حاضر، ارزیابی عملکرد نسبی 18 خانواده صندوق سرمایه گذاری مشترک در ایران در طی سال های 1392 و 1393، با اجرای یک مدل تحلیل پوششی داده های DEA دو مرحله ای است به طوریکه کارایی کلی هر واحد تصمیم گیرنده به دو جزء کارایی مدیریت عملیاتی و کارایی مدیریت سبد سرمایه گذاری تجزیه می شود. نتایج نشان می دهد که با تجزیه کارایی کلی به دو جزء، میتوان خانواده هایی را که عملکرد بد و ناکافی و آنهایی را که عملکرد خوبی داشتند، مشخص کرد. همچنین تصاویر مرزی برای خانواده های با عملکرد ضعیف برآورد شده تا مدیران سبد سرمایه گذاری بتوانند صندوق ها را نسبت به دیگر صندوق ها، مدیریت کنند. نتایج ارزیابی خانواده صندوق های سرمایه گذاری مشترک در ایران نشان می دهد که این خانواده ها عملکرد ضعیفی در مدیریت عملیاتی دارند که این به معنی مدیریت ضعیف هزینه های صندوق است.

کلمات کلیدی:

تحلیل پوششی داده ها، خانواده صندوق های سرمایه گذاری مشترک، مدیریت عملیاتی، مدیریت سبد سرمایه گذاری

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/767146>

