

عنوان مقاله:

بررسی رابطه بین شاخص های پرتفوی شرکت سرمایه گذاری صنعت بیمه با شاخص های صنعت واسطه گری مالی

محل انتشار:

فصلنامه پژوهشنامه بیمه، دوره 22، شماره 3 (سال: 1385)

تعداد صفحات اصل مقاله: 22

نویسندگان:

فریدون رهنمای رود پستی - عضو هیئت علمی دانشگاه آزاد اسلامی، واحد علوم و تحقیقات

ضیا فروغی - کارشناس ارشد مدیریت بازرگانی دانشگاه آزاد اسلامی، واحد تهران مرکز

خلاصه مقاله:

شرکت های سرمایه گذاری، با حضور در بازارهای مالی منشأ اثرات مثبتی در رونق و شفافیت این بازارها شده اند. اساس مار این شرکت ها بر مبنای تشکیل سبد سهام یا پرتفوی بوده و مدیریت پرتفوی یکی از مسایل اساسی در این شرکت ها است. این امر، برای مدیران شرکت و سهامداران بسیار حایز اهمیت بوده و مستلزم بررسی و شناخت ویژگی ها و شاخص های اصلی پرتفوی است. شرکت سرمایه گذاری صنعت بیمه از شرکت های سرمایه گذاری فعال در بورس اوراق بهادار است که نزدیک به 70% سهام آن به چهار شرکت بیمه ای بزرگ کشور است. در این تحقیق، به بررسی رابطه بین بازدهی، ریسک و شاخص عملکرد شرکت با صنعت مربوطه به صورت سالانه و ماهانه، طی پنج سال از ابتدای سال 1380 تا انتهای سال 1384 پرداخته ایم. نتایج آزمون های انجام شده بر روی فرضیات اهم، حاکی از این است که رابطه معناداری بین متغیرهای میانگین بازده ماهانه، ریسک و شاخص عملکرد شرکت و صنعت مربوطه با وجود ضرایب همبستگی قابل توجه وجود ندارد. از طرفی نتایج آزمون های صورت گرفته بر روی فرض های اخص، بیانگر رابطه معنادار بین بازده ماهانه و شاخص عملکرد شرکت با بازده ماهانه و شاخص عملکرد صنعت مربوطه است.

کلمات کلیدی:

پرتفوی، ریسک، بازده، معیارهای عملکرد پرتفوی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/996180>

