

عملکرد بر جریان های سرمایه گذاری مشترک

مسعود صفری

سرشناسه: صفری / مسعود
عنوان و نام پدیدآور: عملکرد بر جریان های سرمایه گذاری مشترک / مسعود صفری
مشخصات نشر: تهران - البرز فردانش ۱۳۹۹
مشخصات ظاهری: ص ۱۱۷
موضوع: صندوق های سرمایه گذاری قابل معامله در بورس - ایران
موضوع: بورس - ایران - نمونه پژوهی
موضوع: بازار سرمایه - ایران
رده بندی گره: HG۵۷۲۰/۲
رده بندی دیویی: ۳۳۲/۶۴۲۵۵
شابک: ۶۷۸-۶۰۰-۲۰۲-۶۹۲-۷
شماره کتابشناسی ملی: ۶۱۸۶۰

عنوان: عملکرد بر جریان های سرمایه گذاری مشترک

نویسنده: مسعود صفری

مشخصات نشر: تهران - البرز فردانش ۱۳۹۹

مشخصات ظاهری: رقعی - ۱۱۷ ص

شابک: ۶۷۸-۶۰۰-۲۰۲-۶۹۲-۷

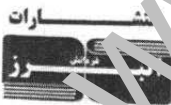
نوبت چاپ: اول ۱۳۹۹

تیراژ: ده

چاپخانه / صحافی: آذین

قیمت: ۱۰۰۰۰ تومان

کتاب و حقوق کتاب متعلق به نویسنده می باشد



البرز فردانش:

ضلع شمال غربی پل سیدخندان - اول خیابان شقایق - کوچه بن بست اول - پلاک ۲ - واحد ۱۲

آدرس ایمیل: alborz22 887501@yahoo.com

تلفن: ۲۲۸۶۰۲۶۰ - ۲۲۸۸۷۵۰۱

فهرست مطالب

فصل اول: کلیات

مقدمه / ۱

چارچوب نظری و مبانی نظری / ۳

مبانی نظری / ۴

تعریف و ابعاد کلیدی و اصطلاحات / ۸

صندوق سرمایه گذاری / ۸

جریان صندوق سرمایه گذاری / ۹

بازده صندوق سرمایه گذاری / ۹

ثبات عملکرد صندوق های سرمایه گذاری / ۱۰

معیار الفای جنسن / ۱۰

نقدشوندگی / ۱۰

نوسانات ویژه بازده سهام / ۱۱

عمر صندوق / ۱۱

اندازه صندوق / ۱۱

هزینه های صندوق / ۱۲

گردش مالی (حجم معاملات) / ۱۲

فصل دوم: مروری بر تحقیقات

مبانی نظری / ۱۵

طبقه بندی صندوق های سرمایه گذاری / ۱۸

از دیدگاه شکل حقوقی / ۱۹

از دیدگاه محتوای سرمایه گذاری / ۱۹

جایگاه صندوق های مشترک در بازارهای مالی / ۲۱

خالص ارزش دارایی های صندوق های سرمایه گذاری / ۲۱

صنعت صندوق های سرمایه گذاری با سرمایه باز / ۲۲

ویژگی‌ها و مزایای صندوق‌های سرمایه‌گذاری/۲۳

مدیریت حرفه‌ای/۲۴

صرفه‌جویی‌های ناشی از مقیاس/۲۴

امکان نقد شوندگی واحدهای سرمایه‌گذاری/۲۴

رسالت اجتماعی صندوق‌های سرمایه‌گذاری/۲۵

تنوع بخشی سبد اوراق بهادار و کاهش ریسک/۲۵

بازده صندوق سرمایه‌گذاری/۲۶

صندوق‌های سرمایه‌گذاری مشترک در ایران/۲۷

مدیریت سرمایه‌گذاری مشترک با درآمد ثابت/۲۷

صندوق‌های سرمایه‌گذاری مشترک فعال در زمینه سهام/۲۹

آمار/۲۹

مفهوم جریان سرمایه و صندوق‌های سرمایه‌گذاری/۳۰

اثبات عملکرد صندوق‌ها/۳۱

اهداف ارزیابی عملکرد صندوق‌ها/۳۱

ارزیابی عملکرد/۳۱

ادبیات موضوع صندوق‌های سرمایه‌گذاری/۳۱

مفهوم عملکرد صندوق سرمایه‌گذاری/۳۴

الف) سود نقدی هر واحد سرمایه‌گذاری/۳۴

ب) عایدات سرمایه‌ای ناشی از دارایی‌های فروخته شده/۳۴

پ) عایدات سرمایه‌ای از محل دارایی‌های موجود/۳۴

معیار شارپ/۳۷

معیار ترینر/۳۷

معیار جنسن/۳۸

نقدشوندگی/۳۸

تاریخچه صورت وجه نقد/۳۸

اهمیت جریان‌های نقدی عملیاتی/۴۰

دلایل اهمیت نقدینگی صندوق‌های سرمایه‌گذاری/۴۱

وجه نقد صندوق‌های سرمایه‌گذاری/۴۲

سطوح مختلف نقدینگی/۴۳

امکان نقد شوندگی واحدهای سرمایه‌گذاری/۴۳

نوسانات ویژه بازار/۴۴
 بازده و عوامل موثر بر آن/۶۴
 بازده سرمایه گذاری در صندوق/۴۷
 نوسان پذیری بازده سهام/۴۸
 فاکتورهای افزایش نوسان بازده غیر متعارف/۴۹
 اندازه گیری نوسان پذیری بازده سهام/۵۰
 فاکتورهای افزایش نوسان بازده/۵۱
 عامل سازمان پذیری و تأثیر آن بر ریسک/۵۲
 گردش مالی صندوق و حجم معاملات/
 نظریه محقق های بازار راجع به تحقیق و ارزیابی/۵۵
 نظریه محقق های خارجی راجع به تحقیق و ارزیابی/۵۸

فصل سوم: جامعه آماری

جامعه مطالعاتی و نمونه آماری/۶۵
 نمونه شیوه اندازه گیری متغیرها/
 شیوه اندازه گیری متغیرها/۶۷
 متغیر مستقل/۶۷
 متغیرهای کنترلی/۶۸
 متغیر تعدیل گر/۶۸
 گردش مالی صندوق/۶۹
 روش جمع آوری داده ها/۶۹
 روش تجزیه و تحلیل اطلاعات/۷۰
 آمار توصیفی/۷۰
 آمار استنباطی/۷۱
 — (۱) آزمون مانایی/۷۱
 — (۲) انواع داده/۷۲
 — (۳) انواع مدل های بکار رفته در داده های ترکیبی/۷۳
 — (۴) تحلیل رگرسیون/۷۵