

المستخلص

نبيلة الصفي. ٢٠١٥. الرسالة. العنوان: تحليل مقارنة تقييم محفظة صناديق الاستثمار الخفي (التقليدية والشريعة)

باستخدام طريقة Jensen، Sharpe، Treynor فترة ٢٠١٤-٢٠١٢

المشرفة: يونا أوكتيابي لاستاري الماجستيرية

الكلمات الأساسية: صناديق الاستثمار، مؤشر Jensen، مؤشر Sharpe، مؤشر Treynor

صناديق الاستثمار هي شكل من أشكال الاستثمار التي تتطور في الوقت الآن. في تطورها بدأ صناديق الاستثمار المشتركة التي تطبق مبادئ الشريعة في سياستها الاستثمارية. تقييم أداء صناديق الاستثمار هو واحدة من الأشياء الهامة التي يجب مراعاتها في اختيار نوع صناديق الاستثمار المهدوف للإستثمار. ويهدف هذا البحث لمقارنة الأداء بين صناديق الاستثمار التقليدية وصناديق الاستثمار الشريعة باستخدام مؤشر Jensen، ومؤشر Treynor، ومؤشر Sharpe.

المجتمع في هذا البحث صناديق الاستثمار لمدارة من مدير الاستثمار لإدارة كل من الفئات الفرعية، صناديق الاستثمار التقليدية وصناديق الاستثمار الشريعة. وأسلوب التحليل المستخدم اختبار فرق المتوسط باستخدام اختبار T عينة المستقلة. وهذا البحث من نوع بحث المقارنة.

إن نتائج البحث على صناديق الاستثمار التقليدية والشريعة دلت بأن صناديق الاستثمار التقليدية لها أكبر عائد من صناديق الاستثمار الشريعة. الإختبار باختبار T عينة المستقلة على صناديق الاستثمار التقليدية والشريعة تدل على هذين صناديق الاستثمار غير ذات أهمية تفاصيل بمؤشر Jensen، ومؤشر Treynor، ومؤشر Sharpe. إذا، لا يوجد فرق الأداء بين صناديق الاستثمار التقليدية والشريعة.