

Каріг Еванс, Гері ван Вуурен

Аналіз ефективності інвестиційної стратегії при обмеженій похибці відслідковування

Результати нещодавніх досліджень (2018 р.) свідчать про збільшення потреби у активному менеджменті на неефективних ринках для полегшення використання інвестиційних можливостей. Як правило, у активних портфелях спостерігається обмежена похибка відслідковування. Співвідношення ризик-прибуток таких портфелів описане як еліпс у інтервалі для середнього відхилення, відомого як постійна межа похибки відслідковування. Незважаючи на оцінку ефективності стратегій інвестування у активні портфелі на межі ефективності у попередніх дослідженнях, у цій статті використано декілька показників ефективності для оцінки високої ефективності стратегій інвестування у активні портфелі за критеріями, у яких спостерігається обмежена похибка відслідковування, на постійній межі похибки відслідковування.

Ключові слова: межа похибки відслідковування, портфельний ризик, активний менеджмент, критерії оцінки.

Класифікація JEL: C52, G11.



Стаття знаходиться у відкритому доступі і може розповсюджуватися на умовах ліцензії [Creative Commons Attribution 4.0 International license](https://creativecommons.org/licenses/by/4.0/), що дозволяє необмежене повторне використання, розповсюдження та відтворення на будь-якому носії за умови наявності відповідного посилання на оригінальну версію статті.

Кариг Эванс, Гери ван Вуурен

Анализ эффективности инвестиционной стратегии при ограниченной погрешности отслеживания

Результаты недавних исследований (2018 г.) свидетельствуют об увеличении потребности в активном менеджменте на неэффективных рынках для облегчения использования инвестиционных возможностей. Как правило, в активных портфелях наблюдается ограниченная погрешность отслеживания. Соотношение риск-прибыль таких портфелей описано как эллипс в интервале для среднего отклонения, известного как постоянная граница погрешности исследования. Несмотря на оценку эффективности стратегий инвестирования в активные портфели на границе эффективности в предыдущих исследованиях, в данной статье использованы несколько показателей эффективности для оценки высокой эффективности стратегий инвестирования в активные портфели по критериям, в которых наблюдается ограниченная погрешность отслеживания, на постоянной границе погрешности отслеживания.

Ключевые слова: граница погрешности отслеживания, портфельный риск, активный менеджмент, критерии оценки.

Классификация JEL: C52, G11.



Статья находится в открытом доступе и может распространяться на условиях лицензии [Creative Commons Attribution 4.0 International license](https://creativecommons.org/licenses/by/4.0/), что позволяет неограниченное повторное использование, распространение и воспроизведение на любом носителе при условии наличия соответствующей ссылки на оригинальную версию статьи.