

## عنوان مقاله:

انتخاب سرمایه گذاری بهینه با استفاده از تحلیل پوششی داده ها و تحلیل مولفه های اصلی

## محل انتشار:

شانزدهمین کنفرانس بین المللی مهندسی صنایع (سال: 1398)

تعداد صفحات اصل مقاله: 8

## نویسندگان:

صدیقه محرابی - کارشناس ارشد گروه مهندسی مالی، دانشگاه آزاد اسلامی واحد یادگار امام خمینی (ره) شهرری

مهناز میربلوکی - استادیار و عضو هیات علمی گروه ریاضی کاربردی، دانشگاه آزاد اسلامی واحد یادگار امام خمینی (ره) شهرری؛

## خلاصه مقاله:

سالهای اخیر حوزه مدیریت مالی شاهد شروع تحولاتی در جهت کمک به تصمیم گیری مدیران، سرمایه گذاران و ارزیابی این که آیا تصمیمات اخذ شده، بهترین تصمیم بوده یا امکان تصمیم بهتری وجود داشته، بوده است. با توجه به سرعت انتقال اطلاعات و دسترسی به داده های مالی و سخت افزارها و نرم افزارهای پیشرفته و تغییراتی که در بدنه تئوری مالی و یافته های تجربی بوجود آمده، استراتژیهای سرمایه گذاری شرکتها و موسسات و ارزیابی آنها بطور متناوب درحال تغییر میباشد. یکی از راه های جدید که جهت ارزیابی شرکتها بکاربرده میشود متدولوژی تحلیل پوششی داده ها است که یک روش چندمعیاره برای تصمیم گیری و سنجش عملکرد شرکتها می باشد. یکی از محدودیتهای علم تحلیل پوششیداده ها تعداد عوامل ارزیابی است که در صورت انتخاب تعداد زیاد عوامل در برابر تعداد شرکتها مورد بررسی، جواب معتبری ارائه نمیکند. از طرفی روش تحلیل مولفه های اصلی علمی بر مبنای جبرخطی برای شناسایی عوامل ناهمبسته است که تلفیق این علم به همراه تحلیل پوششی داده ها ابزاری مناسب در ارزیابی شرکتها مورد سرمایه گذاری است که دارای عوامل نسبتا متعددی میباشد. در این مطالعه ضمن معرفی روش 2PCA-DEA1 در ارزیابی کارایی، وضعیت شرکتها موجود در بازار بورس ایران در سه دوره متوالی بررسی میکنیم.

## کلمات کلیدی:

پورتفوی، تحلیل پوششی داده ها، تحلیل مولفه های اصلی.

## لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1034772>

