

عنوان مقاله:

رتبه بندی صنایع بورس تهران بر اساس معیارهای ریسک از منظر سرمایه گذاران نهادی؛ رویکرد تحلیل پوششی داده ها (DEA)

محل انتشار:

مدیریت دارایی و تامین مالی، دوره 4، شماره 2 (سال: 1395)

تعداد صفحات اصل مقاله: 17

نویسندگان:

فریدون رهنمای رودپشتی - دانشگاه آزاد اسلامی واحد علوم و تحقیقات، تهران

فرزانه اشعریون قمی زاده - دانشگاه تهران

حامد تاجمیر ریاحی - دانشگاه امام صادق (ع)

خلاصه مقاله:

سرمایه گذاران نهادی طبق قانون بازار سرمایه عبارت اند از: شرکتهای سرمایه گذاری و صندوقهای مشترک. این دسته از سرمایه گذاران به نظر می رسد از جهت معیارهای انتخاب صنعت و ریسک مدنظر، با سرمایه گذاران خرد متفاوت باشند. در این پژوهش که رویکرد آن کیفی کمی است، از روش تحلیل سلسله مراتبی، جهت رتبه بندی معیارهای ریسک و از تحلیل پوششی، جهت رتبه بندی صنایع مختلف استفاده شده است. نتایج پژوهش حاضر، حاکی از آن است که از منظر سرمایه گذاران نهادی جهت رتبه بندی صنایع بورس، هشت معیار ریسک مدنظر قرار می گیرد. مهم ترین معیارهای ریسک به ترتیب عبارتاند از: دامنه نوسان بازده صنعت، دامنه نوسان قیمت به عایدی صنعت و مجموع تعداد روزهای توقف نماد در صنعت. در میان صنایع بورس از منظر نهادیها و با توجه به معیارهای ریسک کاراترین و کم ریسکترین صنایع، صنعت زیر بنایی فلزات اساسی و فعالیتهای مالی و واسطه گری است.

کلمات کلیدی:

رتبه بندی، صنایع بورس، معیارهای ریسک، تحلیل پوششی داده ها، تحلیل سلسله مراتبی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1288313>

