

## عنوان مقاله:

غربال سهام شرکت های بورس اوراق بهادار تهران با استفاده از تصمیم گیری چندمعیاره، منطق فازی و بهینه سازی

## محل انتشار:

مهندسی مالی و مدیریت اوراق بهادار، دوره 2، شماره 8 (سال: 1390)

تعداد صفحات اصل مقاله: 18

## نویسندگان:

محمد اوجی - کارشناس ارشد حسابداری، دانشگاه آزاد اسلامی، واحد مرودشت، گروه حسابداری، مرودشت، ایران

علی رحمانی - استادیار حسابداری دانشگاه الزهرا تهران، ایران

رضوان حجازی - دانشیار حسابداری دانشگاه الزهرا تهران، ایران

## خلاصه مقاله:

موضوع مورد بحث در این تحقیق، غربال با استفاده از تصمیم گیری چندمعیاره، منطق فازی و بهینه سازی می باشد. در این تحقیق از دو دسته معیار عمومی تحت عناوین سلامت مالی در سال قبل و معیار موفقیت بازار در سال جاری استفاده شده است. برای معیار عمومی سلامت مالی، هفت نسبت مالی و برای معیار عمومی موفقیت بازار، دو معیار حداکثر ریسک و بازدهی برای سه سال مالی در نظر گرفته شد که در ابتدا با استفاده از روش AHP، کارشناسان بورس اوراق بهادار تهران به این معیارها رتبه داده اند و با ماتریس مقایسه ای زوجی، وزن این معیارها به دست آمده است و سپس با استفاده از توابع عضویت فازی مقادیری از 0 تا 1 به معیارهای این تحقیق اختصاص داده شده است. سه فرمول شناخته شده در این تحقیق برای جمع هر دو دسته معیار استفاده شده اند و در نهایت شرکت هایی که حداقل در دو فرمول بیشترین مقدار را داشته باشند، از غربال عبور کرده اند. نتایج این تحقیق نشان می دهد که همبستگی قابل ملاحظه ای بین معیار موفقیت بازار شرکت و سلامت مالی وجود دارد. در این تحقیق از روش بهینه سازی نیز استفاده شده است. با این روش دیگر نیازی به اظهار نظر کارشناسان وجود نخواهد داشت و وزن معیارها با الگوی ارائه شده محاسبه شده است.

## کلمات کلیدی:

غربال سهام، توابع عضویت فازی، AHP، سلامت مالی، موفقیت بازار، بهینه سازی چندمعیاره، معیار عمومی

## لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1410388>

