

عنوان مقاله:

سنجش عملکرد مالی ۵۰ شرکت برتر بورس اوراق بهادار با استفاده از مدل های غیر شعاعی تحلیل پوششی داده ها

محل انتشار:

مهندسی مالی و مدیریت اوراق بهادار، دوره 13، شماره 50 (سال: 1401)

تعداد صفحات اصل مقاله: 20

نویسندگان:

سعید رضائی لوا - گروه مالی، واحد تهران مرکز، دانشگاه آزاد اسلامی، تهران، ایران

میر فیض فلاح شمس - گروه مدیریت بازرگانی، واحد تهران مرکز، دانشگاه آزاد اسلامی، تهران، ایران

مسعود صناعی - گروه ریاضی، واحد تهران مرکز، دانشگاه آزاد اسلامی، تهران، ایران

شکوفه بنی هاشمی - گروه ریاضی، دانشکده آمار، دانشگاه علامه طباطبائی، تهران، ایران

خلاصه مقاله:

هدف از این تحقیق انتخاب بهینه سبد سهام با استفاده از تحلیل پوششی داده ها است و جهت انجام پروژه از اطلاعات بورس اوراق بهادار درباره ۵۰ شرکت فعال برتر در بازه زمانی تابستان سال ۱۳۹۸ و ردیابی تحلیل همین داده ها در بازه زمانی بهار سال ۱۳۹۸ می باشد. برای محاسبه کارایی نسبی و میزان پیشرفت و پسرفت شرکت ها از مدل توسعه یافته تحلیل پوششی داده ها (SORM) استفاده گردیده که ورودی ها فقط در فاصله ای محدود و مشخص شده می توانند تغییر نمایند و با همین فرض، خروجی نیز در فاصله ای محدود شده تغییر می نماید و امکان وجود داده منفی هم قابلیت تحلیل دارد و مدل نهایی با توجه به اطلاعات استخراج شده از جامعه مورد بحث، کارایی و بهینگی انتخاب سبد سهام را تسهیل می نماید. به دلیل عدم وجود تمام اطلاعات مورد نیاز و در دسترس، نتایج این تحلیل نشان می دهد ۱۳ شرکت، کارایی برابر ۱ که نشانگر بیشترین سطح کارایی است دست یافته و بانک صادرات با احتساب رقم ۱.۳۲ و شرکت پتروشیمی فناوران نیز به احتساب رقم ۱.۱۵ به ترتیب دارای بیشترین پیشرفت و نرخ رشد در طبقه اول و دوم بهره وری طبقه بندی گردیده اند.

کلمات کلیدی:

داده های منفی، تحلیل پوششی داده ها، شاخص های رتبه بندی، سوپر کارایی، پیشرفت و پسرفت

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1490144>

