

عنوان مقاله:

رویکرد ترکیبی روش بهترین-بدترین آرمانی خطی و طبقه بندی چند شاخصه برای تشکیل سبد سهام

محل انتشار:

فصلنامه پژوهش های نوین در تصمیم گیری، دوره 7، شماره 2 (سال: 1401)

تعداد صفحات اصل مقاله: 35

نویسندگان:

میر سید محمد محسن امامت - دانشجوی دکتری، گروه مدیریت صنعتی، دانشکده مدیریت و حسابداری، دانشگاه علامه طباطبائی، تهران، ایران

مقصود امیری - استاد، گروه مدیریت صنعتی، دانشکده مدیریت و حسابداری، دانشگاه علامه طباطبائی، تهران، ایران

محمد رضا مهرگان - استاد، گروه مدیریت صنعتی، دانشکده مدیریت، دانشگاه تهران، تهران، ایران

محمد تقی تقوی فرد - استاد، گروه مدیریت صنعتی، دانشکده مدیریت و حسابداری، دانشگاه علامه طباطبائی، تهران، ایران

خلاصه مقاله:

در چهار دهه اخیر تصمیم گیری چند شاخصه همواره یک حوزه فعال پژوهشی و کاربردی بوده است. آنچه تا به امروز بیشتر بدان پرداخته شده است توسعه یا بکارگیری تکنیک های تصمیم گیری چند شاخصه برای رتبه بندی گزینه های موجود بوده است. اما حیطه تصمیم گیری چند شاخصه فقط به این نوع مساله محدود نمی شود و مسائل طبقه بندی را نیز در بر می گیرد. هدف از پژوهش حاضر پیشنهاد رویکردی ترکیبی متشکل از روش های بهترین-بدترین آرمانی خطی و یک روش نوین طبقه بندی چند شاخصه به منظور تشکیل سبد سهام در بازار بورس اوراق بهادار تهران است. در این مطالعه وزن شاخص های موثر بر انتخاب سبد سهام در طی یک فرآیند تصمیم گیری گروهی با استفاده از روش بهترین-بدترین آرمانی خطی تعیین شدند. سپس با استفاده از روش پیشنهادی طبقه بندی چند شاخصه، سبد سهام تشکیل شد. روش پیشنهادی قادر است ترجیحات تصمیم گیرنده نظیر دامنه تعداد سهام های موجود در سبد سهام و یا محدودیت هایی نظیر حداکثر تعداد سهام از هر صنعت را در نظر بگیرد. در این مطالعه نتایج بدست آمده از روش پیشنهادی با روش های ناپسیس سورت و ویکور سورت مقایسه شد. نتایج بدست آمده دقت بالای روش پیشنهادی را نشان داد و سبد سهام تشکیل شده توسط روش پیشنهادی به طرز قابل توجهی سودآورتر از روش های دیگر بود. رویکرد پیشنهادی در این پژوهش را می توان در سایر مسائل دنیای واقعی که ماهیت طبقه بندی دارند نیز بکار گرفت.

کلمات کلیدی:

تصمیم گیری چند شاخصه، طبقه بندی چند شاخصه، بهترین-بدترین آرمانی، انتخاب سبد سهام

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1853598>

