

عنوان مقاله:

ارزیابی کارایی و رتبه بندی سبد سهام با استفاده از روش تحلیل پوششی داده های بازه ای

محل انتشار:

چهارمین همایش ملی و اولین همایش بین المللی مطالعات جدید در کارآفرینی و مدیریت کسب و کار (سال: 1401)

تعداد صفحات اصل مقاله: 12

نویسندگان:

علی فائض - استادیار گروه مدیریت مالی، واحد سمنان، دانشگاه آزاد اسلامی، سمنان، ایران

امین جباری - دانشجوی دکتری، دانشکده مهندسی صنایع گرایش لجستیک و زنجیره تامین، دانشگاه علم و صنعت ایران، تهران

مرضیه صداقت - دکتری، ریاضی کاربردی گرایش تحقیق در عملیات، دانشگاه آزاد اسلامی واحد علوم و تحقیقات، تهران

خلاصه مقاله:

یکی از مسائل مهم در بازارهای سرمایه، مساله انتخاب پرتفوی بهینه است که سرمایه گذاران در این رابطه باید به بازدهیو ریسک سهام موجود توجه نمایند. تشکیل پورتفولیو و انتخاب سهام مناسب فرآیندی پیچیده می باشد که این پیچیدگیناشی از تاثیر شاخص های مختلف در تصمیم های سرمایه گذاران و ترجیحات شخصی آنها است در این تحقیق به منظور ارزیابی و رتبه بندی کارایی شرکت های گروه خودرو و ساخت قطعات در بورس اوراق بهادار تهران از تکنیک تحلیلو پوششی داده های بازه ای استفاده شده است. همچنین با در نظر گرفتن همزمان شاخص ریسک به عنوان ورودی مدل وبازده به عنوان خروجی، عملکرد شرکتها طی سال های ۱۳۹۵ تا ۱۳۹۹ مورد بررسی قرار داده شده است. نتایج اینتحقیق نشان میدهد که در این گروه نماد خلنت در دو حالت خوشبینانه و بدبینانه، عملکرد مطلوبی داشته است و کارایی آن در دو حالت برابر یک میباشد. نمادهای ختراک، خکاوه و خاور در رتبه های بعدی کارایی قرار گرفته اند.

کلمات کلیدی:

تحلیل پوششی داده ها، داده های بازه ای، رتبه بندی، سبد سهام، کارایی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1931080>

