

عنوان مقاله:

کاربرد تحلیل پوششی داده ها در تعیین شرکت های کارا در بورس اوراق بهادار

محل انتشار:

مجله مطالعات راهبردی مالی و بانکی، دوره 1، شماره 3 (سال: 1402)

تعداد صفحات اصل مقاله: 13

نویسندگان:

مرتضی جوشقانی زاده - گروه مهندسی صنایع، واحد علوم و تحقیقات، دانشگاه آزاد اسلامی، تهران، ایران.

ملیحه سبزواری - گروه مهندسی صنایع، واحد علوم و تحقیقات، دانشگاه آزاد اسلامی، تهران، ایران.

خلاصه مقاله:

در این مقاله، ابتدا با استفاده از روش تحلیل پوششی داده ها، کاراترین شرکت های پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار تهران تعیین می گردد. این روش در مورد شرکت های حاضر در سه صنعت بانکداری، پتروشیمی و دارویی بررسی می گردد تا شرکت های کارا در هر صنعت شناخته شوند. شرکت های کارا و ناکارا را مشخص، شرکت های ناکارا را رتبه بندی و برای انتخاب سبد سهام بهینه از بین شرکت های کارا استفاده می شود. در ادامه با استفاده از روش برنامه ریزی آرمانی درصد سرمایه گذاری سهم هر شرکت در سبد سهام محاسبه می گردد. در این روش یک بار تنها بازده و ریسک سهم به عنوان متغیرهای مدل در نظر گرفته می شوند و بار دیگر متغیر نقدشوندگی به آن ها اضافه می شود تا تاثیر این متغیر نیز بررسی گردد. در نهایت، مدل ها با داده های واقعی استخراج شده از صورت های مالی شرکت های مربوطه و بانک اطلاعاتی بورس اوراق بهادار تهران مورد ارزیابی قرار گرفته و نتایج پژوهش حاصل مورد تحلیل قرار گرفت.

کلمات کلیدی:

پورتفولیو، برنامه ریزی آرمانی، تحلیل پوششی داده ها، ریسک بازده و سهم

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1958009>

