

عنوان مقاله:

رتبه بندی شرکت های واسطه گری مالی در بازار بورس اوراق بهادار تهران با استفاده از روش تحلیل پوششی داده ها (DEA)

محل انتشار:

کنفرانس بین المللی مدیریت و اقتصاد پویا ایران - مالزی (سال: 1395)

تعداد صفحات اصل مقاله: 19

نویسندگان:

فاطمه دهقانی زاده - کارشناس ارشد مدیریت بازرگانی- مدیریت مالی دانشگاه آزاد اسلامی واحد بین الملل خرمشهر- خلیج فارس

منصور زراء نژاد - استاد دانشکده اقتصاد دانشگاه چمران اهواز

رضا یوسفی حاجی آباد - استادیار گروه اقتصاد دانشگاه پیام نور خوزستان

خلاصه مقاله:

هدف اصلی این تحقیق، رتبه بندی شرکت های واسطه گری مالی در بازار بورس اوراق بهادار تهران با استفاده از روش تحلیل پوششی داده ها (DEA) است. در این تحقیق، عملکرد 26 شرکت از شرکت های واسطه گری مالی در بورس اوراق بهادار تهران، در طی سال های 1388-1392 مورد بررسی قرار گرفته است. نتایج بدست آمده نشان می دهد که متوسط کارایی شرکت های واسطه گری مالی مورد بررسی با فرض بازدهی متغیر نسبت به مقیاس برای سال های 1388 تا 1392 به ترتیب برابر 0/66، 0/69، 0/64، 0/61 و 0/69 طی این مدت می باشد. شرکت های سرپارس آریان، گسترش سرمایه گذاری، بیمه آسیا، بیمه پارسیان، بیمه سینا در طی دوره مورد بررسی کارا بوده اند و با فرض بازدهی ثابت نسبت به مقیاس برای سال های 88 تا 92 به ترتیب برابر 0/56، 0/52، 0/50، 0/51 و 0/47 می باشد. در این رویکرد شرکت سرپارس آریان در طی دوره مورد بررسی کارا بوده است. متوسط کارایی مقیاس شرکت های واسطه گری مالی برای سال های 1388 تا 1392 به ترتیب 0/84، 0/75، 0/79، 0/85 و 0/70 می باشد و شرکت سرپارس آریان در طی دوره مورد بررسی کارا بوده است. در طی سال های 1388-1392، سطح کارایی مقیاس بالاتر از کارایی با فرض بازدهی متغیر نسبت به مقیاس و کارایی با فرض بازدهی متغیر نسبت به مقیاس بالاتر از کارایی در حالت بازدهی ثابت نسبت به مقیاس می باشد و روند ثابتی (افزایشی یا کاهش) برای میانگین کارایی شرکت های واسطه گری مالی مشاهده نمی شود.

کلمات کلیدی:

تحلیل پوششی داده ها، شرکت های واسطه گری مالی، بورس اوراق بهادار، کارایی، بازدهی متغیر نسبت به مقیاس، بازدهی ثابت نسبت به مقیاس، کارایی مقیاس

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/508859>

