

## عنوان مقاله:

تعیین پرتفوی بهینه از صنایع کارای بورس با استفاده از روش تحلیل پوششی داده ها از دیدگاه سرمایه گذاران نهادی (مطالعه موردی بانک انصار)

## محل انتشار:

فصلنامه توسعه مدیریت پولی و بانکی، دوره 2، شماره 5 (سال: 1393)

تعداد صفحات اصل مقاله: 20

## نویسندگان:

محمدحسین برخورداری - رییس امور شرکت های معاونت اقتصادی بانک انصار

مرتضی رضایی - دانش آموخته توسعه و برنامه ریزی اقتصادی دانشگاه علم و صنعت ایران

## خلاصه مقاله:

تعیین سبد بهینه سرمایه گذاری در بورس اوراق بهادار از جمله فرآیندهای پیچیده در تجزیه و تحلیل بازار سرمایه است و روش های متعددی برای آن توسعه یافته است. سنجش صحیح محیط اقتصادی توسط فاکتورهای آماری موثر در تعیین واحدهای بهینه سبب می شود تا ضمن کاهش ریسک سرمایه گذاری، بازگشت سرمایه نیز تضمین شود. نتیجه این فعالیت برای نهادهای بزرگ به خصوص بانک ها و موسسات اعتباری جلوگیری از انباشته شدن معوقات تسهیلات بانکی ارایه شده به صنایع مختلف است. در این پژوهش در ابتدا با استفاده از روش تحلیل پوششی داده ها صنایع کارا شناسایی شده و در ادامه با استفاده از روش تاپسیس صنایع کارای بورسی رتبه بندی شدند. نتیجه نشان داد صنایع رایانه و فعالیت های وابسته به آن، خدمات فنی و مهندسی، سیمان، آهک، گچ، مواد و محصولات دارویی، بانک ها و موسسات اعتباری، سرمایه گذاری ها، شرکت های چند رشته ای صنعتی، سایر واسطه گری های مالی، سایر محصولات کانی غیرفلزی، مخابرات، شیمیایی، لاستیک و پلاستیک و حمل و نقل به ترتیب صنایع کارا و اولویت دار برای سرمایه گذاری هستند.

## کلمات کلیدی:

تاپسیس، تحلیل پوششی داده ها، پرتفوی، صنایع بورس، تصمیم گیری چند معیاره، سرمایه گذاران نهادی

## لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/629227>

