

عنوان مقاله:

ارزیابی عملکرد و انتخاب پرتفوی واحدهای تصمیم گیر بر اساس تکنیک تحلیل پوششی داده ها با اوزان فازی (مطالعه موردی: صندوق های سرمایه گذاری بازار سرمایه ایران)

محل انتشار:

دومین کنفرانس مدیریت، حسابداری و مهندسی صنایع (سال: 1397)

تعداد صفحات اصل مقاله: 19

نویسندگان:

عادل پورقادرچوبر - دانشجوی دکتری مهندسی صنایع

علی سیمایی - کارشناس ارشد مهندسی مالی

خلاصه مقاله:

ارزیابی عملکرد صندوق های سرمایه گذاری مشترک موضوعی مهم برای سرمایه گذاران است، تا با یک ارزیابی مناسب، ریسک سرمایه گذاری خود را تا حد قابل قبولی کاهش دهند. هدف از این پژوهش ارزیابی و رتبه بندی صندوق های سرمایه گذاری مشترک با استفاده از رویکرد تحلیل پوششی داده ها و برنامه ریزی آرمانی و هم چنین ترکیب این مدل ها با اوزان فازی جهت رفع مشکلاتی نظیر توزیع غیرواقعی اوزان به ورودی ها و خروجی ها و تعدد واحدهای کارا می باشد. در راستای این هدف، این پژوهش با استفاده از 7 معیار ارزیابی عملکرد 42 صندوق سرمایه گذاری را در سال های 1391 تا 1393 مورد بررسی قرار می دهد. نتایج این تحقیق نشان می دهد که از بین روش های تحلیل پوششی داده های CCR, CCR, BCC با اعمال اوزان فازی، آرمانی چند هدفه و آرمانی چند هدفه با اوزان فازی که در این پژوهش به کار گرفته شده اند، مدل برنامه آرمانی چند هدفه با اعمال اوزان فازی بهترین مدل برای ارزیابی عملکرد صندوق های سرمایه گذاری مشترک می باشد. در نهایت نسبت سرمایه گذاری در هر صندوق برای تشکیل یک سبد سرمایه گذاری با استفاده از مدلب برنامه ریزی خطی و برنامه ریزی عدد صحیح تعیین شده است.

کلمات کلیدی:

صندوق سرمایه گذاری مشترک، تحلیل پوششی داده ها، برنامه ریزی آرمانی، اوزان فازی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/811976>

