

عنوان مقاله:

ارزیابی عملکرد سهام طی دوره های زمانی مختلف تحت شرایط عدم قطعیت: رویکرد تحلیل پوششی داده های پنجره ای فازی

محل انتشار:

مهندسی مالی و مدیریت اوراق بهادار, دوره 10, شماره 40 (سال: 1398)

تعداد صفحات اصل مقاله: 21

نویسندگان:

پژمان بیگانی - گروه مهندسی صنایع، دانشکده صنایع، دانشگاه علم و صنعت، تهران، ایران

عمران محمدی - گروه مهندسی صنایع، دانشکده صنایع، دانشگاه علم و صنعت، تهران، ایران

فرهاد حسین زاده لطفی - گروه ریاضی، دانشکده علوم پایه، دانشگاه آزاد اسلامی، واحد علوم و تحقیقات، تهران، ایران

رضا تهرانی - گروه مدیریت مالی، دانشکده مدیریت، دانشگاه تهران، تهران، ایران

خلاصه مقاله:

هدف از پژوهش پیش رو، ارائه مدل تحلیل پوششی داده های پنجره ای فازی با هدف ارزیابی عملکرد مالی سهام در خلال دوره های زمانی مختلف تحت عدم قطعیت داده ها می باشد. به عبارت دیگر در این تحقیق تلاش می شود تا یک رویکرد نوین ارزیابی عملکرد سهام با قابلیت پیاده سازی در حضور داده های پانل غیر قطعی ارائه گردد. زیرا بهره گیری از اطلاعات مربوط به چند دوره زمانی مختلف به جای یک دوره زمانی و هم چنین در نظر گرفتن عدم قطعیت موجود در داده ها، می توانند منجر به نتایج قابل اتکاتری در فرایند ارزیابی عملکرد سهام گردند. لازم به توضیح است که در مدل سازی و ارائه رویکرد مذکور، از روش های تحلیل پوششی داده ها، تحلیل پنجره ای و برنامه ریزی امکانی بهره گرفته شده است. در نهایت نیز به منظور آشنایی با چگونگی پیاده سازی رویکرد پیشنهادی پژوهش، مدل تحلیل پوششی داده های پنجره ای فازی بر روی پنج سهم از صنعت فرآورده های شیمیایی در بورس اوراق بهادار تهران برای چهار دوره زمانی از سال 1392 الی سال 1395 اجرا و نتایج مورد تجزیه و تحلیل قرار گرفته اند که حاکی از کارآمدی رویکرد مذکور می باشند.

کلمات کلیدی:

ارزیابی سهام، تحلیل پوششی داده ها، تحلیل پنجره ای، برنامه ریزی ریاضی فازی، طبقه بندی موضوعی: G11, C61, C67

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/958491>

