

عنوان مقاله:

ارائه مدل ترکیبی مبتنی بر روش اولویت بندی فازی و کپراس جهت انتخاب سبد سهام در بورس اوراق بهادار تهران

محل انتشار:

مهندسی مالی و مدیریت اوراق بهادار، دوره 8، شماره 32 (سال: 1396)

تعداد صفحات اصل مقاله: 21

نویسندگان:

محمد رضا فتحی - استادیار دانشکده مدیریت و حسابداری، پردیس فارابی دانشگاه تهران

امید فرجی - دانشجوی دکتری حسابداری، دانشکده مدیریت دانشگاه تهران، ایران

عمران کریمی جوقی - کارشناسی ارشد رشته حسابداری، دانشکده اقتصاد و مدیریت دانشگاه قم، ایران

خلاصه مقاله:

انتخاب پرتفوی یکی از مهم‌ترین موضوعات در مباحث سرمایه‌گذاری می‌باشد که در این تحقیق با استفاده از تکنیک های پژوهش عملیاتی و با در نظر گرفتن معیارهای مختلف، پرتفوی مناسب را در بورس اوراق بهادار تهران استخراج نماییم. بر این اساس ابتدا بر اساس پیشینه پژوهش و نظرات خبرگان معیارهای مالی مختلف در انتخاب پرتفوی را تعیین کرده و با استفاده از روش اولویت بندی فازی وزن معیارها را به دست می‌آوریم. سپس با استفاده از روش کپراس به عنوان یک روش نوین تصمیم گیری چند شاخصه، سهام را رتبه بندی می‌کنیم. براساس نتایج بدست آمده سه شرکت فولاد مبارکه، نیرو محرکه و سیمان شمال به ترتیب رتبه اول تا سوم را بدست آورده‌اند. همچنین جهت مقایسه نتایج رتبه بندی از تکنیک تاپسیس هم استفاده شده است. براساس نتایج بدست آمده از روش کپراس شرکت فولاد مبارکه رتبه اول و براساس نتایج تاپسیس شرکت ماشین سازی اراک رتبه اول را بدست آورده‌اند.

کلمات کلیدی:

روش اولویت بندی فازی، کپراس، سبد سهام، بورس اوراق بهادار تهران

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/958618>

