

عنوان مقاله:

ارایه متدولوژی انتخاب سبد سهام با استفاده از تحلیل پوششی داده ها در بازار بورس ایران

محل انتشار:

سومین کنفرانس بین المللی انجمن تحقیق در عملیات ایران (سال: 1388)

تعداد صفحات اصل مقاله: 2

نویسندگان:

ایرج مهدوی - دانشگاه علوم و فنون مازندران - گروه صنایع

نیما تهامی باهر - دانشگاه علوم و فنون مازندران - گروه صنایع

خلاصه مقاله:

انتخاب سبد سهام موضوع مهم تصمیم گیری در مبحث دسرمایه گذاری است. در این فرایند سرمایه گذار خود را در مقابل انتخاب های زیاد و گوناگونی می بیند که باید یکی از آنها را به عنوان بهترین روش انتخاب نماید. در این مقاله روشی مبتنی بر تحلیل پوششی داده ها در انتخاب سبد سهام ارایه شده است. روش ارایه شده در بازار بورس ایران بکار رفته و از بین 133 شرکت انتخابی بورس 28 شرکت بعنوان سهام کارا معرفی شده اند که این سهام شرکتهای مزبور با بازده سال بعد از خرید در بازار مقایسه شده است تا صحبت و کارایی مدل تعیین گردد.

کلمات کلیدی:

سبد سهام، سهام کارا، تحلیل پوششی داده ها

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/670949>

