



Paper Type: Original Article



Evaluation and Estimation of Outputs and Inputs in Inverse Data Envelopment Analysis with Interval Data

Hossein Jafari*

Department of Industrial Engineering- System Management and Productivity, Sharif University, Tehran, Iran.

Citation:



Jafari, H. (2020). Evaluation and estimation of outputs and inputs in inverse data envelopment analysis with interval data. *Innovation management and operational strategies*, 1(3), 297-309.

Received: 11/05/2020

Reviewed: 02/07/2020

Revised: 04/08/2020

Accept: 08/09/2020

Abstract

Purpose: Examining the history and growth trend of developed countries and comparing it with developing countries shows that the difference and strength of these countries is the optimal use of opportunities and facilities they have had.

Methodology: In this paper, we review DEA models for estimating input / output levels and applying manager or decision maker preferences, as well as improving inefficient units over a period of time. Finally, we have implemented the obtained models in 24 supervisory branches with four input indicators and four indicators, in one of the banks, and the results have been presented and interpreted in the form of several tables.

Findings: The results show that management can increase the index of attracting new customers in proportion to the ability of the collection in the input indicators.

Originality/Value: The problem has been implemented on the unit under the second evaluation and has shown the results in different cases, although this is important for all units under evaluation.

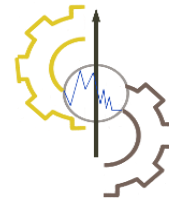
Keywords: Inverse data envelopment analysis, Output estimation, Inputs estimation, Efficiency.

JEL Classificaton: C61.

*Corresponding Author

Email Address: hojafari34@gmail.com

10.22105/IMOS.2021.262569.1017



نوع مقاله: پژوهشی

ارزیابی و تخمین خروجی‌ها و ورودی‌ها در تحلیل پوششی داده‌های معکوس با داده‌های بازه‌ای

حسین جعفری*

گروه مهندسی صنایع-مدیریت سیستم و بهره‌وری، دانشگاه صنعتی شریف، تهران، ایران.

دریافت: ۱۳۹۹/۰۲/۲۲	بررسی: ۱۳۹۹/۰۴/۱۲	اصلاح: ۱۳۹۹/۰۵/۱۴	پذیرش: ۱۳۹۹/۰۶/۱۸
--------------------	-------------------	-------------------	-------------------

چکیده

هدف: بررسی تاریخ و روند رشد کشورهای توسعه‌یافته و مقایسه آن با کشورهای در حال توسعه نشان می‌دهد که وجه تمایز و نقطه قوت این کشورها استفاده بهینه از فرصت‌ها و امکاناتی است که در اختیار داشته‌اند.

روش‌شناسی پژوهش: در این مقاله مدل‌های DEA را برای تخمین سطوح ورودی/خروجی و اعمال ترجیحات مدیر یا تصمیم‌گیرندگان و نیز بهبودبخشی واحدهای ناکارا در حالت بازه‌ای موردبررسی قرار می‌دهیم. در نهایت مدل‌های به‌دست‌آمده را در ۲۴ شعبه سرپرستی با چهار شاخص ورودی و چهار شاخص، در یکی از بانک‌ها پیاده‌سازی شده است و نتایج در قالب جداولی متعدد آورده شده و تفسیر گردیده است.

یافته‌ها: نتایج نشان می‌دهد که مدیریت می‌تواند متناسب با توانمندی مجموعه در شاخص‌های ورودی، نسبت به میزان افزایش شاخص جذب مشتریان جدید اقدام نماید.

اصالت/ارزش‌افزوده علمی: مسئله بر روی واحد تحت ارزیابی دوم پیاده‌سازی شده است و نتایج را در حالت‌های مختلف نمایش داده است البته این مهم برای همه واحدهای تحت ارزیابی قابل پیاده‌سازی می‌باشد.

کلیدواژه‌ها: تحلیل پوششی داده‌ای معکوس، تخمین خروجی‌ها، تخمین ورودی‌ها، کارایی.

طبقه‌بندی JEL: C61.



موضوع کارایی واحدهای تصمیم‌گیرنده از مباحث مهم در تصمیم‌گیری مدیران، جهت اجرای برنامه‌های استراتژیک می‌باشد. لذا بررسی‌های مرتبط با کارایی، در جهت تحلیل وضعیت کنونی اقتصادی و صنعتی کشورهای مختلف و ارائه راه‌کارهای مؤثر در جهت رفع عقب‌ماندگی، بسیار حائز اهمیت می‌باشد. تحلیل پوششی داده‌ها روشی مبتنی بر برنامه‌ریزی ریاضی است که کارایی مجموعه‌ای از واحدهای تصمیم‌گیر^۱ را بر اساس شاخص‌های ورودی و خروجی در مقایسه با هم محاسبه می‌نماید و واحدهای کارا و ناکارا را تعیین می‌کند. همچنین میزان اهداف قابل دسترس در هر شاخص، برای واحدهای ناکارا محاسبه می‌شود. از این تکنیک می‌توان در ارزیابی عملکرد شعب بانک‌ها، بیمه‌ها، ادارات، بیمارستان‌ها، مدارس، واحدهای صنعتی (تولیدی) و هر سازمانی که واحدهای صنفی داشته باشد استفاده نمود. یکی از مسائل مطرح در سال‌های اخیر در DEA، مسئله‌ی تخمین خروجی‌ها (ورودی‌ها) به هنگام تغییر ورودی‌ها (خروجی‌ها) است؛ این مسائل تحت عنوان مسائل DEA معکوس^۲ مطرح می‌شوند.

مسائل DEA معکوس، اولین بار توسط وی و همکاران^۳ (۲۰۰۰) مطرح شد؛ به این صورت که اگر در یک DMU، ورودی‌ها را به میزان معینی افزایش دهیم و بخواهیم کارایی ثابت بماند، چه مقدار خروجی باید تولید کنیم؛ مدل ارائه‌شده برای پاسخ به این سؤال را مدل DEA معکوس (Inverse DEA) می‌نامند. آن‌ها در مدل خود فرض نمودند که با افزایش سطوح ورودی، میزان کارایی DMU ثابت می‌ماند و سپس به تخمین خروجی‌ها پرداختند. آن‌ها مسئله DEA معکوس را به یک مسئله برنامه‌ریزی خطی چندهدفه تبدیل نموده و همچنین نشان دادند که در بعضی موارد خاص، مسئله DEA معکوس می‌تواند ساده شود و تبدیل به یک برنامه‌ریزی خطی تک هدفه گردد. یان و همکاران^۴ (۲۰۰۲) نتایج به‌دست‌آمده از مقاله وی و همکاران را با استفاده از نسبت DEA مخروطی توسعه و گسترش دادند؛ به عبارت دیگر آن‌ها مسئله DEA معکوس با ساختار نسبت مخروطی را مورد بررسی قرار دادند.

همان‌طور که بیان شد، مدل‌های DEA معکوس که توسط «وی» و «یان» مطرح شد، با فرض ثابت ماندن کارایی، به تخمین سطوح خروجی به هنگام افزایش سطوح ورودی می‌پرداخت؛ لذا جهان‌شاهلو و همکاران^۵ مدل ارائه‌شده توسط «یان» را گسترش دادند و مسئله تخمین خروجی‌ها به هنگام افزایش سطوح ورودی را با فرض بهبود سطح کارایی DMU موردنظر، موردبحث قرار دادند. هادی-ونچه و فروغی^۶ (۲۰۰۶) طی مقاله‌ای یک مدل کلی برای مسائل تخمین ورودی‌ها/خروجی‌ها ارائه دادند. در حقیقت، آنچه تاکنون به آن پرداخته‌شده بود فقط افزایش در سطوح ورودی و خروجی بود؛ درحالی‌که بعضی واحدها ممکن است در نظر داشته باشند علاوه بر افزایش سطوح ورودی/خروجی، بعضی سطوح ورودی/خروجی خود را کاهش دهند؛ این مبحث نسبت به مباحث قبلی، کلی‌تر می‌باشد. هادی-ونچه و فروغی در مقاله خود تغییرات دلخواه (افزایش یا کاهش) در سطوح ورودی (خروجی) را در نظر گرفتند و یک مدل برنامه‌ریزی خطی چندهدفه (MOLP) را برای تخمین سطوح خروجی (ورودی) پیشنهاد دادند. «وی» و همکاران به‌منظور تخمین سطوح خروجی (ورودی)، یک مدل MOLP را برای هنگامی که DMU تحت ارزیابی ناکاراست و نیز یک مدل برنامه‌ریزی خطی (LP) را برای DMU با کارایی ضعیف ارائه دادند. ولی مدلی که هادی-ونچه و فروغی ارائه دادند، نیاز به این طبقه‌بندی ندارد و قادر است سطوح ورودی و خروجی را بدون در نظر گرفتن نوع کارایی DMU (کارای قوی، کارای ضعیف، ناکارا) تخمین بزند. همچنین آن‌ها در مقاله خود نشان

¹ Decision Maker Unit (DMU)

² Inverse DEA

³ Wei et al.

⁴ Yan et al.

⁵ Jahanshahloo et al.

⁶ Hadi-Vencheh & Foroughi



که در مدل تخمین، ورودی ها یعنی محدودیت $\alpha_0 \geq X_0$ که در آن α_0 بردار ورودی های جدید و X_0 بردار ورودی های قبلی است و محدودیت $\beta_0 \geq y_0$ که در آن β_0 بردار خروجی های جدید و y_0 بردار خروجی های قبلی است باید حذف شود؛ در واقع آن ها یک مدل کلی برای تخمین سطوح ورودی/ خروجی ارائه دادند. همان طور که می دانیم، از مدل های DEA می توان برای تخمین سطوح خروجی (ورودی) یک واحد تصمیم گیرنده، هنگامی که همه یا بعضی از سطوح ورودی اش (خروجی اش) افزایش می یابد، با فرض ثابت ماندن کارایی و یا بهبود کارایی، بهره برد. حسین زاده و همکاران^۱ (۲۰۱۸) این ایده را برای داده های بازه ای، گسترش و تعمیم دادند؛ یعنی آن ها تحلیل پوششی داده ها (DEA) با داده های بازه ای را به کار برده اند تا تعیین کنند هنگام افزایش سطوح ورودی، چه مقدار خروجی باید تولید نمایند تا سطح کارایی DMU مورد نظر ثابت بماند و یا بهبود مورد نظر تصمیم گیرنده را داشته باشد. برای تخمین سطوح خروجی، دو مسئله برنامه ریزی خطی چندهدفه ارائه دادند که با حل آن، سطوح خروجی یا به عبارتی کران های بالا و پایین بازه های جدید سطوح خروجی را تخمین زدند. در واقع آن ها مدل ارائه شده توسط دسپوتیس و اسمیرلیس^۲ (۲۰۰۲) در زمینه تعیین کارایی واحدهای تصمیم گیرنده با داده های بازه ای را با مدل DEA معکوسی که توسط «وی» و همکاران ارائه شده بود ترکیب نموده و مدل جدیدی را برای تخمین سطوح خروجی واحدهای تصمیم گیرنده با داده های بازه ای به هنگام افزایش سطوح ورودی و با فرض ثابت ماندن یا بهبود کارایی ارائه دادند.

۲- مدل DEA با داده های بازه ای

فرض کنید n واحد تصمیم گیر به صورت $\{DMU_j; j = 1, \dots, n\}$ موجود است که هر کدام از m ورودی جهت تولید s خروجی استفاده می کنند (واحدهای تصمیم گیر متجانس می باشند). مقادیر داده های ورودی و خروجی واحدهای تصمیم گیر به صورت بازه های کران دار است؛ یعنی مقدار دقیق داده ها در اختیار نیست و به جای آن، کران بالا و پایین هر داده، تعیین شده است؛ به طوری که برای DMU_j ($j=1, \dots, n$) داریم $x_{ij}^l \leq x_{ij} \leq x_{ij}^u$ ($i=1, \dots, m$) یا به عبارت دیگر $x_{ij} \in [x_{ij}^l, x_{ij}^u]; i = 1, \dots, m; j = 1, \dots, n$ و نیز $y_{rj}^l \leq y_{rj} \leq y_{rj}^u$ یا به عبارت دیگر $y_{rj} \in [y_{rj}^l, y_{rj}^u]; r = 1, \dots, s; j = 1, \dots, n$ که در آن $x_{ij}^l, x_{ij}^u, y_{rj}^l, y_{rj}^u$ کران های پایین بازه ها و $x_{ij}^u, x_{ij}^l, y_{rj}^u, y_{rj}^l$ کران های بالای بازه ها می باشند؛ همچنین مقادیر آن ها ثابت و اکیداً مثبت فرض می شود و همیشه $x_{ij}^l \leq x_{ij}^u, y_{rj}^l \leq y_{rj}^u$ و اگر داشته باشیم $x_{ij}^l = x_{ij}^u, y_{rj}^l = y_{rj}^u$ ، آنگاه i آمین ورودی r آمین واحد تصمیم گیر، دارای مقدار دقیق و معینی است. حال اگر مدل CCR با داده های بازه ای را بخواهیم به صورت بازه ای نمایش دهیم، آنگاه:

$$\text{Max } \sum_{r=1}^s u_r [y_{rp}^l, y_{rp}^u]$$

s.t.

$$\sum_{i=1}^m v_i [x_{ip}^l, x_{ip}^u] = 1$$

از (۱)

طرفی با توجه به تعریف مفهوم ترکیبات محدب خواهیم داشت:

¹ Hosseinzadeh et al.
² Despotis & Smirlise

$$\text{Archive of SID} \quad \sum_{r=1}^s u_r [y_{rp}^l, y_{rp}^u] - \sum_{i=1}^m v_i [x_{ip}^l, x_{ip}^u] \leq 0$$

$$u_r, v_i \geq 0; r = 1, \dots, s; i = 1, \dots, m$$

$$x_{ij} = x_{ij}^l + \delta_{ij}(x_{ij}^u - x_{ij}^l) \quad , \quad 0 \leq \delta_{ij} \leq 1 \quad , \quad 1 \leq i \leq m \quad , \quad 1 \leq j \leq n$$

$$y_{rj} = y_{rj}^l + s_{rj}(y_{rj}^u - y_{rj}^l) \quad , \quad 0 \leq s_{rj} \leq 1 \quad , \quad 1 \leq r \leq s \quad , \quad 1 \leq j \leq n$$

(۲)



اگر روابط بالا را در معادله (۱) قرار دهیم، در نهایت معادله (۱) به صورت زیر حاصل خواهد شد:

$$\text{Max} \sum_{r=1}^s u_r [y_{rp}^l + s_{rp}(y_{rp}^u - y_{rp}^l)]$$

S.t.

$$\sum_{i=1}^m v_i [x_{ip}^l + \delta_{ip}(x_{ip}^u - x_{ip}^l)] = 1$$

$$\sum_{r=1}^s u_r [y_{rj}^l + s_{rj}(y_{rj}^u - y_{rj}^l)] - \sum_{i=1}^m v_i [x_{ij}^l + \delta_{ij}(x_{ij}^u - x_{ij}^l)] \leq 0; j = 1, \dots, n$$

(۳)

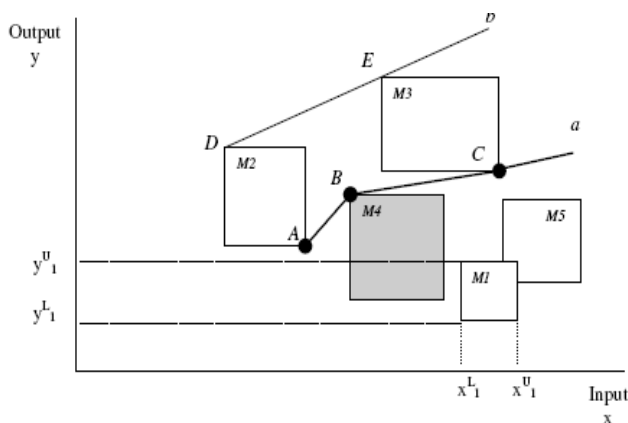
$$u_r \geq 0; r = 1, \dots, s$$

$$v_i \geq 0; i = 1, \dots, m$$

$$0 \leq \delta_{ip} \leq 1; i = 1, \dots, m$$

$$0 \leq s_{rp} \leq 1; r = 1, \dots, s$$

مدل (۳) یک مدل برنامه ریزی خطی است. حل این مسئله‌ی برنامه ریزی خطی تا حدودی دشوار است، لذا وقتی داده‌ها، بازه‌ای باشند، واحدها آزادند که هر مقدار در این بازه‌ها را اختیار کنند و امتیاز کارایی خود را ماکزیمم کنند. بعضی واحدها ممکن است در هر ترکیبی از مقادیر داخل بازه‌ها، کارا باشند و بعضی واحدهای دیگر ممکن است بسته به مقداری که اختیار می‌کنند، کارا یا ناکارا باشند. برای نشان دادن DEA بازه‌ای، یک مثال (شکل ۱) را با ۵ واحد M_1, M_2, \dots, M_5 که هر کدام دارای یک ورودی x و یک خروجی y می‌باشند، نشان می‌دهیم.



شکل ۱- نمایش مرز کارا با داده‌های بازه‌ای.

Figure 1- Efficient frontire with interval data.



کران پایین و بالایی برای کارایی DMU تحت ارزیابی در نظر گرفت؛ زیرا به ازای بعضی نقاط در بازه، واحد تحت ارزیابی، بیشترین مقدار کارایی و نیز به ازای بعضی نقاط دیگر، کمترین مقدار کارایی خود را اختیار می‌کند؛ بنابراین، کارایی واحد تحت ارزیابی در بازه‌ی $[\theta^L, \theta^U]$ قرار می‌گیرد که در آن θ^L ، کمترین مقدار کارایی و θ^U بیشترین مقدار کارایی واحد تحت ارزیابی است. در جدول ۱، معادلات در حالات پوششی و مضرپی CCR ورودی محور و خروجی محور نشان داده شده است.

جدول ۱- مدل‌های پوششی و مضرپی CCR ورودی محور.

Table 1- Envelopment and multiplier models of input-oriented of CCR.

مدل پوششی مضرپی CCR ورودی محور برای تعیین بیشترین مقدار کارایی	مدل پوششی CCR ورودی محور برای محاسبه کمترین مقدار کارایی واحد
$\text{Min } \theta$ s.t. $\sum_{j=1}^n \lambda_j x_{ij}^U + \lambda_p x_{ip}^L \leq \theta x_{ip}^U; i = 1, \dots, m$ $\sum_{j=1}^n \lambda_j y_{rj}^L + \lambda_p y_{rp}^U \geq y_{rp}^L; r = 1, \dots, s$ $\lambda_j \geq 0; j = 1, \dots, n$	$\text{Min } \theta$ s.t. $\sum_{j=1}^n \lambda_j x_{ij}^U + \lambda_p x_{ip}^L \leq \theta x_{ip}^L; i = 1, \dots, m$ $\sum_{j=1}^n \lambda_j y_{rj}^L + \lambda_p y_{rp}^U \geq y_{rp}^U; r = 1, \dots, s$ $\lambda_j \geq 0; j = 1, \dots, n$

۳- مدل کلی برای تخمین سطوح خروجی در DEA با داده‌های بازه‌ای

فرض کنید n واحد تصمیم‌گیرنده به صورت $\{DMU_j; j = 1, \dots, n\}$ موجود است که هر کدام از m ورودی جهت تولید s خروجی استفاده می‌کنند. مقادیر داده‌های ورودی و خروجی واحدهای تصمیم‌گیرنده به صورت بازه‌های کران‌دار هست یعنی مقدار دقیق داده‌ها در اختیار نیست و به جای آن کران بالا و پایین هر داده تعیین شده است. به طوری که برای DMU_j ($j=1, \dots, n$) داریم $x_{ij}^L \leq x_{ij} \leq x_{ij}^U$ ($i=1, \dots, m$) یا به عبارت دیگر $x_{ij} \in [x_{ij}^L, x_{ij}^U]; i = 1, \dots, m; j = 1, \dots, n$ و نیز $y_{rj}^L \leq y_{rj} \leq y_{rj}^U$ ($r=1, \dots, s; j = 1, \dots, n$) یا به عبارت دیگر $y_{rj} \in [y_{rj}^L, y_{rj}^U]; r = 1, \dots, s; j = 1, \dots, n$ که در آن x_{ij}^L, y_{rj}^L کران‌های پایین بازه‌ها و x_{ij}^U, y_{rj}^U کران‌های بالای بازه‌ها می‌باشند. نیز مقادیر آن‌ها ثابت و اکیداً مثبت فرض می‌شود و همیشه $x_{ij}^L \leq x_{ij}^U$ و $y_{rj}^L \leq y_{rj}^U$ و اگر داشته باشیم $x_{ij}^L = x_{ij}^U$ ، آنگاه i امین ورودی z امین واحد تصمیم‌گیرنده دارای مقدار دقیق و معینی است. واحد تحت ارزیابی p ام یعنی DMU_p را در نظر بگیرید. فرض می‌شود که ورودی‌های این واحد یا به عبارت دیگر کران‌های پایین و بالای ورودی‌های DMU_p یعنی x_{ip}^L و x_{ip}^U ($i=1, \dots, m$) به ترتیب به میزان Δx_{ip}^L و Δx_{ip}^U ($i=1, \dots, m$) تغییر (افزایش یا کاهش) یافته‌اند. لذا مقادیر جدید ورودی DMU_p به صورت $\alpha_{ip}^L = x_{ip}^L + \Delta x_{ip}^L; i = 1, \dots, m$ و $\alpha_{ip}^U = x_{ip}^U + \Delta x_{ip}^U; i = 1, \dots, m$ خواهد بود با به عبارت دیگر مقادیر ورودی جدید به صورت بازه‌ی کران‌دار $[\alpha_{ip}^L, \alpha_{ip}^U]; i=1, \dots, m$ ، هست. در این صورت در نظر داریم مقادیر جدید خروجی DMU_p را با فرض ثابت ماندن کارایی و نیز بهبود سطح کارایی DMU_p تخمین بزنیم.

فرض می‌کنیم که $\beta_p = (\beta_{1p}, \dots, \beta_{rp}, \dots, \beta_{sp})$ مقادیر جدید خروجی DMU_p باشد. در این صورت خواهیم داشت:

$$\begin{aligned} \text{Max } \beta_p &= (\beta_{1p}, \dots, \beta_{rp}, \dots, \beta_{sp}) \\ \sum_{j=1}^n \lambda_j [x_{ij}^L, x_{ij}^U] &\leq [\alpha_{ip}^L, \alpha_{ip}^U]; i = 1, \dots, m \\ \sum_{j=1}^n \lambda_j [y_{rj}^L, y_{rj}^U] &\geq [\phi^L, \phi^U] \beta_{rp}; r = 1, \dots, s \\ \lambda_j &\geq 0; j = 1, \dots, n \end{aligned} \tag{4}$$

چون داده‌ها بازه‌ای می‌باشند مقادیر جدید خروجی را به صورت بازه‌های کران دار؛ $r=1, \dots, s$; $[\beta_{rp}^L, \beta_{rp}^U]$ که توسط جفت مدل‌های زیر که با استفاده از مدل‌های DEA بازه‌ای ارائه شده تخمین می‌زنیم.

جدول ۲ - محاسبه بیشترین و کمترین مقدار خروجی DMUP.

Table 2- Maximum and minimum of the output value of DMUP.

محاسبه بیشترین مقدار خروجی DMU_p هنگامی که داده‌های ورودی و خروجی‌اش به صورت بازه‌ای هست	محاسبه کمترین مقدار خروجی DMU_p هنگامی که داده‌های ورودی و خروجی‌اش به صورت بازه‌ای هست
$\text{Max } \beta_p^L = (\beta_{1p}^L, \beta_{2p}^L, \dots, \beta_{sp}^L)$ <p>s.t.</p> $\sum_{\substack{j=1 \\ j \neq p}}^n \lambda_j x_{ij}^L + \lambda_p x_{ip}^U \leq \alpha_{ip}^U; i = 1, \dots, m$ $\sum_{j=1}^n \lambda_j y_{rj}^U + \lambda_p y_{rp}^L \leq (1 - \frac{\eta}{100}) \phi^L \beta_{rp}^L; r = 1, \dots, s$ $\lambda_j \geq 0; j = 1, \dots, n$	$\text{Max } \beta_p^U = (\beta_{1p}^U, \beta_{2p}^U, \dots, \beta_{sp}^U)$ <p>s.t.</p> $\sum_{\substack{j=1 \\ j \neq p}}^n \lambda_j x_{ij}^U + \lambda_p x_{ip}^L \leq \alpha_{ip}^L; i = 1, \dots, m$ $\sum_{j=1}^n \lambda_j y_{rj}^L + \lambda_p y_{rp}^U \leq (1 - \frac{\eta}{100}) \phi^U \beta_{rp}^U; r = 1, \dots, s$ $\lambda_j \geq 0; j = 1, \dots, n$
(۴)	(۵)

مقادیر ϕ^L و ϕ^U مقادیر کارایی هستند که با حل جفت مدل‌های ارائه شده در روابط (۵) و (۶) به دست می‌آید مدل‌های خطی چندهدفه می‌باشند که برای حل آن‌ها می‌توان به کمک روش‌های تصمیم‌گیری و استفاده از نظرات افراد تصمیم‌گیرنده به هر شاخص خروجی وزنی را که نشان‌دهنده ارزش و اهمیت آن شاخص می‌باشد ارائه داد و سپس با استفاده از مجموع موزون تابع هدف را به صورت خطی نوشت. فرض کنید که $w_r; r=1, \dots, s$ وزن‌های اختصاص داده شده به هر شاخص خروجی باشند. در این صورت توابع هدف مدل‌های و را به ترتیب می‌توان به صورت

$$\sum_{r=1}^s w_r \beta_{rp}^U \text{ و } \sum_{r=1}^s w_r \beta_{rp}^L \text{ نوشت.}$$

در دو مدل بالا فرض شده که ضمن افزایش ورودی‌ها سطح کارایی DMU_p ثابت می‌ماند. اگر تصمیم‌گیر در نظر داشته باشد که ضمن افزایش ورودی‌ها، سطح کارایی واحد تحت ارزیابی را نیز به میزان η بهبود دهد، کافی است در مدل مربوط به محاسبه بیشترین مقدار در سمت راست محدودیت دوم به جای عبارت $\phi^U \beta_{rp}^U$ ، عبارت $(1 - \eta) \phi^U \beta_{rp}^U$ قرار دهد.

Archive of θ^L/β_{rp}^L را قرار دهیم در مدل مربوط به محاسبه کمترین مقدار در محدودیت دوم به جای عبارت θ^L/β_{rp}^L عبارت $\theta^L/\beta_{rp}^L(1 - \theta^L/100)$ را قرار می‌دهیم.



واحد تحت ارزیابی p ام یعنی DMU_p را در نظر بگیرید. فرض می‌شود که خروجی‌های این واحد یا به عبارت دیگر کران‌های پایین و بالای خروجی‌های DMU_p یعنی y_{rp}^L و y_{rp}^U ($r=1, \dots, s$) به ترتیب به میزان Δy_{rp}^L و Δy_{rp}^U ($r=1, \dots, s$) تغییر یافته‌اند لذا مقادیر جدید خروجی DMU_p به صورت $\beta_{rp}^U = y_{rp}^U + \Delta y_{rp}^U$; $r = 1, \dots, s$ و $\beta_{rp}^L = y_{rp}^L + \Delta y_{rp}^L$; $r = 1, \dots, s$ خواهد بود با به عبارت دیگر مقادیر خروجی جدید به صورت بازه‌ی کران‌دار $[\beta_{rp}^L, \beta_{rp}^U]$ است. در این صورت در نظر داریم مقادیر جدید ورودی DMU_p را با فرض ثابت ماندن کارایی و نیز بهبود سطح کارایی DMU_p تخمین بزنیم.

چون داده‌ها بازه‌ای می‌باشند مقادیر جدید ورودی را به صورت بازه‌های کران‌دار $[\alpha_{ip}^L, \alpha_{ip}^U]$ $i=1, \dots, m$ ، توسط جفت مدل‌های زیر که با استفاده از مدل‌های DEA بازه‌ای ارائه شده تخمین می‌زنیم.

جدول ۳- محاسبه بیشترین و کمترین مقدار ورودی DMU_p .

Table 3- Maximum and minimum of the input value of DMU_p .

محاسبه بیشترین مقدار ورودی DMU_p هنگامی که داده‌های ورودی و خروجی‌اش به صورت بازه‌ای هست	محاسبه کمترین مقدار ورودی DMU_p هنگامی که داده‌های ورودی و خروجی‌اش به صورت بازه‌ای هست
$\text{Min } \sum_{i=1}^m w_i \alpha_{ip}^U =$ $\text{s.t. } \alpha_p^L = (\alpha_{1p}^L, \alpha_{2p}^L, \dots, \alpha_{mp}^L)$ $\sum_{j=1}^n \lambda_j x_{ij}^L + \lambda_p x_{ip}^U \leq (1 + \frac{\delta}{100}) \theta^L \alpha_{ip}^U; i=1, \dots, m$ $\sum_{j=1}^n \lambda_j y_{rj}^U + \lambda_p y_{rp}^L \leq \beta_{rp}^L; r=1, \dots, s$ $\lambda_j \geq 0; j=1, \dots, n$	$\text{Min } \alpha_p^U = (\alpha_{1p}^U, \alpha_{2p}^U, \dots, \alpha_{mp}^U) = \sum_{i=1}^m w_i \alpha_{ip}^L$ $\text{s.t. } \alpha_p^U = (\alpha_{1p}^U, \alpha_{2p}^U, \dots, \alpha_{mp}^U)$ $\sum_{j=1}^n \lambda_j x_{ij}^U + \lambda_p x_{ip}^L \leq (1 + \frac{\delta}{100}) \theta^U \alpha_{ip}^L; i=1, \dots, m$ $\sum_{j=1}^n \lambda_j y_{rj}^L + \lambda_p y_{rp}^U \leq \beta_{rp}^U; r=1, \dots, s$ $\lambda_j \geq 0; j=1, \dots, n$

۵- مطالعه موردی

از آنجاکه بانک‌ها از بخش‌های اثرگذار در توسعه و پیشرفت هر کشور هستند، منابع ویژه‌ای به آن‌ها اختصاص داده می‌شود و تحت نظارت و کنترل ویژه‌ای می‌باشند. از این رو، ارزیابی عملکرد بانک‌ها از اهمیت بسیاری برخوردار است. عدم کارایی در بانکداری، منجر به اشکالات و موانعی در توسعه‌ی بازار سرمایه خواهد شد. با پیگیری‌های فراوان، توانستیم اطلاعات مربوط به یکی از بانک‌های کشور در سال ۱۳۹۷ را استخراج کنیم؛ این بانک دارای ۲۴ شعبه سرپرستی بوده است که همگی آن‌ها را در مطالعه مذکور، در نظر گرفته‌ایم. در جدول ۴، شاخص‌های ورودی و خروجی را بر اساس مطالعات میدانی و کتابخانه‌ای، استخراج کرده‌ایم:

داده‌های هریک از این شاخص‌های جدول ۴، در حالت قطعی و بعضاً به دلایل ابهام، به صورت بازه‌ای در نظر گرفته شد. در حالت بازه‌ای، با حل مدل‌ها و میزان کران‌های بالا و پایین کارایی ورودی محور، هریک از این شعب در مقایسه با یکدیگر، تعیین شد که در جدول ۱ نشان داده شده است. با توجه به حالت‌های مختلف ایجاد شده برای θ^L

می‌توانیم ارزیابی‌های مختلف زیر را داشته باشیم: www.SJD.ir

الف: اگر کران بالا و پایین کارایی هر DMU برابر یک باشد، آنگاه DMU کارا محسوب می شود (بوی مرز کارا قرار دارد).

$$E^{**} = [DMU ; \theta^L = \theta^U = 1] \quad (7)$$

ب: اگر واحدی در بهترین شرایط خود، کارا و در بدترین شرایط خود، ناکارا باشد، در این صورت نمی توان در مورد کارایی واحد تحت ارزیابی، به صراحت اظهار نظر نمود.

$$E^* = [DMU ; \theta^L < 1, \theta^U = 1] \quad (8)$$

جدول ۴- شاخص های ورودی و خروجی.

Table 4- Input and output indicators.

شاخص های ورودی	شاخص های خروجی
هزینه ها (هزینه های عملیاتی): این هزینه ها شامل هزینه های آب و برق، تلفن، اجاره ی محل (مکانی که شعبه در آن قرار دارد)، ملزومات اداری، هزینه های مربوط به کارکنان (حقوق)، هزینه های مربوط به دوره های آموزشی برای کارکنان و ... می باشد.	میزان جذب مشتریان جدید: این شاخص، بیان گر تعداد مشتری جدید است که در بازه های زمانی مشخص، توسط هر شعبه، جذب بانک شده است و نشان دهنده ی توانایی یک شعبه در جلب نظر مشتری و افتتاح حساب توسط وی می باشد و می تواند به تسهیلات و اعتباراتی که یک شعبه به مشتریان خود اختصاص می دهد، بستگی داشته باشد.
مطالبات (تسهیلات معوق): بانک به مشتری های خود تسهیلاتی اعم از وام، اعتبار و ... اعطا می کند؛ در واقع، مشتری در قبال بانک بدهکار خواهد شد؛ به این بدهی های مشتریان بانک در قبال تسهیلاتی که به آنها تعلق گرفته است، مطالبات معوق گفته می شود.	درآمدها: این شاخص، بیان گر مجموع مبالغی است که هر یک از شعب از طریق ارائه ی خدمات بانکی و تخصیص تسهیلات به مشتریان خود، دریافت می کند (درآمدهای یک شعبه شامل کارمزدهای بانکی، سود سرمایه گذاری ها، سود تسهیلات و ... می باشد). این شاخص برحسب میلیارد ریال بیان می شود.
پرداخت های انگیزشی: در آخر هر فصل (هر سه ماه یک بار)، در ازای بهره وری و کارایی هر شعبه، مبلغی به عنوان پاداش در اختیار رئیس شعبه قرار می گیرد و بر طبق تصمیم گیری وی، این مبلغ در بین کارکنان شعبه تقسیم می شود.	سپرده ها: این شاخص، بیان گر مجموع مبالغی است که هر یک از شعب، در بازه های زمانی مشخص از طریق جذب سپرده ها، اعم از سپرده های قرض الحسنه ی جاری، قرض الحسنه ی پس انداز، سرمایه گذاری های کوتاه مدت و بلندمدت، از مشتریان خود جمع آوری می کند.
خدمات الکترونیکی: کلیه ی خدماتی که بانک در ازای صدور انواع کارت های الکترونیکی به مشتریان خود ارائه می دهد، خدمات الکترونیکی گفته می شود.	بهره وری خالص ATM: این شاخص، بیان گر میزان سودآوری خودپردازهای نصب شده توسط هر شعبه می باشد.

ج: اگر کران بالا و کران پایین کارایی DMU، هر دو، کمتر از یک باشد، آنگاه واحد تحت ارزیابی، ناکارا خواهد بود.

$$E^- = [DMU ; \theta^L < 1, \theta^U < 1] \quad (9)$$

با توجه به موارد (الف) تا (ج)، می توان گفت واحدهای ۱، ۳، ۷، ۸، ۹، ۱۳، ۱۶، ۱۸، ۲۱، ۲۳ و ۲۴ کارایی می باشند. واحدهای ۲، ۵، ۱۰، ۱۲، ۱۴، ۱۷، ۱۹ و ۲۰ ناکارا می باشند و در کارا یا ناکارا بودن بقیه ی واحدها نمی توان به طور دقیق اظهار نظر نمود.

جدول ۵- میزان کارایی و کارایی بالا و پایین شعب تحت ارزیابی با داده های بازه ای.

Table 5- Efficiency and its upper lower branch of DMU under evaluation with interval data.

نام شعبه	میزان کارایی ورودی محور (θ^*)	میزان کارایی $[\theta^L, \theta^U]$	نام شعبه	میزان کارایی ورودی محور (θ^*)	میزان کارایی $[\theta^L, \theta^U]$
شعبه ۱	۱	[1 و 1]	شعبه ۱۳	۱	[1 و 1]
شعبه ۲	0.51	[0.68 و 0.74]	شعبه ۱۴	0.73	[0.47 و 0.52]
شعبه ۳	۱	[0.67 و 1]	شعبه ۱۵	0.89	[1 و 1]
شعبه ۴	۱	[1 و 1]	شعبه ۱۶	۱	[0.99 و 1]
شعبه ۵	0.96	[0.84 و 0.90]	شعبه ۱۷	0.87	[0.93 و 0.96]
شعبه ۶	1	[1 و 1]	شعبه ۱۸	1	[0.907 و 1]
شعبه ۷	1	[0.88 و 0.89]	شعبه ۱۹	0.88	[1 و 1]
شعبه ۸	1	[0.81 و 0.82]	شعبه ۲۰	0.82	[1 و 1]
شعبه ۹	0.9	[1 و 1]	شعبه ۲۱	1	[1 و 1]
شعبه ۱۰	1	[0.93 و 1]	شعبه ۲۲	1	[0.79 و 0.90]
شعبه ۱۱	0.77	[1 و 1]	شعبه ۲۳	1	[0.834 و 1]
شعبه ۱۲	1	[1 و 1]	شعبه ۲۴	1	[0.73 و 0.76]

تجزیه و تحلیل را می توانیم برای همه شعب انجام دهیم؛ لیکن در حال حاضر، فقط برای واحد تحت ارزیابی دوم که یک واحد ناکاراست، انجام می دهیم. مدل مسئله را می توانیم به صورت روابط زیر بنویسیم. میزان کارایی در بازه (۰/۴۷ و ۰/۵۲) می باشد.

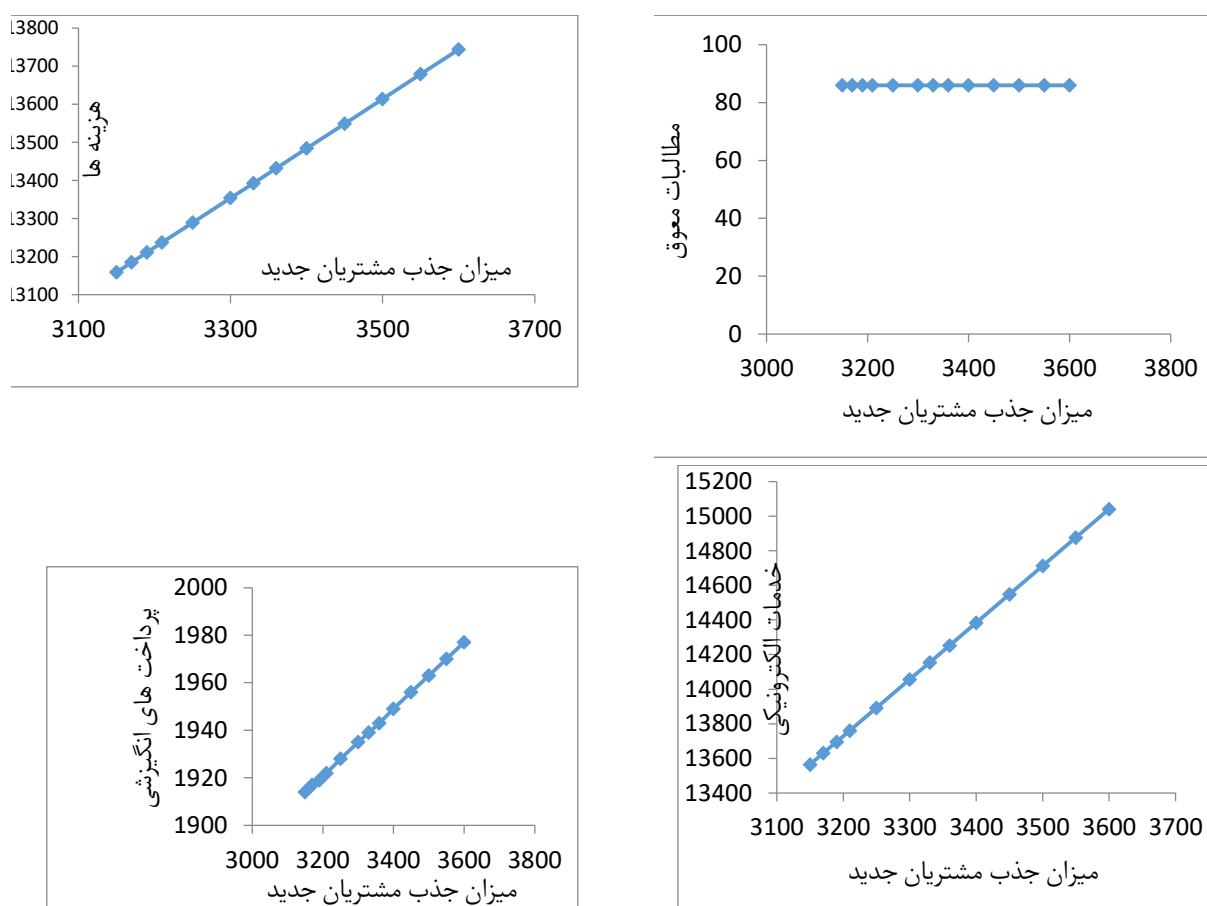
$$\begin{aligned}
 & \text{Min } w_1 \alpha_{12}^L + w_1 \alpha_{22}^L + w_1 \alpha_{32}^L + w_1 \alpha_{42}^L \\
 & \text{S.t.} \\
 & \sum_{j=2}^{24} \lambda_j x_{1j}^U + 13000 \lambda_2 \leq 0.52987 \alpha_{12}^L \\
 & \sum_{j=2}^{24} \lambda_j x_{2j}^U + 145.90 \lambda_2 \leq 0.52987 \alpha_{22}^L \\
 & \sum_{j=2}^{24} \lambda_j x_{3j}^U + 1732 \lambda_2 \leq 0.52987 \alpha_{32}^L \\
 & \sum_{j=2}^{24} \lambda_j x_{4j}^U + 15110 \lambda_2 \leq 0.52987 \alpha_{42}^L \\
 & \sum_{j=1}^{24} \lambda_j y_{1j}^L + 3300 \lambda_2 \leq \beta_{12}^U
 \end{aligned}$$

(۱۰)



$$\begin{aligned}
 \text{Archive of } & \sum_{j=1}^{24} \lambda_j y_{1j}^L + 495130.90 \lambda_2 \leq \beta_{22}^U \\
 & \sum_{j=1}^{24} \lambda_j y_{3j}^L + 4472 \lambda_2 \leq \beta_{32}^U \\
 & \sum_{j=1}^{24} \lambda_j y_{4j}^L + 153.95 \lambda_2 \leq \beta_{42}^U \\
 & \lambda_j \geq 0; j = 1, \dots, 24
 \end{aligned}$$

در شکل ۲، به ازای کران بالای شاخص خروجی، میزان جذب مشتریان جدید، میزان روند تغییرات کران پایین شاخص هزینه‌ها، روند تغییرات کران پایین شاخص مطالبات معوق، روند تغییرات کران پایین شاخص پرداخت‌های انگیزشی و تغییرات کران پایین شاخص خدمات الکترونیکی نمایش داده شده است.



شکل ۲- روند تغییرات کران پایین شاخص‌های ورودی در ازای افزایش کران بالای شاخص جذب مشتریان جدید.

Figure 2- The trend of lower boundary changes of input indicators in exchange for increasing the upper boundary of new customer attraction index.

همان‌طور که مشاهده می‌گردد و البته انتظار هم داشتیم، از آنجایی که مقدار خروجی افزایش می‌یابد و فرض بر این است که میزان کارایی نیز ثابت بماند، لذا برآیند ورودی‌ها افزایش می‌یابد؛ این روند در نمودارها قابل مشاهده می‌باشد و متناسب با افزایش میزان جذب مشتری جدید، میزان تغییرات شاخص‌های ورودی به‌وضوح نشان داده شده است.

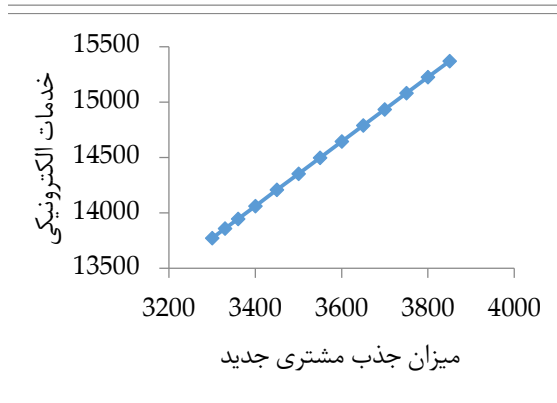
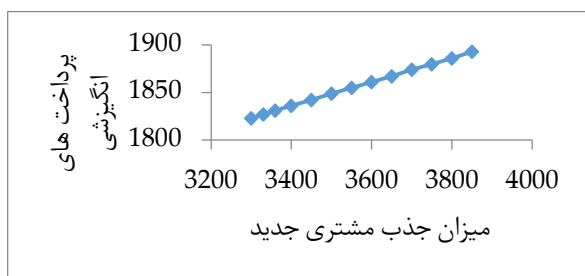
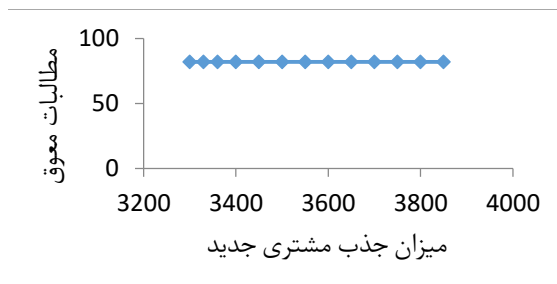
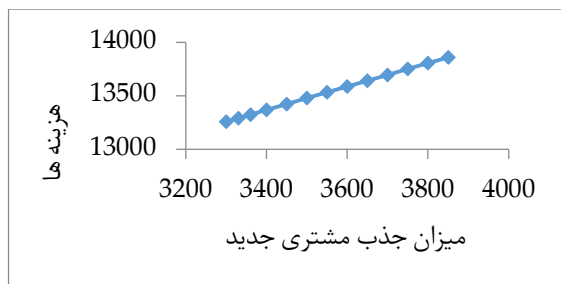


اگر $\beta_{42}^L, \beta_{32}^L, \beta_{22}^L, \beta_{12}^L$ مقادیر جدید خروجی برای واحد تحت ارزیابی دوم که یک واحد ناکاراست باشند (توسط تصمیم گیرنده تعیین می شوند)، حال می خواهیم $\alpha_{42}^U, \alpha_{32}^U, \alpha_{22}^U, \alpha_{12}^U$ بیشترین مقدار ورودی های این واحد را تخمین بزنیم. می دانیم میزان کارایی واحد دوم در بازه (0.52 و 0.47) می باشد و فرض بر ثابت ماندن کارایی در محاسبات می باشد که به کمک معادلات (۱۱) انجام می پذیرد.

$$\begin{aligned}
 & \text{Min } w_1 \alpha_{12}^U + w_1 \alpha_{22}^U + w_1 \alpha_{32}^U + w_1 \alpha_{42}^U \\
 & \text{S.t.} \\
 & \sum_{j=1}^{24} \lambda_j x_{1j}^L + 14000 \lambda_2 \leq 0.47904 \alpha_{12}^U \\
 & \sum_{j=1}^{24} \lambda_j x_{2j}^U + 149 \lambda_2 \leq 0.47904 \alpha_{22}^U \\
 & \sum_{j=1}^{24} \lambda_j x_{3j}^U + 1734.40 \lambda_2 \leq 0.47904 \alpha_{32}^U \\
 & \sum_{j=1}^{24} \lambda_j x_{4j}^U + 15170 \lambda_2 \leq 0.47904 \alpha_{42}^U \\
 & \sum_{j=1}^{24} \lambda_j y_{1j}^L + 3150 \lambda_2 \leq \beta_{12}^L \\
 & \sum_{j=1}^{24} \lambda_j y_{2j}^L + 495110.80 \lambda_2 \leq \beta_{22}^L \\
 & \sum_{j=1}^{24} \lambda_j y_{3j}^L + 4459 \lambda_2 \leq \beta_{32}^L \\
 & \sum_{j=1}^{24} \lambda_j y_{4j}^L + 1151.70 \lambda_2 \leq \beta_{42}^L \\
 & \lambda_j \geq 0; j = 1, \dots, 24
 \end{aligned} \tag{11}$$

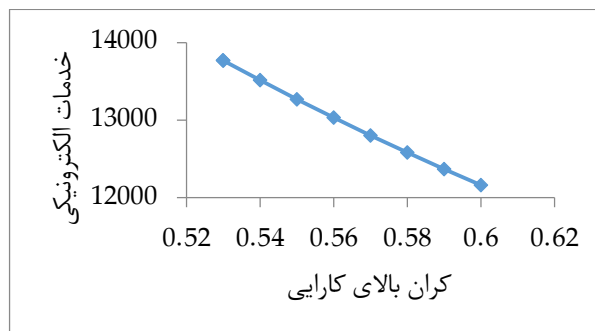
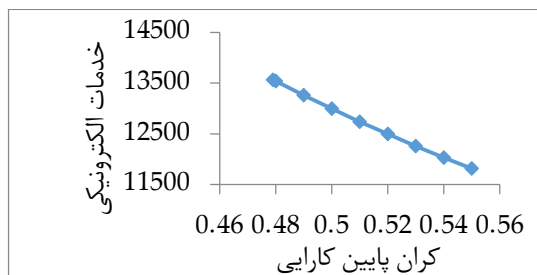
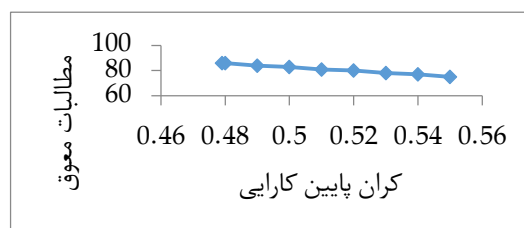
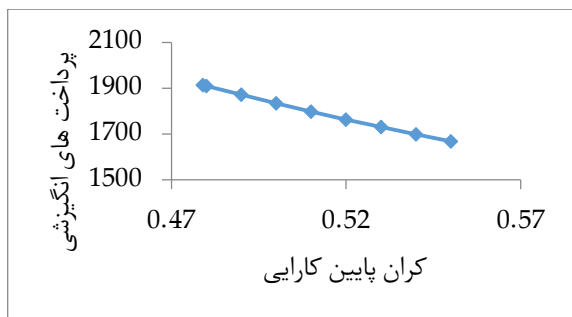
بر اساس مقادیر ۱۴۰۰۰، ۱۴۹، ۱۷۳۴/۴۰ و ۱۵۱۷۰، مقادیر کران های بالای ورودی ها و مقادیر ۳۱۵۰، ۴۴۵۹، ۴۹۵۱۱۰/۸۰ و ۱۱۵۱/۷۰، کران های پایین خروجی برای DMU_2 ، شکل ۳ روند تغییرات کران های بالای ورودی ها را به ازای تغییر در کران پایین شاخص خروجی میزان جذب مشتری جدید با فرض ثابت ماندن میزان کران پایین کارایی، نشان می دهد. همان طور که انتظار داریم، از آنجایی که مقدار خروجی افزایش می یابد و فرض بر این است که میزان کارایی ثابت بماند، لذا برآیند ورودی ها افزایش می یابد و این روند در نمودارها مشاهده می شود.

در اینجا در نظر داریم میزان کارایی واحد تحت ارزیابی را بهبود (افزایش) دهیم و با فرض ثابت ماندن سطوح خروجی، به تخمین سطوح ورودی پردازیم. با توجه به اینکه در نظر داریم کران بالای ورودی ها را تخمین بزنیم، لذا در مدل مربوطه، مقادیر خروجی را ثابت فرض کرده، از مقادیر جدید کارایی استفاده می نماییم و کران بالای ورودی ها را تخمین می زنیم؛ بنابراین، با توجه به اینکه کارایی، عبارت است از کسر مجموع موزون خروجی ها به مجموع موزون ورودی ها، چنانچه خروجی ها ثابت و سطح کارایی بهبود یابد، مطابق نمودارهای زیر، برآیند سطوح ورودی جدید نسبت به قبل، کاهش داشته است و این امر، در شکل ها ۳ و ۴ قابل مشاهده است.



شکل ۳- روند تغییرات کران بالای شاخص ورودی در ازای افزایش کران پایین شاخص خروجی میزان جذب مشتریان جدید.

Figure 3- The trend of changes in the upper limit of the input index in exchange for increasing the lower limit of the output index, the rate of attracting new customers.



شکل ۴ - روند تغییرات شاخص خروجی‌ها در ازای افزایش کران پایین کارایی.

Figure 4- The trend of changes in the output index in exchange for increasing the lower efficiency limit.



نتیجه‌گیری

امروزه محاسبه کارایی و چگونگی روند حرکت هر سازمان، یکی از مهم‌ترین مسائل مدیریت کلان آن سازمان می‌باشد. یکی از مسائلی که در این مقاله بیشتر مورد توجه قرار گرفته است، مسئله‌ی تصمیم‌گیری و پیش‌بینی است؛ به‌گونه‌ای که بعد از استفاده از مدل‌های تحلیل پوششی داده‌ها برای تعیین سطح کارایی واحدهای تحت ارزیابی، از مدل‌های تحلیل پوششی داده‌های معکوس یعنی مدل‌هایی که جهت تخمین سطوح ورودی و خروجی استفاده می‌شود، بهره گرفته شده است تا بتوان تصمیمات و برنامه‌ریزی‌های مدیران را اعمال نمود.

پیشنهادهایی برای تحقیقات آتی

در این تحقیق در دو حالت قطعی و بازه‌ای، مسئله تخمین ورودی‌ها و خروجی‌ها را اعمال کردیم ولی تاکنون مسئله برای ساختار شبکه‌ای بررسی نشده است.

منابع

- Despotis, D. K., & Smirlise, Y., (2002). Data envelopment analysis with imprecise data. *European journal of operational research*, 140(1), 24-36.
- Hadi-Vencheh, A., & Foroughi, A. A. (2006). A generalized DEA model for inputs/outputs estimation. *Mathematical and computer modelling*, 43(5-6), 447-457.
- Hosseinzadeh, A. A., Alahviranloo, T., Hosseinzadeh Loti, F., & Vaez-Ghasemi, M. (2018). Solving fully interval linear programming problems. (In press)
- Jahanshahloo, G. R., Lofti, F. H., & Moradi, M. (2004). Sensitivity and stability analysis in DEA with interval data. *Applied mathematics and computation*, 156(2), 463-477.
- Jahanshahloo, G. R., Matin, R. K., & Vencheh, A. H. (2004). On FDH efficiency analysis with interval data. *Applied mathematics and computation*, 159(1), 47-55.
- Jahanshahloo, G. R., Matin, R. K., & Vencheh, A. H. (2004). On return to scale of fully efficient DMUs in data envelopment analysis under interval data. *Applied mathematics and computation*, 154(1), 31-40.
- Wei, Q., Zhang, J., & Zhang, X. (2000). An inverse DEA model for inputs/outputs estimate. *European journal of operational research*, 121(1), 151-163.
- Yan, H., Wei, Q., & Hao, G. (2002). DEA models for resource reallocation and production input/output estimation. *European journal of operational research*, 136(1), 19-31.

