

شاخص‌های کارآئی تکنیکی جزیی و کلی در تحلیل پوششی داده‌ها

سهراب کردرستمی^{۱*}، علیرضا امیر تیموری^۲

^(۱) استاد گروه ریاضی کاربردی، واحد لاهیجان، دانشگاه آزاد اسلامی، لاهیجان، ایران

^(۲) استاد گروه ریاضی کاربردی، واحد رشت، دانشگاه آزاد اسلامی، رشت، ایران

تاریخ دریافت مقاله: زمستان ۱۳۹۴ تاریخ پذیرش مقاله: بهار ۱۳۹۵

چکیده

تحلیل پوششی داده‌ها (*DEA*) یک روش غیرپارامتری است که کارآئی نسبی مجموعه‌ای از واحدهای تصمیم‌گیری (*DMU*) متجانس با چندین ورودی و چندین خروجی را اندازه می‌گیرد. این روش اولین بار توسط چارنر و همکاران (۱۹۷۸) معرفی شد. در ارزیابی مدل‌های *DEA* فرض بر این است که همه ورودی‌ها به‌طور مشترک برای تولید همه خروجی‌ها مصرف می‌شوند. این درحالی است که اغلب اوقات همه ورودی‌ها در تولید همه خروجی‌ها نقش ندارند. یک مثال ساده از چنین وضعیتی را می‌توان در شرکت‌های گاز به‌عنوان واحدهای تصمیم‌گیری مشاهده کرد. شرکت‌های گاز در ایران به صورت استانی اداره می‌شوند و هر یک از شرکت‌های گاز استانی به‌عنوان یک واحد تصمیم‌گیری ورودی‌هایی نظیر پرسنل، هزینه و سرمایه را برای تولید خروجی‌هایی نظیر تعداد مشترکین، حجم شبکه‌گذاری، حجم گاز و ... مصرف می‌کنند. در این فرایند بخشی از پرسنل جهت مشترکین، بخش دیگری در قسمت شبکه‌گذاری و ... مشغول هستند. به‌طور منطقی در یک فرایند تولید، هر ورودی لزوماً در تولید هر یک از خروجی‌ها نقش ندارد. بر این باوریم که بخشی از هر ورودی برای تولید هر خروجی مصرف می‌شود.

هدف: هدف این مقاله تعیین قدرالسهمی برای هر خروجی از هر ورودی در جهت افزایش کارایی نسبی واحدهای تصمیم‌گیری می‌باشد. در مدلی که ارایه خواهد شد سهم هر خروجی از هر ورودی جهت بهینه کردن اندازه کارایی کلی واحدها تعیین خواهد شد.

روش بررسی: برای نیل به هدف از تکنیک‌های غیرپارامتری و به ویژه تکنیک *DEA* استفاده خواهد شد.

نتایج: مقاله مدلی ارائه می‌کند که به کمک آن علاوه بر این که سهم هر ورودی در تولید هر خروجی تعیین می‌شود، عملکرد واحدهای تصمیم‌گیری در تولید هر خروجی نیز محاسبه می‌شوند. به‌عبارت دیگر برای هر خروجی یک شاخص کارآئی تعیین می‌شود که ترکیب محدب این شاخص‌ها، کارآئی کلی واحد تحت ارزیابی را می‌سازد.

واژه‌های کلیدی: تحلیل پوششی داده‌ها، کارآئی تکنیکی، کارایی جزیی، ورودی-خروجی.

۱- مقدمه

تحلیل پوششی داده‌ها (DEA) یک روش غیرپارامتری است که کارائی نسبی مجموعه‌ای از واحدهای تصمیم‌گیری (DMU) متجانس با چندین ورودی و چندین خروجی را اندازه می‌گیرد. این روش اولین بار توسط چارلز و همکاران (۱۹۷۸) معرفی شد. در ارزیابی مدل‌های DEA فرض بر این است که همه ورودی‌ها به طور مشترک برای تولید همه خروجی‌ها مصرف می‌شوند. چارلز کوپر و رودز (۱۹۷۸) نخستین بار صورت خطی شده مدل CCR را به صورت زیر معرفی کردند:

$$[CCR] \\ \text{Max } e_0 = \sum_{r=1}^s u_r y_{r0} \\ \text{subject to:} \\ \sum_{i=1}^m v_i x_{i0} = 1, \\ \sum_{r=1}^s u_r y_{rj} - \sum_{i=1}^m v_i x_{ij} \leq 0, \quad (1) \\ j = 1, \dots, n \\ u_r, v_i \geq \varepsilon, \quad r = 1, \dots, s, \quad i = 1, \dots, m$$

که در آن $DMU_j: j = 1, \dots, n$ ورودی‌های $x_{ij}: i = 1, \dots, m$ را جهت تولید خروجی‌های $y_{rj}: r = 1, \dots, s$ مصرف می‌کند. این در حالی است که اغلب اوقات همه ورودی‌ها در تولید همه خروجی‌ها نقش ندارند. یک مثال ساده از چنین وضعیتی را می‌توان در شرکت‌های گاز به‌عنوان واحدهای تصمیم‌گیری مشاهده کرد. شرکت‌های گاز در ایران به‌صورت استانی اداره می‌شوند و هر یک از شرکت‌های گازی استانی به‌عنوان یک واحد تصمیم‌گیری ورودی‌هایی نظیر پرسنل، هزینه و سرمایه را برای تولید خروجی‌هایی نظیر تعداد مشترکین، حجم شبکه‌گذاری، حجم گاز و ... مصرف می‌کنند. در این فرایند بخشی از پرسنل جهت مشترکین، بخش دیگری در قسمت شبکه‌گذاری و ... مشغول هستند. مطالعات اولیه در خصوص تعیین سهم ورودی‌ها برای خروجی‌ها و اندازه‌گیری کارایی مولفه‌ای توسط بیزلی (۱۹۹۵)، فیر و گروسکوف (۱۹۹۶)، کوک و همکاران (۲۰۰۰) انجام گرفت. فیر و گروسکوف (۱۹۹۶)، مسأله تولید را به‌عنوان یک فرایند چند مرحله‌ای در نظر گرفتند که در آن خروجی یک مؤلفه به‌عنوان ورودی مؤلفه بعدی در نظر گرفته می‌شد. در مدل آن‌ها تنها یک شاخص

کارائی کلی برای هر واحد تصمیم‌گیری به‌دست می‌آید. کوک و همکاران در درون هر واحد تصمیم‌گیری دو مولفه در نظر گرفتند که این دو مولفه، جدا از هم، هر کدام ورودی‌هایی را برای تولید خروجی‌هایی مصرف می‌کردند و تمام مولفه‌ها در مصرف یک ورودی سهم بودند. مدل مطرح شده توسط کوک و همکاران به گونه‌ای بود که علاوه بر کارائی کلی، کارائی مؤلفه‌های سازای یک واحد تصمیم‌گیری نیز به دست می‌آمد، در ادامه، مطالعات متعددی در این زمینه صورت گرفت که از جمله آن‌ها می‌توان به کارهای جهان‌شاهلو و همکاران (۲۰۰۳)، کوک و همکاران (۲۰۰۴) اشاره کرد. در این مقاله از منظر دیگری به موضوع پرداخته می‌شود. به طور منطقی در یک فرایند تولید، هر ورودی لزوماً در تولید هر یک از خروجی‌ها نقش ندارد. بر این باوریم که بخشی از هر ورودی برای تولید هر خروجی مصرف می‌شود.

هدف این مقاله ارائه مدلی است که به کمک آن علاوه بر این که سهم هر ورودی در تولید هر خروجی تعیین می‌شود، عملکرد واحدهای تصمیم‌گیری در تولید هر خروجی نیز محاسبه می‌شوند. به‌عبارت دیگر برای هر خروجی یک شاخص کارائی تعیین می‌شود که ترکیب محدب این شاخص‌ها، کارائی کلی واحد تحت ارزیابی را می‌سازد. سازماندهی بخش‌های بعدی مقاله به صورت زیر است:

بخش بعدی به معرفی روش پیشنهادی می‌پردازد. در بخش سوم یک مثال عددی ارائه خواهد شد و در بخش چهارم نتیجه‌گیری ارائه می‌شود.

۲- تفکیک کارائی و تعیین سهم

خروجی‌ها از ورودی‌ها

فرض کنید n واحد تصمیم‌گیری هر کدام با m ورودی و s خروجی مورد نظر هستند. در حالت خاص DMU_0 ، ورودی‌های $x_{i0}: i = 1, \dots, m$ را جهت تولید خروجی‌های $y_{r0}: r = 1, \dots, s$ مصرف می‌کند. همان گونه که ذکر شد هدف به دست آوردن میزان کارائی خروجی I^j ام و تعیین سهم هر خروجی از منابع ورودی است. برای تولید هر یک از خروجی‌های $y_{r0}: r = 1, \dots, s$ ، سهمی از ورودی I^j ام x_{i0} مصرف می‌شود، فرض می‌کنیم میزانی

قضیه ۱- کارائی تجمعی $e_o^{(a)}$ را می‌توان به صورت ترکیب محدب کارائی‌های جزئی $e_o^{(r)}$ ها نمایش داد. **برهان:** برای نشان دادن مطلب فوق کافی است قرار دهیم.

$$\mu_r = \frac{\sum_{i=1}^m v_i (\gamma_{ir} x_{io})}{\sum_{i=1}^m v_i x_{io}}, \quad r = 1, \dots, s$$

از این رو خواهیم داشت

$$\sum_{r=1}^s \mu_r e_o^{(r)} = \left[\frac{\sum_{r=1}^s \frac{\sum_{i=1}^m v_i (\gamma_{ir} x_{io})}{\sum_{i=1}^m v_i x_{io}} \times \frac{u_r y_{ro}}{\sum_{i=1}^m v_i (\gamma_{ir} x_{io})}}{\sum_{i=1}^m v_i x_{io}} \right]$$

$$= \frac{\sum_{r=1}^s u_r y_{ro}}{\sum_{i=1}^m v_i x_{io}} = e_o^{(a)}$$

$$\sum_{r=1}^s \mu_r = \sum_{r=1}^s \frac{\sum_{i=1}^m v_i (\gamma_{ir} x_{io})}{\sum_{i=1}^m v_i x_{io}} = \frac{\sum_{i=1}^m v_i x_{io} \sum_{r=1}^s \gamma_{ir}}{\sum_{i=1}^m v_i x_{io}} = 1$$

این به این معنی است که $e_o^{(a)} = \sum_{r=1}^s \mu_r e_o^{(r)}$ ، این به این معنی است که $\mu_r \geq 0$ و $\sum_{r=1}^s \mu_r = 1$ و حکم حاصل است. با در نظر گرفتن قضیه فوق منطقی است که برای ارزیابی DMU_o کارائی کلی آن را ماکزیم کنیم. این باعث می‌شود که مجموع توزین شده کارائی‌های جزئی بیشینه شود. برای پیشگیری از بیکران شدن مسأله، محدودیت نایبتر از یک بودن کارائی‌های جزئی را لحاظ می‌کنیم. لذا مسأله زیر را در نظر می‌گیریم:

از ورودی x_{io} که صرف تولید خروجی y_{ro} می‌شود برابر $\gamma_{ir} x_{io}$ باشد. γ_{ir} به نوعی مبین میزان سهم y_{ro} از ورودی x_{io} است. γ_{ir} ها را در آرایه ای نشانده و ماتریس Γ_o را به صورت زیر در نظر می‌گیریم:

$$\Gamma_o = \begin{bmatrix} \gamma_{11} & \gamma_{12} & \dots & \gamma_{1s} \\ \gamma_{21} & \gamma_{22} & \dots & \gamma_{2s} \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ \gamma_{i1} & \gamma_{i2} & \dots & \gamma_{is} \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ \gamma_{m1} & \gamma_{m2} & \dots & \gamma_{ms} \end{bmatrix}$$

Γ_o را ماتریس «تعیین سهم از منابع» می‌نامیم. به وضوح هر یک از بردارهای سطری این ماتریس باید نرمال باشند، به عبارت دیگر:

$$\sum_{r=1}^s \gamma_{ir} = 1, \quad i = 1, \dots, m.$$

بر این اساس می‌توانیم ادعا کنیم برای تولید خروجی $y_{ro}, r = 1, \dots, s$ ، ورودی‌های x_1, \dots, x_m هر کدام با سهم $\sum_{i=1}^m \gamma_{ir} x_{io}$ نقش دارند. شاخص کارائی جزئی خروجی r ام DMU_o را به صورت زیر تعریف می‌کنیم:

$$e_o^{(r)} = \frac{u_r y_{ro}}{\sum_{i=1}^m v_i (\gamma_{ir} x_{io})}, \quad r = 1, \dots, s, \quad (2)$$

این شاخص در حقیقت همان نسبت توزین شده خروجی r ام به مجموع توزین شده تمام ورودی‌هایی است که برای تولید y_{ro} مصرف می‌شوند. حال با استفاده از کارائی‌های جزئی فوق برای هر خروجی، کارائی کل DMU_o هماهنگ با ادبیات تحلیل پوششی داده‌ها به صورت زیر تعریف می‌شود:

$$e_o^{(a)} = \frac{\sum_{r=1}^s u_r y_{ro}}{\sum_{i=1}^m v_i x_{io}} \quad (3)$$

مدل (۶) هنوز یک مسأله برنامه‌ریزی غیرخطی است. برای خطی سازی آن، قرار می‌دهیم $\bar{v}_i \gamma_{ir} = \mu_{ir}$ ، $i = 1, \dots, m$ به این ترتیب مسأله برنامه‌ریزی غیر خطی (۶) به شکل زیر تبدیل خواهد شد:

$$\begin{aligned} \rho_0^* &= \text{Max} \sum_{r=1}^s \bar{u}_r y_{ro} \\ \text{s.t.} \quad & \sum_{i=1}^m \bar{v}_i x_{io} = 1, \\ & \bar{u}_r y_{rj} - \sum_{i=1}^m \mu_{ir} x_{ij} \leq 0, \\ & r=1, \dots, s, \quad j=1, \dots, n \\ & \sum_{i=1}^s \mu_{ir} = \bar{v}_i, \quad i=1, \dots, m \\ & \bar{v}_i \geq \varepsilon.t, \quad j=1, \dots, m \\ & \bar{u}_r \geq \varepsilon.t, \quad r=1, \dots, s \end{aligned} \quad (۷)$$

مدل (۷) یک مسأله برنامه‌ریزی خطی است که به آسانی با استفاده از نرم افزارهای برنامه‌ریزی خطی نظیر GAMS یا DS حل می‌شود. با حل مسأله برنامه‌ریزی خطی (۷)، اوزان بهینه \bar{u}_r^* ، μ_{ir}^* و t^* به دست می‌آیند. برای به دست آوردن وزن‌های بهینه u_r^* و v_i^* مدل (۶) و ماتریس تعیین سهم از منابع Γ_0 کافیست قرار دهیم:

$$\begin{aligned} u_r^* &= \bar{u}_r^* / t^*, \quad r=1, \dots, s, \\ v_i^* &= \bar{v}_i^* / t^*, \quad i=1, \dots, m, \\ \gamma_{ir}^* &= \mu_{ir}^* / \bar{v}_i^*, \quad i=1, \dots, m, \quad r=1, \dots, s, \end{aligned}$$

اگر فرض کنیم $\bar{v}_r = (\bar{v}_1^*, \dots, \bar{v}_m^*)$ ، $\bar{u}_r = (\bar{u}_1^*, \dots, \bar{u}_s^*)$ ، $M = [\gamma_{ir}]_{m \times s}$ ، $y_o = (y_{1o}, \dots, y_{so})$ ، $x_o = (x_{1o}, \dots, x_{mo})$ ، آن گاه بردار S تائی $M.x_o$ برداری است که مؤلفه r ام آن r مخرج کسر $e_o^{(r)}$ است.

۳- مثال عددی

چهار واحد تصمیم‌گیری A, B, C و D را در نظر بگیرید که هر کدام دو ورودی را برای تولید دو خروجی

$$\begin{aligned} \text{Max} \quad & e_o^{(a)} \\ \text{s.t.} \quad & e_o^{(r)} \leq 1, \quad r=1, \dots, s, \\ & u_r, v_i \geq 0, \quad \text{for all } i, r. \end{aligned} \quad (۴)$$

در مدل ارائه شده γ_{ir} و وزن‌های u_r و v_i مجهول هستند. با جایگذاری $e_o^{(a)}$ و $e_o^{(r)}$ ها از روابط (۲) و (۳) مسأله (۴) منجر به مسأله برنامه‌ریزی غیرخطی کسری زیر می‌شود:

$$\begin{aligned} \text{Max} \quad & \frac{\sum_{r=1}^s u_r y_{ro}}{\sum_{i=1}^m v_i x_{io}} \\ \text{s.t.} \quad & \frac{u_r y_{ro}}{\sum_{i=1}^m v_i (\gamma_{ir} x_{io})} \leq 1, \\ & r=1, \dots, s, \quad j=1, \dots, n \\ & \sum_{i=1}^s \gamma_{ir} = 1 \quad i=1, \dots, m \\ & v_i, \gamma_{ir}, u_r \geq 0 \quad \text{for all } i, r. \end{aligned} \quad (۵)$$

در مسأله (۵) γ_{ir} ها، u_r ها و v_i ها نامعلومند. این مجهولات به گونه‌ای تعیین می‌شوند که کارائی کلی DMU_0 بیشینه شود. به وضوح (۵) یک مسأله برنامه‌ریزی کسری غیرخطی است. ابتدا با استفاده از تبدیل چارنز و کوپر (۱۹۶۴) مسأله (۵) را به یک مسأله برنامه‌ریزی غیرکسری تبدیل می‌کنیم. برای این منظور قرار می‌دهیم $tu_r = \bar{u}_r$ ، $\sum_{i=1}^m v_i x_{io} = \frac{1}{t}$ و $tv_i = \bar{v}_i$. بنابر این مدل (۵) به شکل زیر تبدیل می‌شود:

$$\begin{aligned} \text{Max} \quad & \sum_{r=1}^s \bar{u}_r y_{ro} \\ \text{s.t.} \quad & \sum_{i=1}^m \bar{v}_i x_{io} = 1, \\ & \bar{u}_r y_{rj} - \sum_{i=1}^m \bar{v}_i (\gamma_{ir} x_{ij}) \leq 0, \\ & r=1, \dots, s, \quad j=1, \dots, n \\ & \sum_{i=1}^s \gamma_{ir} = 1 \quad i=1, \dots, m \\ & \bar{v}_i, \gamma_{ir}, \bar{u}_r \geq 0 \quad r=1, \dots, s, \quad j=1, \dots, n. \end{aligned} \quad (۶)$$

نتیجه‌گیری

در مدل‌های موجود تحلیل پوششی داده‌ها فرض بر این است که تمام ورودی‌ها در تولید تمامی خروجی‌ها نقش دارند. اما در بسیاری از کاربردهای عملی، حالاتی وجود دارد که همه ورودی‌ها در تولید هر خروجی شرکت نمی‌کنند بلکه بخشی از هر ورودی برای تولید هر خروجی به کار می‌رود و ممکن است بعضی ورودی‌ها هیچ نقشی در تولید بعضی خروجی‌ها نداشته باشند. در این مقاله بر حسب سهم هر ورودی جهت تولید هر خروجی، کارائی تکنیکی به کارائی‌های جزئی متناظر هر یک از خروجی‌های واحد تحت بررسی تفکیک شد. به کمک یک مسأله برنامه‌ریزی خطی، اندازه کارائی کلی و اندازه‌های کارائی جزئی واحدهای تصمیم‌گیری محاسبه شدند و برای هر واحد تصمیم‌گیری یک ماتریس تعیین سهم از منابع تعیین شد. همچنین نشان داده شد که اندازه کارائی کلی ترکیب محدبی از کارائی‌های جزئی است.

مصرف می‌کنند. با اجرای مدل‌های (۱) و (۷) دو واحد تصمیم‌گیری C و D کاراً ظاهر شدند و واحدهای A و B در هر دو مدل ناکاراً شدند. مقادیر کمی شاخص‌های ورودی و خروجی در جدول (۱) گنجانده شده است.

اندازه‌های کارایی کلی و جزئی حاصل از مدل (۷) و ماتریس تعیین سهم از منابع Γ_o , $o = A, B, C, D$ در جدول (۲) گنجانده شده‌اند. به عنوان مثال در جدول (۲) $\Gamma_B = \begin{bmatrix} 0.3077 & 0.6923 \\ 0.0625 & 0.9375 \end{bmatrix}$ را در نظر بگیرید. 0.3077 ٪ ورودی اول صرف تولید خروجی اول و 0.6923 ٪ ورودی اول صرف تولید خروجی دوم می‌شود. به همین ترتیب 0.0625 ٪ ورودی دوم صرف تولید خروجی اول و 0.9375 ٪ ورودی دوم صرف تولید خروجی دوم می‌شود. کارایی خروجی اول در DMU_B برابر 0.2778 و این شاخص برای خروجی دوم برابر یک محاسبه شد. کارایی کلی DMU_B نیز 0.8729 می‌باشد.

جدول (۱)، ورودی‌ها و خروجی‌ها

DMU	x_1	x_2	y_1	y_2
A	۳	۵	۶	۸
B	۴	۳	۵	۲۲
C	۳	۶	۱۴	۲۹
D	۲	۲	۱۳	۱۵

جدول (۲): اندازه‌های کارایی کلی و جزئی و ماتریس تعیین سهم

DMU	θ_{CCR}^*	ρ_o^*	جزئی ۱	جزئی ۲	ماتریس تعیین سهم
A	۰/۳۴۵۸	۰/۳۴۴۸	۰/۳۶۱۱	۰/۲۹۶۳	$\Gamma_A = \begin{bmatrix} 0.8889 & 0.1111 \\ 0.5556 & 0.4444 \end{bmatrix}$
B	۰/۸۹۷۶	۰/۸۷۲۹	۰/۲۷۷۸	۱	$\Gamma_B = \begin{bmatrix} 0.3077 & 0.6923 \\ 0.0625 & 0.9375 \end{bmatrix}$
C	۱	۱	۱	۱	$\Gamma_C = \begin{bmatrix} 0.3636 & 0.6364 \\ 0.0769 & 0.9231 \end{bmatrix}$
D	۱	۱	۱	۱	$\Gamma_D = \begin{bmatrix} 0.4444 & 0.5556 \\ 0.0278 & 0.9722 \end{bmatrix}$

مقدار کمیت نارشمیدوسی \mathcal{E} برابر 0.1 انتخاب شده است.

فهرست منابع

- [1] Charnes A., Cooper W.W. and Rodes E. European Journal of Operational Research. 2 (6), 429, (1978).
- [2] Beasley J. E. Journal of Operational Research Society. 46, 441, (1995).
- [3] Fare R. and Grosskof S. Economic Letters. 50 (1), 65, (1996).
- [4] Cook W. D., Hababou M. and Tuenter H. J. H., Journal of Productivity Analysis. 14, 209, (2000).
- [5] Jahanshahloo G. R., Amirteimoori A. R. and Kordrostami S. Applied Mathematics Computation. 155, 283, (2004).
- [6] Cook W. D. and Green R. H. European Journal of Operational Research. 157, 540, (2004).
- [7] Kordrostami S. and Amirteimoori A. R. Applied Mathematics Computation. 171, 721, (2005).

Archive of SID