

عنوان مقاله:

تبیین مدل ریسک سیستمیک با استفاده از معیار ریزش مورد انتظار نهایی در بانکهای پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار تهران

محل انتشار:

فصلنامه برنامه ریزی و بودجه، دوره 25، شماره 2 (سال: 1399)

تعداد صفحات اصل مقاله: 25

نویسندگان:

کوروش آسایش - *Ph.D. Student, Department of Financial Management, Qom Branch, Islamic Azad University, Qom, - Iran*

میرفیض فلاح شمس - *Associate Professor, Department of Financial Management, Central Tehran Branch, Islamic Azad University, Tehran, Iran*

حسین جهانگیرنیا - *Assistant Professor, Department of Accounting, Qom Branch, Islamic Azad University, Qom, Iran*

رضا غلامی جمکرانی - *Assistant Professor, Department of Accounting, Qom Branch, Islamic Azad University, Qom, Iran*

خلاصه مقاله:

هدف پژوهش حاضر، ارزیابی مدل ریسک سیستمیک ریزش مورد انتظار نهایی بانکهای پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار تهران است. جامعه پژوهش ۱۵ بانک از بین بانکهایی است که از تاریخ ۱۳۹۲ تا ۱۳۹۷ در بورس اوراق بهادار تهران یا فرابورس ایران پذیرفته شدهاند. نتایج تحلیلها نشان میدهند که ریسک سیستمی، بر اساس معیار ریزش مورد انتظار نهایی، در بازه مورد بررسی روند نزولی را طی میکند. با این حال، تحولات این شاخص را میتوان به دو زيردوره ۱۳۹۴-۱۳۹۲ و ۱۳۹۷-۱۳۹۵ تقسیمبندی کرد. در زيردوره اول، سطح ریسک سیستمی بر اساس این معیار بهطور معناداری بالاتر از سطح ریسک سیستمی در زيردوره دوم است، اما با گذر زمان در زيردوره دوم، بهطور متوسط به حدود یکدوم مقادیر زيردوره اول می رسد.

کلمات کلیدی:

,Risk, System Risk, Marginal Expected Shortfall, Financial Crisis, Value at Risk
ریسک، ریسک سیستمی، ریزش مورد انتظار نهایی، بحران مالی، ارزش در معرض ریسک.

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1194069>

