

عنوان مقاله:

بررسی تاثیر شاخص کلان اقتصادی بر ضریب کفایت سرمایه درنوسانات اقتصادی و شرایط ریسکی

محل انتشار:

ششمین همایش ملی پژوهش های نوین در حوزه علوم انسانی، اقتصاد و حسابداری ایران (سال: 1399)

تعداد صفحات اصل مقاله: 9

نویسندگان:

محمد مشهدی زاده - استادیار، گروه مدیریت، واحد مبارکه، دانشگاه آزاد اسلامی، مبارکه، ایران.

وحید گودرزی - دانشجوی دکتری رشته ی مدیریت صنعتی گرایش مالی- باشگاه پژوهشگران جوان و نخبگان، واحد دهقان، دانشگاه آزاد اسلامی، دهقان، ایران

سجاد جانباز - دانشجوی دکتری رشته ی مدیریت صنعتی گرایش مالی، واحد دهقان، دانشگاه آزاد اسلامی، دهقان، ایران

خلاصه مقاله:

پژوهش حاضر بدنبال بررسی تاثیر شاخص کلان اقتصادی بر ضریب کفایت سرمایه در نوسانات اقتصادی و شرایط ریسکی می باشد. هدف پژوهش از نوع کاربردی، همبستگی بوده و داده ها بر اساس مستندات مالی به دست آمده است. جامعه آماری پژوهش بانک های پذیرفته شده در بازار بورس اوراق بهادار تهران می باشند که با توجه به جدول مورگان و روش نمونه گیری تصادفی خوشه ای چند مرحله ای، نمونه ای با حجم ۱۰ بانک پذیرفته شده در بازار بورس که داده های آنها برای یک دوره ۷ ساله (از ۱۳۹۰ تا ۱۳۹۶) بوده و دارای ریسک مورد قبول می باشند بدست آمده است. در پژوهش حاضر از روش کتابخانه ای و میدانی برای گردآوری اطلاعات استفاده شده است و به کمک نرم افزار Eviews مورد سنجش قرار گرفته و نتایج بیانگر آن است ضریب تعیین تعدیل شده برابر ۰.۵۰ درصد میباشد که نشان میدهد حدود ۷۰۵۰ درصد از تغییرات متغیر وابسته، توسط متغیرهای مستقل و کنترلی قابل توضیح است. بر اساس نتایج گزارش شده در جدول (۱۵)، احتمال آماره امتغیر مستقل رشد اقتصادی (تولید ناخالص داخلی)، برابر ۰.۰۰۰ میباشد که کمتر از ۵٪ بوده و می توان گفت رشد اقتصادی (تولید ناخالص داخلی) بر کفایت سرمایه بانکهای بورسی تاثیر مستقیم دارد.

کلمات کلیدی:

رشد اقتصادی (تولید ناخالص داخلی)، کفایت سرمایه، ریسک سهام، بانک های پذیرفته شده در بازار بورس اوراق بهادار

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1221655>

