

عنوان مقاله:

بررسی ثبات شاخص ریسک سیستماتیک شرکت های پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار تهران

محل انتشار:

فصلنامه تحقیقات مالی، دوره 9، شماره 23 (سال: 1386)

تعداد صفحات اصل مقاله: 20

نویسندگان:

رضا تهرانی

سید جلال طباطبائی

خلاصه مقاله:

این مطالعه به بررسی آزمون درجه ثبات شاخص ریسک سیستماتیک در طول زمان با توجه به اطلاعات در دسترس در بورس اوراق بهادار تهران می پردازد. بر این اساس ضریب بتا باتوجه به مدل بازار که توسط پرفسور شارپ (۱۹۶۳) ارائه شد محاسبه می گردد، ضریب بتا شیب خط رگرسیونی است که از طریق برقراری رگرسیون خطی ساده بین بازده شرکت و بازار بدست می آید. ما در این مطالعه از آزمون چاو که از روش تغییر ساختاری بهره می گیرد به بررسی ثبات ریسک سیستماتیک می پردازیم.

کلمات کلیدی:

بازده، پورتفولیو، ثبات ریسک، ریسک سیستماتیک، شاخص بازده نقدی و قیمت

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1395577>

