

## عنوان مقاله:

تبیین عوامل موثر بر نقدشوندگی سهام با استفاده از مدل رگرسیون گام به گام

## محل انتشار:

فصلنامه جامعه شناسی سیاسی ایران، دوره 5، شماره 10 (سال: 1401)

تعداد صفحات اصل مقاله: 18

## نویسندگان:

محمود رضایی - دانشجوی دکتری مهندسی مالی، واحد کاشان، دانشگاه آزاد اسلامی، کاشان، ایران

حسین پناهیان - دانشیار گروه مدیریت بازرگانی-مالی، واحد کاشان، دانشگاه آزاد اسلامی، کاشان، ایران

مهدی معدنچی زاج - استادیار دانشکده مدیریت، واحد الکترونیکی، دانشگاه آزاد اسلامی، تهران، ایران

حسن قدرتی - استادیار گروه حسابداری، واحد کاشان، دانشگاه آزاد اسلامی، کاشان، ایران

## خلاصه مقاله:

تحلیلگران دریافته اند که قیمت اوراق بهادار به صورت تصادفی تغییر نمی کند. بلکه تغییرات براساس یک روند تکرار پذیر و قابل تشخیص صورت می گیرد. سرمایه گذاران در زمان انتخاب و خرید سهام شرکت ها با فرایند تصمیم گیری روبه رو هستند. آنها در این فرایند به دنبال انتخاب سهامی هستند که برای آنها حداکثر بازده را داشته و همچنین نقدشونده باشد. نقدشوندگی در بازار سهام از اهمیت بسزایی برخوردار است. شناسایی عوامل اثرگذار بر نقدشوندگی، به پیش بینی وضعیت نقدشوندگی سهام و در نتیجه مدیریت ریسک سهام کمک می کند. هدف این تحقیق یافتن عوامل تاثیرگذار بر نقد شونددگی سهام می باشد. بدین منظور در مرحله اول با استفاده از ادبیات تحقیق و خبرگان عوامل اثرگذار مشخص و با استفاده از روش رگرسیون گام به گام، متغیرهای تاثیرگذار انتخاب شده اند. انتخاب متغیر(انتخاب ویژگی) یک مرحله مهم در ساخت مدل به منظور پیش بینی می باشد. الگوریتم انتخاب ویژگی خوب، همیشه باید مزایایی مانند نمایش بهتر داده ها، مدل طبقه بندی بهتر، افزایش تعمیم و شناسایی ویژگی های نامربوط را فراهم کند. همچنین کاهش تعداد متغیرها به درک رابطه بین ویژگی ها و متغیرهای هدف، کاهش بار محاسباتی و افزایش دقت در مجموعه داده با ابعاد بالا که تعداد مشاهدات کمتر از تعداد ویژگی ها است، باعث بهبود عملکرد پیش بینی کننده و افزایش کارایی از نظر هزینه و زمان می شود. در نهایت متغیرهای استخراجی با استفاده از مدل رگرسیون استپ وایز، شامل اندازه شرکت، ریسک پذیری، بازده حقوق صاحبان سهام و نسبت سهام شناور آزاد انتخاب شدند.

## کلمات کلیدی:

نقدشوندگی سهام، رگرسیون گام به گام، خبرگان سنجی

## لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1532724>

