

عنوان مقاله:

بررسی تاثیر نوسانات نرخ ارز بر سود و زیان بانک

محل انتشار:

اولین همایش بین المللی اقتصاد سنجی، روشها و کاربردها (سال: 1391)

تعداد صفحات اصل مقاله: 21

نویسندگان:

لیلا کرجانی - فوق لیسانس مهندسی صنایع سیستم های اقتصادی اجتماعی دانشگاه صنعتی امیرکبیر

روناک زحمتکش نوباوگان - فوق لیسانس مهندسی صنایع سیستم های اقتصادی اجتماعی دانشگاه صنعتی امیرکبیر

خلاصه مقاله:

با استفاده از مدیریت ریسک رخدادهای شناخته نشده قبل از وقوع، شناسایی و کنترل شده و یا برنامه ریزی برای مقابله با آنها در زمان وقوع تدوین می گردد. به این منظور و برای کنترل ریسک ناشی از نوسانات نرخ ارز در این تحقیق ارتباط بین وضعیت باز ارزی، میزان سپرده های بانک، میزان تسهیلات و سود/ زیان بانک را می آزمائیم. همچنین با برآزش مدلی رگرسیون به پیش بینی سود/ زیان آتی بانک با توجه به وضعیت باز ارزی، میزان سپرده ها و تسهیلات می پردازیم. جهت آزمون این مسئله، وضعیت باز ارزی، سپردهها، تسهیلات و سود/ زیان جاری بانک تجارت طی سال های 1386 تا 1389 به عنوان نمونه انتخاب شده است.

کلمات کلیدی:

سود و زیان بانک، وضعیت باز ارزی، رگرسیون، پیش بینی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/176310>

