

عنوان مقاله:

تاثیرپذیری نقدشوندگی سهام با در نظر داشتن ریسک بر روی بازده سهام

محل انتشار:

ششمین کنفرانس بین المللی مدیریت، حسابداری، بانکداری و اقتصاد ایران (سال: 1402)

تعداد صفحات اصل مقاله: 12

نویسنده:

ایمان احدپور - دانشجوی کارشناسی ارشد، گروه مهندسی مالی، دانشگاه خواجه نصیرالدین طوسی، تهران، ایران

خلاصه مقاله:

ریسک و بازده دو عامل اصلی و مورد توجه برای سرمایه گذاران در سرمایه گذاری سهام است. سرمایه گذاران سعی می کنند قبل از خرید سهام بازده مورد انتظار و ریسک سهام را بررسی کنند از این رو وجود رابطه اینزدیک به بازدهی واقعی بازار می تواند کمک بسزایی در تشخیص سهام ارزنده برای سهامداران داشته باشد. از طرفی دیگر نقدشوندگی بازار نقش بسزایی در اقتصاد شرکت ها می تواند داشته باشد که راهکارهایی را برای مقابله با ریسک های نقدشوندگی ارائه داد و در نهایت عملکردهای مالی را بهبود داد. پژوهش حاضر با هدف تاثیرپذیری نقدشوندگی سهام با در نظر داشتن ریسک مشروط بر روی بازده در شرکت های پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار تهران انجام شد. روش تحقیق حاضر از لحاظ ماهیت در زمره تحقیقات توصیفی قرار داشته و از نظر روش نیز در دسته تحقیقات همبستگی محسوب می گردد. در این پژوهش برای جمع آوری داده ها و اطلاعات، از روش کتابخانه ای استفاده شد. در بخش داده های پژوهش از طریق جمع آوری داده های شرکت های نمونه با مراجعه به صورت های مالی، یادداشت های توضیحی و ماهنامه بورس اوراق بهادار انجام پذیرفت. بر اساس روش حذف سیستماتیک تعداد ۱۳۹ شرکت به عنوان نمونه آماری انتخاب گردید. به منظور توصیف و تلخیص داده های جمع آوری شده از آمارتوصیفی و استنباطی بهره گرفته شده است. به منظور تحلیل داده ها ابتدا پیش آزمون های ناهمسانی واریانس، آزمون F لیمر، آزمون هاسمن و آزمون جاک - برا و سپس از آزمون رگرسیون چند متغیره برای تایید و رد فرضیه های تحقیق (نرم افزار ایویوز) استفاده گردیده است. نتایج نشان داد رابطه معنی دار بین ریسک و بازده در بازار بورس اوراق بهادار تهران وجود دارد.

کلمات کلیدی:

نقدشوندگی سهام، ریسک مشروط، بازده سهام

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1860989>

