

## عنوان مقاله:

بررسی ریسک و بازده در شرکت های سرمایه گذاری

## محل انتشار:

دومین همایش ملی بررسی راهکارهای ارتقاء مباحث مدیریت، حسابداری و مهندسی صنایع در سازمانها (سال: 1392)

تعداد صفحات اصل مقاله: 24

## نویسندگان:

نواب کونانی - دانشگاه آزاد اسلامی واحد کوهدشت گروه حسابداری

سالار محمدی آستانی - دانشگاه آزاد اسلامی واحد کوهدشت گروه حسابداری

تورج گراوند - دانشگاه آزاد اسلامی واحد کوهدشت گروه حسابداری

## خلاصه مقاله:

از آنجا که شرکت های سرمایه گذاری در مثابه واسطه های مالی بین سرمایه گذاران و بنگاههای تولیدی عکس نمایند و همچنین در بازار پول و سرمایه نقش خطیری دارند. اساس این تحقیق برپایه شناسایی ریسک و بازده شرکت های سرمایه گذاری از اردیبهشت سال ۱۳۸۰ تا انتهای ۱۳۸۴ شکل گرفت تا پایان سال ۸۴ تعداد ۳۰ شرکت سرمایه گذاری به عنوان صنعت واسطه گری در بورس اوراق بهادار پذیرفته شده اند. جهت بررسی ریسک و بازده شرکتهای سرمایه گذاری (صنعت واسطه گری مالی) باتوجه به فلسفه وجودی این شرکت ها که همانا کاهش ریسک از طریق ایجاد سبد (پرتفو) و افزایش بازده از طریق بکارگیری کادرمختص در زمینه امور مالی در این پایان نامه دو فرضیه اصلی طرح گردید. در سری اول فرضیات دو فرضیه مطرح شد. یک میانگین بازده شرکت های سرمایه گذاری از میانگین بازده بازار بیشتر است و دو ریسک شرکت های سرمایه گذاری از ریسک بازار کمتر است و در سری دوم مفروضات دو فرض مطرح گردید. یک میانگین بازده شرکت های سرمایه گذاری از میانگین بازده هر یک از صنایع دیگر بیشتر است و دو ریسک شرکتهای سرمایه گذاری از هر یک از صنایع کمتر است. که نتایج حاصل از این آزمون های به شرح ذیل می باشد. ۱- میانگین بازده شرکت های سرمایه گذاری از میانگین بازده هر یک از صنایع دیگر بیشتر است. ۲- ریسک شرکت های سرمایه گذاری (صنعت واسطه گری مالی) از ریسک بازار کمتر است. ۳- میانگین بازده شرکت های سرمایه گذاری از میانگین بازده ۲۱ صنعت مورد بررسی بیشتر است. ۴- ریسک شرکتهای سرمایه گذاری (صنعت واسطه گری مالی) از ریسک ۱۳ صنعت از ۲۱ صنعت مورد بررسی کمتر است.

## کلمات کلیدی:

## لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/242443>

