

عنوان مقاله:

به دست آوردن مدل عملی برای برآورد بازده سهام در شرکتهای پذیرفته شده در بورس تهران با استفاده از تحلیل لجستیک

محل انتشار:

اولین کنفرانس ملی اقتصاد، مدیریت و فرهنگ ایرانی اسلامی (سال: 1393)

تعداد صفحات اصل مقاله: 12

نویسندگان:

طناز خوش بخت داوانی - دانشجوی کارشناسی ارشد، دانشگاه آزاد اسلامی واحد رشت، ایران

پیمان علیدوست ذوقی - عضو هیئت علمی دانشگاه آزاد اسلامی واحد انزلی، رشت، ایران

خلاصه مقاله:

پژوهش حاضر با مینا قرار دادن اطلاعات بنیادی در صورت های مالی شرکت ها، تلاش نموده است تا تأثیر دو مورد از مهمترین نسبت های مالی و همچنین ضریب بتا را در پیش بینی بازده و سود آتی 88 شرکت از شرکتهای تولیدی پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار تهران که اطلاعات مالی آنها در یک دوره 6 ساله (1386-1391) در دسترس بوده است را آزمون نماید. نتایج آزمون فرضیه های تحقیق با استفاده از روش رگرسیون لجستیک حاکی از آن است که رابطه معنی داری بین نسبت های نرخ بازده داراییها (ROA)، نسبت قیمت به درآمد (PE)، نسبت قیمت به ارزش ادفتری سهم (PB) و همچنین ضریب بتا (B) با بازده سهام وجود دارد و این متغیرها می توانند پیش بینی کننده مناسبی برای بازده آتی سهام در بورس اوراق بهادار تهران باشند، با این حال ارتباط معنی داری میان نسبت های نرخ بازده حقوق صاحبان سهام (ROE) و سود هر سهم (EPS) با بازده سهام نشان داده نشده است.

کلمات کلیدی:

بازار سرمایه، نسبت های سودآوری، نسبت های بازار سهام، ضریب بتا بازده سهام

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/362156>

