

عنوان مقاله:

بررسی تأثیر قیمت گذاری نادرست و ریسک غیر سیستماتیک بر بی نظمی نوسانپذیری پایین در بازار سرمایه ایران

محل انتشار:

ماهنامه پژوهش های مدیریت و حسابداری، دوره 1، شماره 6 (سال: 1393)

تعداد صفحات اصل مقاله: 25

نویسندگان:

اکرم رحمانی - کارشناس ارشد حسابداری، گروه حسابداری، دانشگاه آزاد اسلامی واحد علوم و تحقیقات تهران، ایران

اعظم رحمانی - کارشناس ارشد حسابداری، گروه حسابداری، دانشگاه آزاد اسلامی واحد یزد، یزد، ایران

محمد میرمحمدی صدرآبادی - کارشناس ارشد حسابداری، گروه حسابداری دانشگاه آزاد اسلامی واحد یزد، یزد، ایران

خلاصه مقاله:

مقاله حاضر مشخصاً به دنبال این است که بی نظمی نوسان پایین را در بورس اوراق بهادار تهران بررسی کند که در صورت وجود این بی نظمی در ایران، آیا این امر ناشی از قیمت گذاری نادرست می باشد یا ریسک غیرسیستماتیک باعث آن گردیده است. پژوهش حاضر از نظر هدف کاربردی و از نظر شیوهی گردآوری اطلاعات تحقیق توصیفی از نوع همبستگی است. برای طبقه بندی و تجزیه و تحلیل داده ها از نرم افزارهای Eviews و Spss و Excel استفاده شده است. جامعه آماری این تحقیق کلیه شرکت های پذیرفته شده در بازار اوراق بهادار تهران تشکیل می دهد و دوره زمانی آن 5 ساله از سال 1387 لغایت 1391 بوده و نمونه آماری تحقیق که بر اساس روش حذفی سیستماتیک به دست آمده شامل 104 شرکت و تعداد مشاهدات برابر با 520 شرکت-سال می باشد. شواهد تجربی به دست آمده از آزمون فرضیات حاکی از این است که در بازار سرمایه ایران، بی نظمی نوسان پایین وجود داشته و سطح ریسک غیرسیستماتیک شرکت ها از عوامل ایجادکننده این بی نظمی می باشد

کلمات کلیدی:

نوسان پذیری بازده، بازده غیرعادی، بی نظمی نوسان پایین، ریسک غیر سیستماتیک، قیمت گذاری نادرست

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/406506>

