

عنوان مقاله:

تحلیل و بررسی تفاوت اندازه ریسک سیستماتیک صنایع مختلف پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار تهران در بازه زمانی 1393-1389

محل انتشار:

کنفرانس بین المللی علوم و مهندسی (سال: 1394)

تعداد صفحات اصل مقاله: 10

نویسندگان:

پروانه سلاطین - استادیار گروه اقتصاد، دانشگاه آزاد اسلامی واحد فیروزکوه، فیروزکوه، ایران

محمدرضا علیزاده - دانشجوی کارشناسی ارشد مهندسی سیستم های اقتصادی اجتماعی، گروه مهندسی - صنایع، دانشکده فنی و مهندسی، دانشگاه آزاد اسلامی واحد علوم و تحقیقات،

زهرا محمدی - فارغ التحصیل کارشناسی ارشد مهندسی صنایع صنایع، گروه مهندسی - صنایع، دانشگاه آزاد اسلامی واحد علوم و تحقیقات قزوین، قزوین، ایران

محمد کریمی مشکانی - دانشجوی کارشناسی ارشد مهندسی سیستم های اقتصادی اجتماعی، گروه مهندسی - صنایع، دانشکده فنی و مهندسی، دانشگاه آزاد اسلامی واحد علوم و تحقیقات،

مهدی معصومی - دانشجوی کارشناسی ارشد مدیریت مالی، گروه مدیریت مالی، دانشکده علوم انسانی، دانشگاه آزاد اسلامی واحد الکترونیکی، تهران

خلاصه مقاله:

در ادبانات مالی، مدل قیمت گذاری داراییهای سرمایه‌های رابطه بن ریسک سنستمانک (بتا) را با بازده مورد انتظار هر سهم نشان میدهد، از مشکلات اساسی که مدیران پرتفوی و سرمایه گذاران برای بدست آوردن بازده مورد انتظار هر پرتفوی با آن مواجهاند صحت تخمین اندازه بتا جهت تصمیمگیری سرمایه گذاران در بورس اوراق بهادار با اطمینان خاطر از کسب بازده مورد انتظار از سرمایه گذاری خویش است. لذا در این تحقیق با استفاده از آزمونهای آماری مختلف همچون تحلیل واریانس ها، آزمون توکی، شفه روی بازده سهام ماهانه طی دامنه زمانی بین سال های 0601 تا 0616 که به عنوان نمونه آماری انتخاب شده است، به بررسی مقایسه‌های اندازه ریسک سیستماتیک در صنایع مختلف پرداخته شد و در نهایت نتایج تحقیق دلالت بر معنیدار بودن تفاوت اندازه ریسک سیستماتیک در صنایع مختلف دارد

کلمات کلیدی:

ریسک سنستمانک، بازده مورد انتظار، بورس

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/424465>

