

عنوان مقاله:

بررسی تطبیقی رفتارریسک - بازده حاصل از سرمایه گذاری در پرتفوی سهام شرکت های پذیرفته شده بورس اوراق بهادار در سطوح متفاوتی از متنوع سازی

محل انتشار:

اولین کنفرانس بین المللی ابزار و تکنیکهای مدیریت (سال: 1393)

تعداد صفحات اصل مقاله: 20

نویسندگان:

فرزانه سادات محمدی کیا - کارشناسی ارشد مدیریت مالی دانشگاه آزاد اسلامی واحد علوم و تحقیقات تهران دانشکده اقتصاد و مدیریت گروه مدیریت مالی ایران

سید یوسف احدی سرکانی - دکتری حسابداری دانشگاه آزاد اسلامی واحد فیروزکوه دانشکده حسابداری گروه حسابداری ایران

خلاصه مقاله:

هدف از این مقاله مقایسه رفتارریسک - بازده حاصل از سرمایه گذاری در پرتفوی متشکل از سهام شرکت های پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار تهران در سطوح متفاوتی از متنوع سازی می باشد در واقع این مقاله به بررسی این موضوع پرداخته شده است که آیا میتوان در بورس اوراق بهادار تهران در سطوح متفاوتی از متنوع سازی رفتار متفاوتی را در تحلیل رابطه ریسک - بازده مشاهده نمود؟ بدین منظور 5 سطح از متنوع سازی انتخاب گردیده و رفتارریسک و بازده در مجموعه های متنوع از سهام مورد بررسی و تغییرات رفتارریسک و بازده آنها را مورد کنکاش قرار گرفته است در این مقاله از آزمون همبستگی استفاده شده است در مدل اول بین متنوع سازی و شاخص معرف ریسک غیرسیستماتیک و در مدل دوم بین متنوع سازی و شاخص معرف رابطه ریسک و بازده به آزمون همبستگی پرداخته شده است یافته ها نشان میدهد که اولاً روابط بین متنوع سازی و ریسک غیرسیستماتیک در پرتفوی های نمونه متشکل از سهام شرکتهای پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار تهران از الگوهای منطقی و منطبق با مبانی تئوریک پیروی مینمایند

کلمات کلیدی:

رفتارریسک - بازده / متنوع سازی / ریسک غیرسیستماتیک / تئوری پرتفوی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/477145>

