

عنوان مقاله:

بررسی رابطه دوره ای ریسک و بازده با استفاده از رویکرد مدل دو متغیره

محل انتشار:

فصلنامه مطالعات نوین کاربردی در مدیریت، اقتصاد و حسابداری، دوره 6، شماره 3 (سال: 1402)

تعداد صفحات اصل مقاله: 10

نویسنده:

فرشید کاظمی - کارشناس ارشد حسابداری، موسسه آموزش عالی حافظ، شیراز، ایران

خلاصه مقاله:

هدف این تحقیق بررسی رابطه دوره ای ریسک و بازده با استفاده از رویکرد مدل دو متغیره میباشد. پژوهش حاضر از نوع توصیفی و از حیث هدف در دسته پژوهش های همبستگی - رگرسیونی میباشد. برای تجزیه و تحلیل داده ها و استخراج نتایج پژوهش، نرم افزارهای Excel و EVIEWS به کار گرفته شده است. اطلاعات مربوط به شرکتهای پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار طی دوره ۵ ساله مورد تجزیه و تحلیل قرار گرفته اند تا ارتباط بین متغیرها برای آزمون فرضیه های تحقیق بررسی شود. نتایج تحقیق نشان داد که بین بازده مورد انتظار براساس BARR و واریانس شرطی بر اساس BARR رابطه معناداری وجود ندارد. سطح معناداری برای تمام مدلهای توضیحی بزرگتر از ۵/۰ گزارش شده است. از این رو میتوان ادعا نمود که بین بازده تحقق یافته و واریانس شرطی بر مبنای مدل تک متغیره MAR رابطه معناداری وجود ندارد. همچنین آماره دوربین واتسون خطای خود همبستگی مدل را تایید کرد. ازسوی دیگر بین بازده تحقق یافته و واریانس شرطی براساس مدل BMAR رابطه معناداری وجود ندارد. سطح معنی داری برای تمام مدلهای توضیحی بزرگتر از ۵/۰ گزارش شده است. از این رو میتوان ادعا نمود که بین بازده تحقق یافته و واریانس شرطی نیز بر مبنای مدل تک متغیره MAR رابطه معناداری وجود ندارد. همچنین آماره دوربین واتسون خطای خود همبستگی مدل را تایید کرد.

کلمات کلیدی:

ریسک، بازده، گارچ، بورس اوراق بهادار.

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1757996>

