

۱۶۵۹۵۷۲

اسلامی

مدیریت ریسک در بازده سهام شرکت های دولتی

مؤلف :

فاطمه حیدری

سرشناسه	: حیدری، فاطمه، ۱۳۶۹ -
عنوان و نام پدیدآور	: مدیریت ریسک در بازده سهام شرکت‌های دولتی / مولف فاطمه حیدری.
مشخصات نشر	: تهران: گروه آموزشی مدرس: سنجش و دانش، ۱۳۹۷.
مشخصات ظاهری	: ۹۰ص: جدول، نمودار.
شابک	: ۹۷۸-۶۲۲-۶۰۸۷-۸۳-۴
وضعیت فهرست نویسی	: فیپا
یادداشت	: کتابنامه: ص. ۸۴-۸۹.
موضوع	: سهام -- ایران -- نرخ بازده -- نمونه پژوهی
موضوع	: Stocks Case studies -- Rate of return -- Iran --
موضوع	: مدیریت ریسک مالی -- ایران -- نمونه پژوهی
موضوع	: Financial risk management -- Iran -- Case studies
رده بندی کنگره	: HG ۲/۵۷۲۰ ۱۳۹۷ ح ۹/۱۳
رده بندی دیویی	: ۶۴۲۵۵/۳۳۵
شماره کتابشناسی ملی	: ۵۲۰۲۰۶



عنوان: مدیریت ریسک در بازده سهام شرکت‌های دولتی

مولف: فاطمه حیدری

تیراژ: ۵۰۰ نسخه

ناشر: گروه آموزشی مدرس، سنجش و دانش

نوبت چاپ: اول ۱۳۹۷

صفحه آرایشی: مهتاب دوستی

طراح جلد: مهتاب دوستی

تیراژ: ۵۰۰ نسخه

قیمت: ۱۵۰,۰۰۰ ریال

کلیه حقوق مادی و معنوی برای مولف محفوظ می باشد.

www.rezomephd.ir

www.sanjesh.ir

صفحه	عنوان
۱	فصل اول:
۱	مقدمه و کلیات
۲	مقدمه
۹	متغیرها و مدل
۹	مدل مفهومی
۹	تعریف راه‌ها، اصطلاحات فنی و تخصصی
۱۰	حالت و چگونگی تهیه خمدانی
۱۲	روش
۱۳	جامعه و نمونه آماری
۱۳	روش تجزیه و تحلیل رگرسیون (OLS)
۱۳	ساختار
۱۶	فصل دوم:
۱۶	ادبیات
۱۷	مقدمه
۱۷	مبانی نظری
۱۷	مفهوم ریسک
۲۱	عوامل مؤثر بر بازدهی کوتاه مدت و بلند مدت:
۲۱	اندازه گیری متوسط بازده غیرعادی کوتاه مدت
۲۳	اندازه گیری متوسط بازده غیرعادی بلندمدت

۲۵	واریانس و انحراف معیار مطلوب و بتای نامطلوب
۲۵	بازده سهام
۲۶	اجزای بازده سهام
۲۷	تفاوت نرخ
۲۷	سود نقدی ناخالص هر سهم
۲۷	مزایای حق تقدم
۲۹	مزایای سهام جایزه
۳۱	بررسی رابطه بین بتای مطلوب و بازده سهام در شرکت های دولتی
۳۱	دیدگاه های مختلف پیرامون بازدهی سهام
۳۳	تئوری انتظارات
۳۴	تئوری سستی قیمت سهام
۳۵	تئوری اعتماد
۳۶	تئوری بازار کارا
۳۷	نظریه (WAVE)
۳۸	پیشینه
۳۸	تحقیقات داخلی
۴۰	تحقیقات خارج از کشور
۴۳	تحقیقات داخلی
۴۷	فصل سوم
۴۷	روش شناسی
۴۸	مقدمه

۴۸	روش
۴۹	اهداف
۴۹	هدف اصلی
۴۹	هدف کاربردی
۴۹	فرضیات
۵۰	مدل مفهومی
۵۰	جامعه و نمونه آماری
۵۱	مدل مفهومی - متغیرهای مورد بررسی
۵۲	روش گردآوری اطلاعات
۵۲	روش های تجزیه و تحلیل داده ها
۵۳	رگرسیون خطی (روش حداقل مربعات - OLS)
۵۴	ضریب تعیین R^2
۵۵	تحلیل واریانس جهت بررسی معنادار بودن مدل برآورد شده
۵۶	فروض کلاسیک
۵۶	بررسی حقیقی بودن رگرسیون با آزمون های همجمعی
۵۶	مفهوم اقتصادی همجمعی
۵۷	بررسی خود همبستگی در جملات اخلال با آزمون دوربین واتسون
۵۹	فصل چهارم
۵۹	تجزیه و تحلیل داده ها
۶۰	مقدمه
۶۰	آمار توصیفی متغیرها

- تخمین مدل رگرسیونی باروش حداقل مربعات معمولی (OLS): ۶۱
- آزمون های ایستایی (مانایی یا پایایی) متغیرهای موجود در مدل: ۶۲
- برآورد مدل به روش OLS و تفسیر ضرایب: ۶۴
- مدل اول ۶۵
- مدل دوم ۶۶
- برآورد آزمون های اعتبار و صحت مدل: ۶۷
- آزمون حقیق بودن رگرسیون: ۶۸
- خودهمبستگی در مدل: ۷۰
- آزمون نرمال بودن توزیع ضرایب (پارامترها): ۷۰
- آزمون وایت جهت تشخیص ناهمبستگی: ۷۱
- برآورد آزمون LM جهت تشخیص همبستگی پیاپی: ۷۲
- برآورد آزمون رمزی: ۷۳
- منابع و مآخذ ۷۸
- منابع فارسی ۷۹
- منابع لاتین ۸۱