

## عنوان مقاله:

دارایی موزون بانک ها بر حسب ریسک و بازده مقطعی سهام

## محل انتشار:

دوفصلنامه کاوش های مدیریت بازرگانی، دوره 6، شماره 12 (سال: 1393)

تعداد صفحات اصل مقاله: 14

## نویسندگان:

مریم دولو - استادیار دانشگاه شهید بهشتی

محمد رضا حمیدی زاده - استاد دانشگاه شهید بهشتی

غلامرضا ابوترابی - کارشناس ارشد مالی دانشگاه تهران

## خلاصه مقاله:

هدف اصلی پژوهش حاضر، بررسی احتساب ریسک دارایی های موزون بر حسب ریسک (RWA) توسط سرمایه گذاران از طریق آزمون تاثیر RWA بر ریسک و بازده سهام بانک ها است. برای این منظور نمونه ای متشکل از 17 بانک پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار تهران طی سال های 1381 تا 1390 مورد بررسی قرار گرفته است. به دلیل کمی مشاهدات قابل دسترس، جهت آزمون رابطه دارایی های موزون بر حسب ریسک با بازده و ریسک سهام بانک ها از رگرسیون داده های تابلویی استفاده گردیده است. نتایج حاصله موید تاثیر معکوس دارایی موزون بر حسب ریسک بر بازده سهام بانک ها است. همچنین، اثر مستقیم RWA بر معیارهای ریسک سهام بانک شامل نوسانات بازده و بتا نیز تایید گردید.

## کلمات کلیدی:

دارایی های موزون شده بر حسب ریسک، بازده، ریسک

## لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/916371>

