
رابطه متغیرهای کلان اقتصادی و بازده سهام با توجه به

اندازه‌ی شرکت‌ها

فرید قادری

www.ketab.ir

انتشارات زرنوشت

تهران - ۱۳۹۹

سرشناسه	: قادری، فرید، ۱۳۶۳-
عنوان و نام پدیدآور	: رابطه متغیرهای کلان اقتصادی و بازده سهام با توجه به اندازهی شرکت‌ها/ نویسنده: فرید قادری
مشخصات نشر	: تهران: زرنوشت، ۱۳۹۹
مشخصات ظاهری	: ۱۶۰ ص.
شابک	: ۹۷۸ - ۶۲۲ - ۷۴۷۴ - ۲۹ - ۹
ضمیمه فهرست‌نویسی	: فبیای مختصر
یادداشت	: فهرست‌نویسی کامل این اثر در وب‌گاه http://opac.nlai.ir در دسترس است.



انتشارات زرنوشت

تهران، میدان انقلاب، خیابان کارگر جنوبی،

کوچه مهدی‌زاده، شماره ۲۷، واحد ۱۹

تلفن: ۰۹۰۲۴۸۶۸۹۵۶ - ۶۶۴۷۹۶۱۵ - ۶۶۴۳۵۶۳۷

رابطه متغیرهای کلان اقتصادی و بازده سهام با توجه به

اندازهی شرکت‌ها

نویسنده: فرید قادری

* چاپ اول: ۱۳۹۹ * شمارگان: ۱۰۰۰ نسخه * ناشر: زرنوشت

شابک: ۹۷۸ - ۶۲۲ - ۷۴۷۴ - ۲۹ - ۹

قیمت: ۴۰,۰۰۰ تومان

تمامی حقوق محفوظ است.

فهرست

۷	فصل اول کلیات
۷	۱-۱ مقدمه
۸	۱-۲-۱ تشریف بر بیان مسأله:
۱۱	فصل دوم رابطه بین سیرهای کلان اقتصادی و بازده سهام
۱۱	۲-۱ مقدمه
۱۲	۲-۲ ادبیات موضوع
۱۲	۲-۲-۱-۱ بازار مالی
۱۳	۲-۲-۲ بورس اوراق بهادار
۱۴	۲-۲-۳ اثر بورس در رشد اقتصادی
۱۵	۲-۲-۴-۱ سبد اوراق بهادار مارکویتز
۱۶	۲-۲-۵-۲ مدل مودینگلیانی-میلر (MM)
۱۷	۲-۲-۶-۲ ریسک سیستماتیک (B)
۱۸	۲-۲-۷-۲ قیمت گذاری دارایی های مالی
۲۰	۲-۲-۸-۲ نظریه قیمت گذاری آربیتراژ
۲۲	۲-۲-۹-۲ مدل سه عاملی فاما و فرنچ
۲۴	۲-۲-۹-۳ عامل اندازه (SMB)
۲۴	۲-۲-۱۰-۲ اندازه شرکت
۲۵	۲-۲-۱۱-۲ شاخص های اندازه
۲۶	۲-۲-۱۱-۱-۲ میزان دارایی های شرکت
۲۶	۲-۲-۱۱-۲-۲ سطح فروش شرکت

۲۷	۲-۲-۱-۳- تعداد پرسنل
۲۷	۲-۲-۱-۱-۴- ارزش بازار شرکت
۲۸	۲-۲-۱۲- متغیرهای کلان اقتصادی
۲۸	۲-۲-۱۲-۱- نرخ ارز
۲۹	۲-۲-۱۲-۲- شاخص قیمت مصرف کننده
۳۰	۲-۲-۱۲-۳- قیمت نفت خام
۳۰	۲-۲-۱۲-۴- حجم نقدینگی
۳۱	۲-۳- بازار بورس
۳۱	۲-۳-۱- مفهوم بازار بورس
۳۱	۲-۳-۱-۱- مفهوم بازار
۳۲	۲-۳-۱-۲- مفهوم بورس
۳۲	۲-۳-۲- پیشینه بازار بورس
۳۲	۲-۳-۲-۱- پیشینه بازار بورس در جهان
۳۴	۲-۳-۲-۲- پیشینه بازار بورس در ایران
۳۷	۲-۴- انواع بازار و بازار بورس
۳۸	۲-۴-۱- انواع بازار
۳۸	۲-۴-۲- بازار دارایی‌های واقعی
۳۹	۲-۴-۲-۱- بازار دارایی‌های اعتباری (مالی) و انواع آن
۴۵	۲-۴-۲-۲- انواع بازار بورس
۴۵	۲-۴-۲-۱-۱- بازار بورس اوراق بهادار و انواع آن
۴۹	۲-۴-۲-۲-۲- بازار بورس کالا
۵۱	۲-۴-۲-۳- بازار بورس انرژی
۵۲	۲-۴-۲-۴- بازار بورس ارز
۵۳	۲-۵- معاملات بورس
۵۴	۲-۵-۱- مفهوم و انواع معاملات بورس
۵۴	۲-۵-۱-۲- مفهوم معاملات بورس
۵۵	۲-۵-۱-۳- انواع معاملات بورس

۶۳	۲-۵-۲- روند شکل گیری معاملات بورس و اصول حاکم بر این معاملات
۶۳	۲-۵-۲-۱- روند شکل گیری معاملات بورس
۶۶	۲-۵-۲-۲- اصول حاکم بر معاملات بورس
۷۷	۲-۶- پیشینه پژوهش
۸۱	فصل سوم روش پژوهش
۸۱	۳-۱- مقدمه
۸۲	۳-۲- روش تحقیق
۸۲	۳-۳- منابع، ابزار گردآوری داده ها و اطلاعات
۸۲	۳-۴- جامعه آماری
۸۳	۳-۵- روش نمونه گیری
۸۳	۳-۶- قلمرو پژوهش
۸۳	۳-۷- روش تجزیه و تحلیل داده ها
۸۴	۳-۷-۱- داده های پانل (های بلویی)
۸۵	۳-۷-۲- مزایای استفاده از داده های پانل
۸۶	۳-۷-۳- روش های تخمین مدل های پانل شده
۸۸	۳-۴-۷- آزمون F لیمر
۸۹	۳-۷-۵- آزمون هاسمن
۹۰	۳-۷-۶- مدل اثر ثابت (FEM)
۹۲	۳-۷-۷- مدل اثرات تصادفی (REM) یا مدل تصحیح خطا (ECM)
۹۳	۳-۷-۸- آزمون ریشه واحد پانل
۹۷	فصل چهارم یافته های تحقیق
۹۷	۴-۱- مقدمه
۹۷	۴-۲- آمار توصیفی
۹۸	۴-۳- آمار استنباطی
۹۸	۴-۳-۱- معرفی متغیرها و تصریح مدل
۱۰۱	۴-۳-۲- آزمون مانابی (پابایی) داده های تلفیقی
۱۰۶	۴-۳-۳- تخمین و برآورد مدل ها

۱-۴-۳-۳-۱	برآورد و تحلیل نتایج مدل اول	۱۰۶
۲-۴-۳-۳-۲	تخمین و برآورد مدل دوم	۱۰۹
۳-۴-۳-۳-۳	تخمین و برآورد مدل سوم	۱۱۱
۴-۴-۳-۳-۴	تخمین و برآورد مدل چهارم	۱۱۲
۴-۴-۳-۳-۴	نتایج کلی مدل‌ها	۱۱۴
فصل پنجم نتیجه‌گیری و پیشنهادات		۱۱۹
۱-۵-مقدمه:		۱۱۹
۲-۵-نتایج پژوهش:		۱۱۹
۳-۵-محدودیت‌های اصلی پژوهش		۱۲۱
۴-۵-پیشنهادهای خاص از پژوهش		۱۲۱
۱-۴-۵-پیشنهادهای برای تحقیقات آتی		۱۲۱
منابع:		۱۲۳
منابع لاتین:		۱۲۶
پیوست		۱۲۸