

تأثیر ساختار سرمایه بر عملکرد مالی بانکداری

تألیف:

فرشاد کشاورزی

انتشارات قانون یار

۱۴۰۲

سرشناسه	:	کشاورزی، فرشاد، ۱۳۶۶ -
عنوان و نام پدیدآور	:	تاثیر ساختار سرمایه بر عملکرد مالی بانکداری/تالیف فرشاد کشاورزی
مشخصات نشر	:	تهران: انتشارات قانون یار، ۱۴۰۲
مشخصات ظاهری	:	۱۲۰ صفحه: جدول
شابک	:	۹۷۸-۶۲۲-۲۲۹-۶۸۵-۸
فهرست نویسی	:	فیبا
یادداشت	:	کتابنامه: ص. [۱۰۹] - ۱۱۷.
موضوع	:	بانک ملی ایران Bank Melli Iran - بانک ملت - بانک و بانکداری ایران - نمونه پژوهی Banks and Banking - Iran - Case studies امور مالی - ایران - نمونه پژوهی Finance - Iran - Case studies
رده بندی کنگره	:	۲۳۲۷۰HG
رده بندی دیویی	:	۱۰۹۵۵/۳۳۲
شماره کتابشناسی ملی	:	۹۴۸۷۱۶۷
رکورد کتابشناسی	:	فیبا

انتشارات قانون یار

تاثیر ساختار سرمایه بر عملکرد مالی بانکداری

تألیف: فرشاد کشاورزی

ناشر: قانون یار

چاپخانه و صحافی: قانون یار

نوبت چاپ: اول ۱۴۰۲

شمارگان: ۱۰۰ جلد

قیمت: ۱۷۰۰۰۰ تومان

شابک: ۹۷۸-۶۲۲-۲۲۹-۶۸۵-۸

(تمامی حقوق مادی این کتاب محفوظ بوده و متعلق به انتشارات قانون یار می باشد)

مرکز پخش: تهران، میدان انقلاب، خ منیری جاوید، موسسه قانون یار تلفن: ۵۲۶ و ۶۶۹۷۹۵۱۹

ثبت سفارش تلفنی محصولات (ارسال رایگان به سراسر کشور) ۲۵ و ۹۱۹۶۷۴۸۶۴۵

فهرست مطالب

عنوان	شماره صفحه
پیشگفتار.....	۱۱
فصل اول: کلیات و تحلیل اولیه موضوع.....	۱۳
مقدمه.....	۱۳
شناخت موضوع و طرح بحث.....	۱۴
اهمیت تالیف کتاب حاضر.....	۱۶
نگاهی اجمالی به چارچوب نظری.....	۱۹
ساختار سرمایه و مفاهیم مربوط به آن.....	۱۹
سئوالات یا فرضیه‌های مطروحه مولف.....	۲۳
مدل مفهومی پژوهش.....	۲۶
فصل دوم: بررسی ادبیات و پیشینه پژوهش.....	۲۹
مقدمه.....	۲۹
مبانی نظری.....	۳۰
بخش اول: ساختار سرمایه.....	۳۰
مفهوم ساختار سرمایه.....	۳۰
ساختار بهینه سرمایه.....	۳۳
نظریه‌های نوین ساختار سرمایه.....	۳۴
تنوری موازنه ایستا.....	۳۵
تنوری هزینه‌های نمایندگی.....	۳۷
رابطه مولفه‌های ساختار سرمایه با بدهی.....	۴۰
فرصت‌های رشد.....	۴۱

۴۳	ارتباط منفی بین ساختار سرمایه و عملکرد مالی شرکت‌ها
۴۴	ارتباط مثبت بین ساختار سرمایه و عملکرد شرکت‌ها
۴۶	رابطه استراتژی‌های کسب و کار و ساختار سرمایه
۴۷	رابطه رقابت بازار محصول و ساختار سرمایه
۴۸	بخش دوم: عملکرد مالی
۵۱	مدل‌های ارزیابی عملکرد
۵۱	مدل‌های حسابداری ارزیابی عملکرد
۵۴	مدل‌های اقتصادی ارزیابی عملکرد
۶۱	پیشینه تحقیق
۶۱	مطالعات داخلی
۶۴	مطالعات خارجی
۶۵	خلاصه فصل
۶۷	فصل سوم: روش‌شناسی پژوهش
۶۷	مقدمه
۶۸	رگرسیون
۶۹	داده‌های ترکیبی
۶۹	مدلسازی در قالب داده‌های تابلویی
۶۹	علت استفاده از داده‌های تابلویی
۷۲	تخمین پارامتری داده‌های پانل
۷۳	مدل‌های رگرسیونی داده‌های ترکیبی
۷۶	آزمون‌های ریشه واحد در داده‌های پانل دیتا
۷۶	آزمون وابستگی مقاطع پسران (CD)
۷۸	آزمون مانایی در داده‌های تابلویی
۸۱	آزمون‌های تشخیصی جهت انتخاب روش برآورد
۸۱	آزمون چاو (F لیمر)
۸۲	بروش-پاگان

۸۳	آزمون هاسمن.....
۸۴	آزمون ناهمسانی واریانس والد اصلاح شده.....
۸۵	تخمین مدل پارامتری داده‌های پانل به روش حداقل مربعات تعمیم یافته عملی.....
۸۷	خلاصه فصل.....
۸۹	فصل چهارم: تجزیه و تحلیل داده ها.....
۸۹	مقدمه.....
۸۹	معرفی متغیرها.....
۹۰	معرفی الگوی پارامتری پانل.....
۹۰	آزمون ریشه واحد در پانل دیتا.....
۹۲	آزمون ریشه لوین، لین وچو (LLC).....
۹۴	آزمون‌های تشخیص مدل.....
۹۶	آزمون ناهمسانی واریانس والد اصلاح شده.....
۹۸	تخمین پارامتری داده‌های پانل.....
۱۰۱	خلاصه فصل.....
۱۰۳	فصل پنجم: نتیجه گیری و پیشنهادات مولف.....
۱۰۳	مقدمه.....
۱۰۳	جمع بندی و نتیجه گیری.....
۱۰۶	پیشنهادها.....
۱۰۹	منابع و مآخذ.....

پیشگفتار

هدف اصلی کتاب حاضر بررسی تأثیر ساختار سرمایه بر عملکرد مالی بانکداری است. در این کتاب تأثیر متغیرهای ساختار سرمایه را بر متغیرهای عملکرد مالی برای دو بانک ملت و ملی در دوره زمانی ۱۳۸۹-۱۳۹۶ در ساختار داده‌های پانل بررسی شد. برای بررسی مدل از آزمون چاو، لاگرانژ و هاسمن استفاده شد. تمامی مدل‌های مورد بررسی دارای احتمال آماره F بزرگتر از ۰/۰۵ می‌باشند، بدین معنی که فرض صفر مبنی بر پول بودن مدل پذیرفته شد. سپس آزمون همسانی واریانس والد اصلاح شده بررسی شد. این آزمون همسانی واریانس پسماندهای مدل‌های پارامتری را رد می‌کند بدین معنی که تمام مدل‌ها دارای واریانس ناهمسانی هستند. به منظور در نظر گرفتن عدم ارتباط میان مقاطع و لحاظ ناهمسانی واریانس از روش GLS استفاده شد. در نهایت یافته‌های کلی کتاب حاضر نشان داد که متغیرهای ساختار سرمایه بر متغیرهای عملکرد مالی برای دو بانک ملت و ملی در دوره زمانی ۱۳۸۶-۱۳۹۶ دارای تأثیر مثبت و معناداری می‌باشد.