

آزمون میان ترم  
درس «پژوهش‌های تجربی در مالی»  
دانشکده‌ی حسابداری و مدیریت دانشگاه شهیدبهشتی

وقت: ۴ ساعت

روز یکشنبه ۱۳۹۵/۱۰/۱۹

مدرس: حسین عبده تبریزی

۱. در پژوهشی دو نوع نمونه به شرح ذیل در دسترس است:

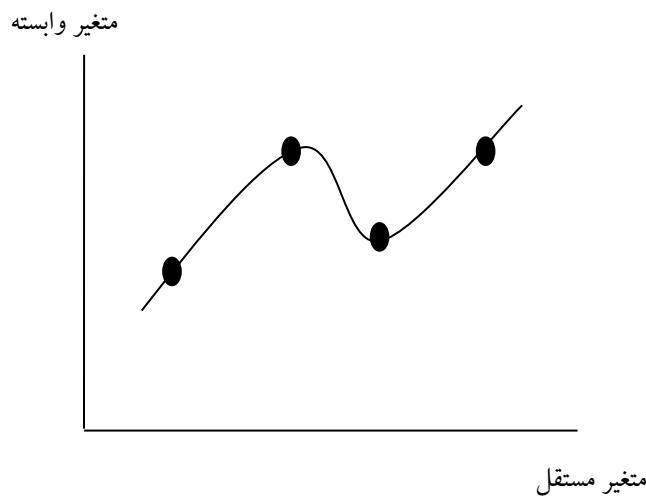
الف. اندازه‌ی نمونه، کوچک و نوع نمونه، تصادفی شده.

ب. اندازه‌ی نمونه، بزرگ و نوع نمونه، تصادفی نشده.

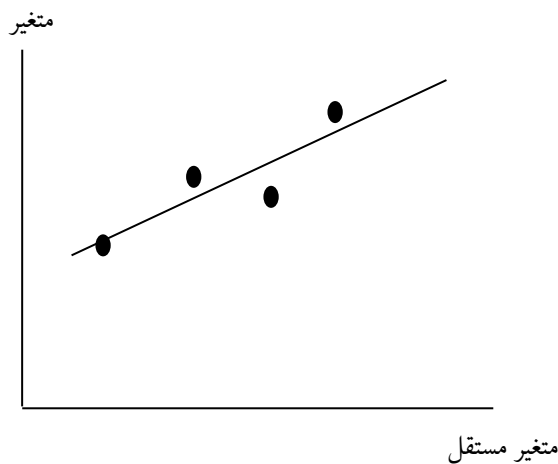
توضیح دهید پژوهشی که بر مبنای هر کدام از نمونه‌های یادشده انجام می‌شود، به طور عمده متحمل چه نوع خطاهایی است. در مورد ویژگی‌های تخمین‌زننده‌های OLS ( برای تخمین پارامترهای نمونه‌های الف و ب) بحث کنید. برای کاهش خطاهای هر کدام از پژوهش‌ها، چه پیشنهادهایی دارید؟ سایر شرایط را ثابت در نظر بگیرید.

۲. دو محقق نمودارهای ذیل را بر داده‌های یکسانی برازش کرده‌اند:

الف. محقق اول



ب. محقق اول



بر نام خدا

آزمون میان‌ترم  
درس «پژوهش‌های تجربی در مالی»  
دانشکده‌ی حسابداری و مدیریت دانشگاه شهیدبهشتی

مدرس: حسین عبده تبریزی

روز یکشنبه ۱۳۹۵/۱۰/۱۹

وقت: ۴ ساعت

با کدام محقق موافقت می‌کنید؟ دلایل خود را در دفاع یا رد نمودارهای برآزش شده‌ی هر محقق شرح دهید.

۳. به هنگام استفاده از تحلیل عاملی چه ملاحظاتی در مورد درجه‌ی آزادی و استفاده از اطلاعات قبلی (Priors information) وجود دارد. این ملاحظات چگونه ممکن است نتایج تحقیقات مبتنی بر تحلیل عاملی را تحت تأثیر قرار دهد.

۴. نحوه‌ی به‌کارگیری رگرسیون Fama-Macbeth به کار رفته در مقاله‌ی ذیل را به طور کامل تشریح کنید.

"The determinants and implications of corporate cash holdings"

۵. در مقاله‌ی ذیل چگونگی استفاده از متغیرهای ابزاری (IVs) در طرح پژوهشی را تشریح کنید.

"Inside the family firm: The role of families in succession decisions and performance"