

عنوان مقاله:

بررسی استراتژی معاملات جفتی در بازار سهام ایران (مطالعه موردی سهام شرکت های سرمایه گذاری بورس)

محل انتشار:

دوماهنامه بررسی های بازرگانی، دوره 17، شماره 96 (سال: 1398)

تعداد صفحات اصل مقاله: 15

نویسندگان:

جمال جلیلیان - کارشناس ارشد مدیریت مالی و کارشناس امور مالیاتی، دانشگاه شاهد

نسیم طاهرخانی - کارشناس ارشد حسابداری و مدرس دانشگاه، دانشکده مدیریت و حسابداری، دانشگاه آزاد اسلامی قزوین، قزوین

خلاصه مقاله:

برخی از سرمایه گذاران با استفاده از استراتژی های مختلف به دنبال درک درستی از بازار سهام و رفتار آن برای کسب سود هستند. یکی از این استراتژی ها در معاملات سهام، استراتژی معاملات جفتی است. در این استراتژی هدف پیدا کردن دو سهم است که قیمت های آن ها در گذشته با هم در حال حرکت بوده اند. در این مطالعه، هدف بررسی استراتژی معاملات جفتی در بازار سهام ایران بوده، به همین منظور سهام شرکت های سرمایه گذاری برای بازه زمانی ۱۳۸۴ تا ۱۳۹۴ به عنوان نمونه آماری انتخاب شدند. برای شناسایی جفت سهام، دوره تشکیل یک ساله در نظر گرفته شد و از آزمون همبستگی و آزمون های هم جمعی با استفاده از نرم افزار EViews جفت سهام مورد نظر شناسایی شدند. در ادامه با استفاده از نرم افزار Matlab کد استراتژی نوشته شد و سوالات تحقیق مورد بررسی قرار گرفتند که نتایج حاکی از قابل اجرا و سودآور بودن استراتژی در اکثر سال ها بود.

کلمات کلیدی:

استراتژی معاملات جفتی، بازار خنثی، آربیتراژ، آزمون همجمعی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1363216>

