

عنوان مقاله:

مقایسه دقت مدل اولسن و مدل پیوتروسکی در تبیین تغییرات قیمت سهام پذیرفته شده در بازار اوراق بهادار تهران

محل انتشار:

فصلنامه مدل سازی اقتصاد سنجی، دوره 3، شماره 3 (سال: 1397)

تعداد صفحات اصل مقاله: 17

نویسندگان:

غلامحسین گل ارضی - استادیار گروه مدیریت بازرگانی دانشگاه سمنان

محمود یعقوبی - دانشجوی کارشناس ارشد مدیریت بازرگانی-مدیریت مالی، دانشگاه سمنان

خلاصه مقاله:

ارزش گذاری سهام با استفاده از روش های معتبر علمی سبب اتخاذ تصمیمات بهینه سرمایه گذاری و تخصیص بهینه منابع سرمایه ای خواهد شد. لذا برای ترغیب سرمایه گذاران به سرمایه گذاری بیشتر در بازارهای مالی باید مدل های قیمت گذاری موجود پیوسته مورد بررسی قرار گرفته و مدل های مناسب شناسایی و معرفی شوند. هدف پژوهش حاضر مقایسه دقت مدل پیوتروسکی در مقایسه با مدل اولسن در تبیین تغییرات قیمت سهام پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار تهران می باشد. جامعه آماری پژوهش، کلیه شرکت های پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار تهران می باشد طی سالهای ۱۳۸۹ تا ۱۳۹۶ می باشند. داده های مورد نیاز از طریق مراجعه به پایگاه های اطلاعاتی بازار سرمایه بدست آمده است. یافته های پژوهش نشان دهنده توانایی هر دو مدل اولسن و پیوتروسکی در تبیین تغییرات قیمت سهام می باشد. با مقایسه دقت دو مدل مذکور مشخص گردید که دقت مدل پیوتروسکی در تبیین تغییرات قیمت سهام در بورس اوراق بهادار تهران بیشتر از مدل اولسن است.

کلمات کلیدی:

مدل اولسن، مدل پیوتروسکی، ارزش گذاری اوراق بهادار

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1432155>

