

عنوان مقاله:

مقایسه عملکرد روش های معاملاتی میانگین متحرک و خرید و نگهداری در بورس اوراق بهادار تهران

محل انتشار:

همایش ملی مدیریت و آموزش (سال: 1394)

تعداد صفحات اصل مقاله: 9

نویسندگان:

غلامحسین گل ارضی - استادیار گروه مدیریت بازرگانی، دکتری مدیریت مالی، دانشکده اقتصاد، مدیریت، دانشگاه سمنان

علیرضا بحیرایی - استادیار گروه ریاضیات مالی، دکتری ریاضیات مالی، دانشکده ریاضی و آمار، دانشگاه سمنان

امیر گرامی اصل - کارشناسی ارشد MBA، مدیریت مالی، دانشکده اقتصاد، مدیریت، دانشگاه سمنان

خلاصه مقاله:

دلیل اصلی که مردم در بازار سهام سرمایه گذاری می کنند، به دست آوردن سود است که لازمه آن داشتن اطلاعات و انتخاب روشی مناسب برای تصمیم گیری و تجزیه و تحلیل اطلاعات بازار می باشد. در واقع بازده هر سرمایه گذار به روش و استراتژی معاملاتی وی بستگی دارد. از مهمترین روش های سرمایه گذاری میتوان به روش تحلیل تکنیکال اشاره کرد. از آنجایی که رایج ترین و مهمترین روش تحلیل تکنیکال در بین معامله گران و محققان دانشگاهی، شاخص میانگین متحرک می باشد، هدف از این پژوهش مقایسه عملکرد روش میانگین متحرک و خرید و نگهداری در سودآوری سرمایه گذاری در بازار بورس اوراق بهادار تهران و صنایع فعال در آن می باشد. نتایج حاصل از این تحقیق نشان می دهد که استفاده از روش های میانگین متحرک بازده اضافی نسبت به روش خرید و نگهداری ایجاد نمی کند و میانگین بازده ماهانه صنایع و شاخص کل در هر دو روش تفاوت معناداری با یکدیگر نداشته و روش های میانگین متحرک در سطح صنعت و شاخص کل، عملکرد بهتری از روش خرید و نگهداری ندارند.

کلمات کلیدی:

میانگین متحرک، خرید و نگهداری، بورس اوراق بهادار تهران

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/366035>

