

عنوان مقاله:

مقایسه استراتژی تحلیل تکنیکال با روش خرید و نگهداری بر اساس خرید سهام

محل انتشار:

کنفرانس بین المللی مدیریت حسابداری اقتصاد و بانکداری نوین (سال: 1397)

تعداد صفحات اصل مقاله: 17

نویسندگان:

عسکر اسمعیل لو - کارشناسی ارشد رشته حسابداری

ربابه رفیعی خشنود - کارشناسی ارشد رشته حسابداری

خلاصه مقاله:

در این تحقیق کارآمدی روش های خرید سهام با استفاده از استراتژی های تکنیکال نسبت به روش خرید و نگهداری بررسی شد. استراتژی های تکنیکال مورد آزمون، میانگین متحرک نمایی، شاخص قدرت اندازه حرکت و استراتژی ترکیبی شاخص قدرت اندازه حرکت و میانگین متحرک نمایی می باشند. موقعیت های خرید ایجاد شده براساس دوره های روزانه (کوتاه مدت) و هفتگی (میان مدت) برای 16 شرکت سرمایه گذاری در بورس اوراق بهادار تهران در سه سال 1390 تا 1392 استخراج گردید. داده های بدست آمده را با روش خرید و نگهداری برای دوره های سالانه، دوساله سه ساله 1390 تا 1392 مورد مقایسه قرار داده شده است. نتیجه نشان می دهد در دوره هایی که بازار به شدت صعودی باشد (سال 1392) استراتژی های تکنیکال کارایی لازم را ندارند اما در دوره هایی که روند بازار متعادل می باشد استراتژی های تکنیکال برای خرید سهام کارآمدتر می باشند. همچنین در صورتی که خرید در ابتدای سال 1390 انجام و انتهای 1392 فروش صورت گیرد (دوره 3 ساله)؛ تفاوت معناداری بین بازده استراتژی های تکنیکال و خرید و نگهداری مشاهده نمی شود.

کلمات کلیدی:

تحلیل تکنیکال، استراتژی های سرمایه گذاری، میانگین های متحرک، روش خرید و نگهداری

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/869225>

