

عنوان مقاله:

بررسی گام تصادفی در بازار سهام ایران

محل انتشار:

چهارمین همایش بین المللی دانش و فناوری هزاره سوم اقتصاد ، مدیریت و حسابداری ایران (سال: 1400)

تعداد صفحات اصل مقاله: 14

نویسنده:

سهراب استا - استادیار گروه حسابداری دانشگاه ایلام

خلاصه مقاله:

هدف این مقاله بررسی گام تصادفی در بازار سهام است. بدین منظور در خصوص بازدهی ها دو دسته اطلاعات روزانه شامل SP و MSP (شاخص قیمت سهام و متوسط شاخص قیمت سهام) در بازه زمانی ۱۳۹۳ تا ۱۳۹۷ استخراج شده است. همچنین جهت تحلیل آزمون فرضیه گام تصادفی از آزمونهای مختلفی همچون آزمون ریشه واحد، آزمون فیلیپس-پرون، آزمون دیکی فولر تعمیم یافته و آزمون نسبت واریانس استفاده شده است. نتایج تمام آزمون ها یکسان بوده و در تمام آنها فرض صفر گام تصادفی تایید نمی گردد. در نتیجه بازار در شکل ضعیف کارا نمی باشد.

کلمات کلیدی:

فرضیه گام تصادفی، آزمون ریشه واحد، آزمون نسبت واریانس، قیمت سهام

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1236698>

