

## عنوان مقاله:

بررسی عملکرد روش های تکنیکال مبتنی بر تعقیب روند، در معاملات غیرمکرر

## محل انتشار:

فصلنامه مطالعات مهندسی صنایع و مدیریت تولید، دوره 7، شماره 1 (سال: 1400)

تعداد صفحات اصل مقاله: 9

## نویسندگان:

سارا عطاران - کارشناسی ارشد ریاضی، دانشگاه شیراز

سعید صالحی - کارشناسی ارشد مدیریت مالی دانشگاه آزاد اسلامی واحد تهران جنوب

## خلاصه مقاله:

هدف اصلی این پژوهش بررسی عملکرد روش های تکنیکال مبتنی بر تعقیب روند، در معاملات غیرمکرر است. این پژوهش دارای یک فرضیه می باشد. داده های ما شامل بازده روزانه تمام شرکت های معامله شده در بورس اوراق بهادار در سال ۱۳۹۴ و ۱۳۹۵ می باشد. داده ها از برنامه ره آورد نوین گرفته شده و اطلاعات قیمتی آن ها نیز از سایت irbourse گرفته شده اند. با توجه به در نظر گرفتن سهم شرکت هایی که بیشترین تعداد روزهای معاملاتی را داشته اند، از اطلاعات شرکت هایی استفاده شده است که حداقل ۱۵۰ روز کاری در سال معامله داشته اند و سرمایه آن ها بالای ۵۰۰۰ میلیارد می باشد. برای محاسبه سیگنال میانگین متحرک از میانگین متحرک ۵۰ روزه استفاده شده است. داده های هر سهم بر اساس افزایش سرمایه و تقسیم سود انجام گرفته در سال ۱۳۹۴ و ۱۳۹۵ تعدیل شده اند. نرخ سود بدون ریسک، نرخ سود بدون ریسک اوراق مشارکت در بازار بورس و ۲۰٪ روزشمار سالانه در نظر گرفته شده است. نتایج حاصل از پژوهش نشان داد که در روش های تکنیکال مبتنی بر تعقیب روند در معاملات غیر مکرر در حالت با کارمزد می توان تأیید نمود که روش آرون عملکرد بهتری نسبت به میانگین وزنی دارد ولی در خصوص عملکرد بهتر آرون نسبت به میانگین ساده و یا عملکرد بهتر روش میانگین ساده نسبت به روش میانگین وزنی نمی توان از لحاظ آماری چیزی را تأیید کنیم، در حالت بدون کارمزد از لحاظ آماری نمی توان عملکرد بهتر هیچ کدام از روش ها نسبت به روش دیگر را تأیید کرد.

## کلمات کلیدی:

روش تکنیکال، تعقیب روند، معاملات غیرمکرر، روند

## لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1502624>

