

## عنوان مقاله:

بررسی عملکرد روش های تکنیکال مبتنی بر بازگشت به میانگین، در معاملات مکرر

## محل انتشار:

فصلنامه مطالعات مدیریت و کارآفرینی، دوره 7، شماره 1 (سال: 1400)

تعداد صفحات اصل مقاله: 7

## 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 بازگشت به میانگین، در معاملات مکرر است. این پژوهش دارای یک فرضیه می باشد. اطلاعات دو سال این شرکت ها (سال ۱۳۹۴ و ۱۳۹۵) به صورت روزانه و ۵ دقیقه ای از برنامه ره آورد نوین استخراج گردید. داده های مورد نیاز این پژوهش از طریق ره آورد نوین جمع آوری گردید. در این پژوهش به کمک کدنویسی در برنامه متلب به طراحی سیستم معاملاتی برای هر یک از اندیکاتور های میانگین متحرک ساده، میانگین متحرک وزنی و روش آرون و بولینگر باند و RSI پرداخته شده است. نتایج حاصل از پژوهش نشان داد که در روش های تکنیکال مبتنی بر بازگشت به میانگین در تکرر بالای معاملات در حالت با کارمزد روش RSI عملکرد بهتری نسبت به روش دیگر دارد ولی در حالت بدون کارمزد با اینکه روش بولینگر باند بهتر از روش دیگر است نمی توان از لحاظ آماری آن را تایید کرد.

## کلمات کلیدی:

بازگشت به میانگین، معاملات مکرر، تکنیکال، عملکرد

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1547536>

