

عنوان مقاله:

بررسی رابطه بین حجم معاملات سهام و بازدهی سهام با روش فراتحلیل

محل انتشار:

یازدهمین کنفرانس بین المللی چشم اندازهای نوین در مدیریت، حسابداری و کارآفرینی (سال: 1403)

تعداد صفحات اصل مقاله: 14

نویسنده:

مرتضی شماخی - کارشناسی ارشد رشته مدیریت مالی دانشگاه دانش البرز

خلاصه مقاله:

هدف از اجرای تحقیق حاضر، بررسی رابطه بین حجم معاملات سهام و تغییر قیمت سهام در شرکت های پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار با روش فراتحلیل می باشد. حجم مبادلات در واقع مسئله پایداری و صحت قیمت را مورد بررسی قرار می دهد و تحقیقاتی که حجم مبادلات را در کنار بازدهی در نظر نمی گیرند در واقع مساله ی صحت قیمت را مورد توجه قرار نمی دهند. بر این اساس پس از مروری جامع بر ادبیات موضوعی مربوط به حجم معاملات و بازدهی سهام، آزمون های تعیین اثر اندازه بین متغیرهای تحقیقات ۲۰ سال گذشته در مقالات معتبر علمی دنیا در این زمینه انجام گردید. نتایج تحقیقات نشان داده است که در ساختار معاملات بازار روابطی وجود دارد و تعداد دفعات معامله و تعداد سهام معامله شده و بازدهی سهام روزانه با یکدیگر رابطه ی مثبت دارند. این ارتباط در فاصله ی زمانی یک روز نیز وجود دارد بنابراین بازدهی سهام سهام از تعداد سهام معامله شده و تعداد دفعات معامله شده ی روز قبل نیز نشات می گیرد، ضمن اینکه بازدهی سهام سهام طی روزهای متوالی از یک روند صعودی یا نزولی تبعیت می کند.

کلمات کلیدی:

اوراق بهادار، بازار سرمایه، قیمت سهام، بازدهی سهام، حجم معاملات، تعداد سهام معامله شده در هر روز

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/2052511>

