

عنوان مقاله:

تعیین مدل ارزش سهام بر اساس زنجیره مارکوف و مقایسه با مدل P/E

محل انتشار:

اولین کنفرانس بین المللی اقتصاد، مدیریت، حسابداری و علوم اجتماعی (سال: 1393)

تعداد صفحات اصل مقاله: 20

نویسندگان:

زینب جوادیان کوتناپی - کارشناس ارشد حسابداری

سیدمعصومه پورباقر کردی - کارشناس ارشد حسابداری

خلاصه مقاله:

در این بررسی دست به مقایسه دو مدل زنجیره مارکوف و مدد P/E در بازار بورس اوراق بهادار زده ایم. ارزشیابی سهام یکی از مسائل بسیار پیچیده است و هیچ مدل ارزشیابی وجود ندارد که بتواند بده درسدتی ارزش ذاتی یک سه را پیشبینی کند حتی هیچ مدلی وجود ندارد که بتواند پیشبینی دقیقی از تغییرات قیمت در آینده را ارائه دهد در مدل زنجیره مارکوف سرعت رشد سود سهام به عنوان متغیر در نظر گرفته می شود. فرضیه های پژوهش روش همبستگی انتخاب گردید. از آمار توصیفی- انحراف م عیار، میانگین تحلیل رگرسیون (رگرسیون چند متغیره برای مقایسه مدلهای) برای مقایسه مدلهای استفاده می شود. باید به این نکته نیز اشاره نمائیم که بهترین شیوه ارزشیابی در بازار سهام همچنان P.E می باشد.

کلمات کلیدی:

شاخص ارزش، ارزشگذاری سهام، مدل P.E، مدل اولسون، زنجیره مارکوف

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/301568>

