

عنوان مقاله:

مقایسه و بررسی کارایی استراتژی های معاملاتی راهبرد معکوس و مومنتوم با استفاده از ابزار RSI

محل انتشار:

اولین کنفرانس بین المللی مدیریت و حسابداری با رویکرد ارزش آفرینی (سال: 1394)

تعداد صفحات اصل مقاله: 10

نویسندگان:

ابراهیم عباسی - دانشیار و عضو هیئت علمی دانشگاه الزهراء(س)

محمد مشاری - دانشجوی دکتری مدیریت مالی دانشگاه آزاد

خلاصه مقاله:

هدف از این پژوهش مقایسه کارایی استراتژی های معاملاتی راهبرد معکوس و مومنتوم با یکدیگر است. در این پژوهش جهت تشخیص زمان معاملات بر مبنای راهبردهای مذکور از اندیکاتور موسوم به RSI استفاده گردید که این اندیکاتور یکی از ابزارهای محبوب و پر استفاده میان سرمایه گذاران بورس اوراق بهادار می باشد. تست فرضیات این پژوهش نشان داد که میانگین بازدهی راهبردهای معاملاتی مذکور بطور معنا داری با یکدیگر اختلاف دارد.

کلمات کلیدی:

مالی رفتاری، تجزیه و تحلیل تکنیکال، استراتژی های معاملاتی، شاخص قدرت نسبی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/374270>

