

عنوان مقاله:

تحلیل فراکتالی صنعت فرآورده های نفتی با استفاده از روش مندل برات

محل انتشار:

سومین همایش بین المللی مدیریت، اقتصاد و توسعه (سال: 1395)

تعداد صفحات اصل مقاله: 10

نویسندگان:

حجت اله صادقی - استادیار دانشگاه یزد

محمد نسیم سبحان - دانشجوی کارشناسی ارشد مدیریت مالی دانشگاه علم و هنر یزد

خلاصه مقاله:

بررسی کارایی بازارهای مالی ادبیات وسیعی را در علم مالی به خود اختصاص داده است. یکی از مفاهیمی که در بازار کارا مطرح می باشد این است که آیا سری زمانی مالی دارای حافظه بلندمدت می باشد یا نه. همچنین طی دهه های اخیر فرضیه بازارهای کارا تعمیم یافته و فرضیه بازارهای فراکتالی مطرح شده است. در این تحقیق میزان حافظه بلندمدت و پایداری سری زمانی مالی ناشی از سابقه شاخص فرآورده های نفتی بورس اوراق بهادار تهران از فروردین ماه سال 1392 تا خردادماه سال 1395 با استفاده از محاسبه نمای هرست با روش مندل برات مورد بررسی قرار گرفته است. بدین ترتیب شاخص فرآورده های نفتی بازار سرمایه ایران از لحاظ فراکتالی سنجیده می شود که نشان می دهد این شاخص در قلمرو زمانی مذکور فاقد کارایی می باشد.

کلمات کلیدی:

کارایی بازار، سری زمانی مالی، تحلیل فراکتالی، نمای هرست، حافظه بلندمدت، فرآورده های نفت

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/581177>

