

عنوان مقاله:

بررسی بازده در شرکت سرمایه گذاری با سه روش مارکو سوچیچینگ، بازده متقارن و نامتقارن

محل انتشار:

مهندسی مالی و مدیریت اوراق بهادار، دوره 7، شماره 29 (سال: 1395)

تعداد صفحات اصل مقاله: 20

نویسندگان:

فاطمه صمدی - استادیار، دکتر مدیریت مالی، گروه حسابداری، دانشگاه آزاد اسلامی، واحد تهران شرق، تهران، ایران

فریدون رهنمای رودپشتی - استاد دکتر مدیریت مالی، گروه مدیریت مالی، دانشگاه آزاد اسلامی، واحد علوم و تحقیقات، تهران، ایران.

هاشم نیکومرام - استاد دکتر مدیریت مالی، گروه مدیریت مالی، دانشگاه آزاد اسلامی، واحد علوم و تحقیقات، تهران، ایران.

خلاصه مقاله:

برای بیش از چند دهه تئوری مالی مدرن به عنوان تنها اصلی ترین دیدگاه در بازار سرمایه مبنای اکثر تحقیقات قرار داشته است. ولی وجود بحران های ایجاد شده در دهه های گذشته در اکثر کشورها و همچنین تحقیقات انجام شده به نظر می رسد که بسیاری شکست هادر بازارهای مالی ناشی از همین تئوری های مدرن و فرضیات سنتی در بازارها می باشد. بنابراین نیاز به بازنگری در این تئوری ها و فرضیات به شدت احساس می شود. این دیدگاه نوین که با توجه به تئوری آشوب و علم فرکتال، ایده های نئوکلاسیک را دگرگون کرده و روش ها وواژه های کافی برای توصیف بازار های سرمایه به ما می دهند. در این تحقیق به دنبال بررسی بازده با روش های بازار متقارن، نامتقارن و مارکوسوچیچینگ می باشیم.

کلمات کلیدی:

بازار فرکتال، بازار متقارن، نامتقارن، MSM

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/958658>

