

بررسی عملکرد روش‌های تکنیکال مبتنی بر بازگشت به میانگین، در معاملات مکرر

سارا عطاران^۱، سعید صالحی^۲

^۱ کارشناسی ارشد ریاضی، دانشگاه شیراز

^۲ کارشناسی ارشد مدیریت مالی دانشگاه آزاد اسلامی واحد تهران جنوب

چکیده

هدف اصلی این پژوهش بررسی عملکرد روش‌های تکنیکال مبتنی بر بازگشت به میانگین، در معاملات مکرر است. این پژوهش دارای یک فرضیه می‌باشد. اطلاعات دو سال این شرکت‌ها (سال ۱۳۹۴ و ۱۳۹۵) به صورت روزانه و ۵ دقیقه‌ای از برنامه ره‌آورد نوین استخراج گردید. داده‌های موردنیاز این پژوهش از طریق ره‌آورد نوین جمع‌آوری گردید. در این پژوهش به کمک کدنویسی در برنامه متلب به طراحی سیستم معاملاتی برای هر یک از اندیکاتورهای میانگین متحرک ساده، میانگین متحرک وزنی و روش آرون و بولینگر باند و RSI پرداخته شده است. نتایج حاصل از پژوهش نشان داد که در روش‌های تکنیکال مبتنی بر بازگشت به میانگین در تکرر بالای معاملات در حالت با کارمزد روش RSI عملکرد بهتری نسبت به روش دیگر دارد ولی در حالت بدون کارمزد با اینکه روش بولینگر باند بهتر از روش دیگر است نمی‌توان از لحاظ آماری آن را تایید کرد.

واژه‌های کلیدی: بازگشت به میانگین، معاملات مکرر، تکنیکال، عملکرد

مطالعات مدیریت و کارآفرینی

دوره ۷، شماره ۱، بهار ۱۴۰۰، صفحات ۴۲۷-۴۲۱