

## مشخصات نویسندگان مقاله بررسی تحلیلی روند سربهای زمانی

### مالی در بورس اوراق بهادار تهران

○ **محمد رضا عباسزاده** - عضو هیئت علمی گروه حسابداری دانشگاه

فردوسی مشهد

○ **مهدی جباری نوقابی** - عضو هیئت علمی گروه آمار دانشگاه

فردوسی مشهد

○ **الهام محکی** - دانشجوی کارشناسی ارشد حسابداری موسسه آموزش

عالی سناباد

### چکیده مقاله:

با گسترش بازارهای مالی و ناشناخته بودن عوامل تاثیرگذار بر سربهای زمانی مالی و اقتصادی، سهامداران و سیاستگذاران برای تصمیمگیری بهینه و کاهش ریسک، نیازمند آشنایی با مدل‌های پیش بینی و چگونگی استفاده از آنها هستند. سربهای زمانی پیچیده مانند قیمت‌های بازارهای سهام معمولاً تصادفی و غیرقابل پیش‌بینی (نظریه کارایی در بازارهای مالی) فرض میشود، در حالیکه ممکن است این سربها محصول یک فرایند غیرخطی یویای معین (آشوبی) و در نتیجه قابل پیش‌بینی باشند که اگر آزمونهای استاندارد تشخیص روند تصادفی به کار گرفته شود، امکان تشخیص تمایز این دو وجود دارد. نظریه آشوب روش قوی برای شناسایی ماهیت فرایندهای مالی و اقتصادی است. در این راستا با مروری اجمالی بر نظریه آشوب به بررسی مبانی نظری، پیشینه و ویژگیهای این نظریه پرداخته و به معرفی ابزارها و آزمونهایی که قادر به کشف فرایندهای تصادفی از فرایندهای آشوبی و معین هستند، میپردازیم. این موضوعات پیش پردازش‌هایی محسوب میگردند که در مدلسازی و پیش بینی اهمیت زیادی خواهد داشت؛ اتخاذ سیاستهای صحیح در رابطه با بازار سرمایه با توجه به نتایج به‌دست آمده از این دست مطالعات، میتواند گامی مثبت در بهبود عملکرد بازار سرمایه و تخصیص منابع به نحو بهینه باشد

### کلیدواژه‌ها:

نظریه آشوب، فرایندهای تصادفی، سیستم‌های خطی و غیرخطی، پیش بینی سری زمانی، فرضیه بازار کارا،