

عنوان مقاله:

بررسی پیش بینی شاخص قیمت سهام با روشهای محاسباتی (شبکه عصبی مصنوعی) در بورس اوراق بهادار تهران

محل انتشار:

اولین همایش حسابداری، اقتصاد و نوآوری در مدیریت (سال: 1395)

تعداد صفحات اصل مقاله: 10

نویسندگان:

حسن عالیان - کارشناسی ارشد حسابداری دانشگاه آزاد اسلامی واحد بندرعباس (نویسنده مسئول)

رضوان حجازی - استاد تمام دانشگاه الزهرا (س) تهران

خلاصه مقاله:

شاخص قیمت سهام نشان دهنده وضعیت کلی اقتصاد یک کشور است. افزایش این شاخص به معنی رونق و بهبود در اوضاع و احوال اقتصادی کاهش آن بیانگر بحران و رکود است. از اینرو می توان نتیجه گیری کرد که پیش بینی این شاخص می تواند در تصمیم گیری های سرمایه گذاران، صاحبان صنایع و حتی تحلیلگران بازار سرمایه و اقتصاد مفید فایده واقع شود. اگرچه پژوهش های تجربی بسیاری در ارتباط با موضوع پیش بینی شاخص قیمت سهام صورت گرفته است، با این حال، پژوهش های اندکی در ارتباط با بازارهای مالی در حال توسعه صورت گرفته است. همچنین، با توجه به پیشرفت الگوریتم های مربوط به پیش بینی؛ در تحقیق حاضر به مدلسازی و پیش بینی شاخص قیمت سهام بازار بورس تهران با استفاده از روشهای سری زمانی کلاسیک پرداخته شده است. بدین منظور، از اطلاعات آماری موجود برای سال های 1385 تا 1393 استفاده گردید. نتایج بدست آمده روش دقت مدل هوش محاسباتی، از روش شبکه های عصبی مصنوعی با توجه به معیارهای ارزیابی عملکرد، نسبت به دیگر روش های استفاده شده در این تحقیق بیشتر است. بنابراین، مدل سازی و پیش بینی قیمت کل سهام با استفاده هوش محاسباتی، از روش شبکه های عصبی مصنوعی مطلوب می باشد و این مدل توانایی در افزایش خطای برآورد شاخص کل قیمتتوان اذعان داشت؛ فرضیه مورد تأیید واقع قرار می گیرد.

کلمات کلیدی:

قیمت سهام ، سری های زمانی ، شبکه عصبی مصنوعی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/561065>

