

عنوان مقاله:

پیشبینی شاخص کل سهام با استفاده از روش میانگین متحرک موزون در بورس اوراق بهادار تهران

محل انتشار:

دومین کنفرانس ملی مدیریت مهندسی (سال: 1396)

تعداد صفحات اصل مقاله: 7

نویسندگان:

الهام صفری

رقیه دوست صفت

کامران مهربدوست

خلاصه مقاله:

از مهم ترین عوامل تاثیرگذار که بر تصمیمات سرمایه گذاران در بازارهای مالی اثر می گذارد می توان به اندازه و روند شاخص های قیمت سهام اشاره کرد، همچنین پیش بینی وضعیت آینده اقتصاد و بازار سرمایه یکی از مهم ترین مسایل مورد بحث در علوم مالی بوده است. امروزه بیشترین مقدار سرمایه از طریق بازارهای بورس در تمام جهان مبادله می گردد. به علاوه بازار بورس به عنوان ابزار سرمایه گذاری، هم برای سرمایه گذاران کلان و هم برای عموم مردم در دسترس است. یکی از ابزارهای کاهش عدم اطمینان پیش بینی بازار بورس است و سرمایه گذاری در بورس بخش مهمی از اقتصاد را تشکیل می دهد. در پژوهش حاضر هدف پیش بینی شاخص کل بازار با استفاده از روش میانگین متحرک موزون و با بهره گیری از اطلاعات شاخص کل بازار در بازه زمانی 1390-1395 می باشد و نتیجه حاکی از اوزان بهینه برای پیش بینی بوده است.

کلمات کلیدی:

پیش بینی، شاخص کل، میانگین متحرک، بورس اوراق بهادار

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/653288>

