

عنوان مقاله:

ارائه یک رویکرد جدید مبتنی بر سریهای زمانی برای پیش بینی بازار سهام

محل انتشار:

اولین کنفرانس بین المللی مهندسی صنایع، مدیریت، اقتصاد و حسابداری (سال: 1400)

تعداد صفحات اصل مقاله: 12

نویسنده:

میلاذ سراج - کارشناس ارشد مهندسی صنایع گرایش سیستم های مالی دانشگاه آزاد اسلامی واحد تهران شمال

خلاصه مقاله:

سرمایه گذاری در بازار سهام مستلزم تصمیم گیری در خصوص خرید سهام جدید و حفظ یا فروش سهام موجود می باشد که این خود نیازمند دستیابی به اطلاعاتی در خصوص آینده قیمت بازار سهام می باشد. پیش بینی بازار سهام به کمک کشف الگوهای رفتاری فرایند مولد قیمت سهام امکان پذیر است، هدف اصلی تحقیق حاضر ارائه یک رویکرد جدید مبتنی بر سریهای زمانی برای پیش بینی بازار سهام بوده است، با در نظر گرفتن مدل تحقیق به محاسبه دو مدل آرچ و گارچ با استفاده از نرم افزار ایویوز پرداخته شد. نتایج هر دو آزمون نشانگر معنی دار بودن مدل داشت. ضریب تعیین در هر دو مدل مقدار بالائی را نشان داد به گونه ای که ۹۱ درصد تغییرات در مدل آرچ و در ۹۶ درصد تغییرات در مدل گارچ به وسیله متغیرهای مستقل قابل تبیین بود. آزمون مانائی متغیرها نیز با استفاده از روش دیکی فولر صورت گرفت که در سطح تمامی متغیرها غیر مانا تشخیص داده شده و با تفاضل مرتبه اول تمامی متغیرها به ایستائی میرسند. آزمون تارچ نیز به عنوان توسعه ای بر مدل ها انجام شد که نتایج این آزمون نیز نشانگر معنی داری و قدرت مدل تحقیق بود

کلمات کلیدی:

پیش بینی، بازده در خطر، مدل های سری زمانی، خانواده گارچ، بورس اوراق بهادار تهران

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1220637>

