

## عنوان مقاله:

بررسی عملکرد شبکه عصبی بیزین و لونبرگ مارکوات در مقایسه با مدل های کلاسیک در پیش بینی قیمت سهام شرکت های سرمایه گذاری

## محل انتشار:

فصلنامه تحقیقات مالی، دوره 19، شماره 2 (سال: 1396)

تعداد صفحات اصل مقاله: 20

## نویسندگان:

حسین فخاری - دانشیار گروه حسابداری، دانشکده علوم اقتصادی و اداری، دانشگاه مازندران، بابلسر، ایران

محمد ولی پور خطیر - استادیار گروه مدیریت صنعتی، دانشکده علوم اقتصادی و اداری، دانشگاه مازندران، مازندران، ایران

سیده مائده موسوی - کارشناس ارشد حسابداری، دانشکده علوم اقتصادی و اداری، دانشگاه مازندران، مازندران، ایران

## خلاصه مقاله:

پیش بینی دقیق قیمت سهام، با توجه به نوسان های زیاد و ریسک ذاتی بازار سرمایه، یکی از دغدغه های اصلی سرمایه گذاران و تحلیل گران مالی است، از این رو به کارگیری رویکردهای نوین پیش بینی قیمت سهام ضرورت اجتناب ناپذیری است. بر این اساس، هدف تحقیق حاضر، مقایسه عملکرد مدل های پیش بینی شبکه عصبی با مدل های کلاسیک و معرفی مدل مناسب برای پیش بینی قیمت روز آتی سهام است. برای طراحی مدل پیش بینی با شبکه عصبی، از داده های قیمت روزانه بازار و شاخص های تکنیکی مالی به عنوان متغیرهای ورودی استفاده شد و برای طراحی مدل آریمای، داده های قیمت بسته شدن روزانه به عنوان متغیر ورودی و همچنین قیمت بسته شدن روز آتی به عنوان متغیر خروجی هر دو مدل در دوره زمانی ۱۳۹۰ تا ۱۳۹۳ در نظر گرفته شد. نتایج به دست آمده با شبکه عصبی بیزین بیان کننده خطای کمتر و قدرت پیش بینی بیشتر آن در مقایسه با مدل آریمای است. یافته های تحقیق گویای کارایی بیشتر شبکه عصبی بیزین در استفاده از فرصت های سرمایه گذاری کوتاه مدت بازار است که می تواند به سرمایه گذاران در انتخاب پرتفوی مناسب و کسب بازده بیشتر کمک کند.

## کلمات کلیدی:

آریمای، پیش بینی قیمت سهام، تابع آموزش بیزین، تابع آموزش لونبرگ مارکوات، شبکه عصبی

## لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1394971>

