

عنوان مقاله:

پیش بینی قیمت سهام با استفاده از روش خود رگرسیون با وقفه توزیعی (ARDL)

محل انتشار:

فصلنامه تحقیقات مالی، دوره 9، شماره 23 (سال: 1386)

تعداد صفحات اصل مقاله: 12

نویسندگان:

محمد حسن قلی زاده

قاسم وحید پور

خلاصه مقاله:

پیش بینی قیمت سهام همواره مورد توجه بسیاری از سهامداران و تحلیل گران بوده است. این امر بیشتر در سال های اخیر با استفاده از روش های نوین صورت پذیرفته است. درحالی که بیشتر این روش ها متکی برمبانی رگرسیون هستند. ARDL (روش خود رگرسیون توضیح دهنده برداری) از روش های رگرسیون همجمع تک معادله ای که وقفه های گذشته متغیرهای مستقل و خود متغیر توضیحی را در معادله می گنجاند تا برآوردی دقیق به دست دهد. آزمون های مربوط به آن از جمله ثبات ساختاری و ناهمسانی واریانس و خود همبستگی بر روی آن انجام می شود تا برآورد و پیش بینی نهایی بر روی آن صورت گیرد.

کلمات کلیدی:

روش ARDL، متغیرهای موثر شرکت های کانی غیرفلزی بازار بورس ایران

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1395579>

