

عنوان مقاله:

پیش بینی بازده سهام در بورس اوراق بهادار تهران: مدل شبکه های عصبی مصنوعی و مدل چند عاملی

محل انتشار:

فصلنامه تحقیقات مالی، دوره 5، شماره 15 (سال: 1382)

تعداد صفحات اصل مقاله: 24

نویسندگان:

دکتر رضا راعی

کاظم چاوشی

خلاصه مقاله:

این تحقیق به پیش بینی پذیری رفتار بازده سهام در بورس اوراق بهادار بوسیله مدل خطی عاملی و شبکه های عصبی مصنوعی می پردازد. جهت آزمون این مساله، قیمت روزانه سهام شرکت توسعه صنایع بهشهر به عنوان نمونه انتخاب شده است. متغیرهای مستقل (ورودی های) تحقیق، پنج متغیر کلان اقتصادی، یعنی شاخص کل قیمت بورس تهران، نرخ ارز (دلار) در بازار آزاد، قیمت نفت، قیمت طلا می باشد. برای برآزش مدل عاملی از رگرسیون خطی چند متغییره و برای مدل شبکه عصبی از معماری (MLP) با الگوریتم آموزش پس انتشار خطا استفاده شده است. نتایج حاصله حاکی از موفقیت این دو مدل در پیش بینی رفتار بازده سهام مورد نظر و همچنین برتری عملکرد شبکه های عصبی مصنوعی بر مدل چند عاملی می باشد.

کلمات کلیدی:

بازده سهام، پیش بینی، شبکه های عصبی مصنوعی، مدل چند عاملی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1395637>

