

عنوان مقاله:

پیش بینی قیمت سهام با استفاده از تبدیل موجک

محل انتشار:

ششمین همایش بین المللی مدیریت، حسابداری، اقتصاد و علوم اجتماعی (سال: 1400)

تعداد صفحات اصل مقاله: 19

نویسندگان:

امیراحمد ظهیر مبرهن - دانشجوی کارشناسی ارشد موسسه آموزش عالی ارشاددماوند

احمدرضا قاسمی - استاد موسسه آموزش عالی ارشاد دماوند

خلاصه مقاله:

هنگامی که بازار مالی دچار تغییرات کاهشی و افزایشی، تخمین بازار درخصوص ورود سهام دارها به بازار سهام شامل دو دیدگاه است: اگر اشخاص نگاه بلند مدت به بازار داشته باشند میتوانند به صنایع باارزش بازار ورود نمایند و در نهایت از سود قابل قبول بهره مند گردند. در حالیکه اگر نگاه کوتاه مدتی نسبت به تغییرات سرمایه گذاری داشته باشند، توصیه می شود که به بازار ورود ننمایند. علی ایحال ارزش سهام در بورس به دلیل گستردگی زیاد سازمان ها و تغییرات بهای ارز، استرس های سیاسی- اجتماعی و... در معرض کاهش و افزایش های متعددی میباشد. تخمین سریع و تقریباً با دقت بالای ارزش سهام، سبب کاهش ضررهای محتمل، برگشت سرمایه و افزایش سود می شود. این کار هم کاهش ریسک سرمایه گذاری و هم موجب افزایش سطح رضایت و تصمیم گیری یکپارچه سهام دارها می شود. در این پژوهش، به منظور تخمین قیمت سهام بانک های موجود در بورس، روشی ترکیبی بر پایه ی ارزیابی و ردگیری نوسانات قیمت سهام بانک ها توسط تبدیل موجک گسسته با توجه به پارامترهای تعداد و حجم سهام و تخمین قیمت سهام توسط الگوریتم شبکه عصبی بر پایه پارامترهای تبدیل موجک معرفی شده است. پایگاه داده ها در این پژوهش از سایت www.tsetmc.com جمع آوری گردیده است. داده ها از ۲۰ بانک طی ۵ سال در بازه ۱۳۹۵ تا ۱۳۹۹ بصورت روزانه استخراج گردیده است. تخمین این روش جهت اهداف بلند مدت مفیدتر است. چون هرچه تعداد داده ها بالاتر روند شناخت دقیق تری نسبت به سیستم حاصل می گردد. الگوریتم هوشمند شبکه ی عصبی به علت تطبیق پذیری نسبی نسبت به نوسانات، تخمین قیمت سهام را با درصد قابل قبول حدود ۸۵٪ بدست می دهد. در شرایط یکسان الگوریتم های هوشمند دقت بالاتری را نسبت به روابط ریاضی با ضرایب ثابت از خود نشان می دهند.

کلمات کلیدی:

تخمین قیمت سهام، تبدیل موجک، شبکه عصبی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1433992>

