

عنوان مقاله:

بررسی قابلیت پیش بینی نوسانات قیمت سهام در بازار بورس تهران (تخمین بعد همبستگی)

محل انتشار:

فصلنامه مواد پیشرفته در مهندسی، دوره 18، شماره 1 (سال: 1378)

تعداد صفحات اصل مقاله: 8

نویسندگان:

حمید خالوزاده

علی خاکی صدیق و کارولوکس

خلاصه مقاله:

با استفاده از تحلیل غیر خطی بر روی قیمت سهام یکی از شرکتها در بازار بورس تهران، ماهیت فرایند مربوط به سری زمانی قیمت آن شرکت، مشخص می شود. روش به کار رفته برای هر شرکت دیگری قابل اجراست. دیدگاه مورد مطالعه در این پژوهش براساس نظریه آشوب^۱ است. نشان داده می شود که رفتار فرایند مربوط به سری زمانی قیمت سهام مورد مطالعه رفتاری آشوبگونه ضعیف^۲ است، تمایز این گونه رفتار با رفتار تصادفی، پیش بینی رفتار این سهام را ممکن می سازد. همچنین با انجام تحلیل مربوط به تخمین بعد همبستگی^۳ دریافته می شود که برای مدلسازی رفتار قیمت سهام در بازار بورس تهران تنها قیمتهای ثبت شده قبل برای تجدید دینامیک و ساختار فرایند مولد قیمت آن سهام کافی نیست و می بایست متغیرهای دیگری را نیز دخیل کرد.

کلمات کلیدی:

-، -

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1455075>

