

عنوان مقاله:

پیش بینی شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران با استفاده از الگوریتم بهینه سازی کاوش باکتری

محل انتشار:

مهندسی مالی و مدیریت اوراق بهادار, دوره 12, شماره 48 (سال: 1400)

تعداد صفحات اصل مقاله: 20

نویسنده:

احمد ناطق گلستان - گروه مدیریت مالی، واحد مشهد، دانشگاه آزاد اسلامی، خراسان رضوی، ایران

خلاصه مقاله:

پیش بینی شاخص کل قیمت به عنوان یکی از چالش برانگیزترین مباحث مالی مورد توجه قرار گرفته است و صحت این پیش بینی ها برای بهبود استراتژی های معاملاتی و سرمایه گذاری در بورس بسیار مهم است. هدف اصلی این تحقیق پیش بینی شاخص کل قیمت بورس اوراق بهادار تهران با استفاده از روش های هوشمند است. جهت مدل سازی از الگوریتم بهینه سازی کاوش باکتری استفاده شده است. در این تحقیق داده های شاخص کل قیمت بورس اوراق بهادار تهران در بازه زمانی فروردین ماه ۱۳۸۵ تا اسفند ماه ۱۳۹۸ جمع آوری شده است. سپس با استفاده از داده های شاخص کل قیمت (شامل بالاترین قیمت، پایین ترین قیمت، قیمت بسته شدن و تعداد سهام معامله شده) و بوسیله نرم افزار اکسل مقادیر ۸ شاخص تکنیکال به عنوان ورودی الگوریتم بهینه سازی کاوش باکتری محاسبه شده و در نهایت بوسیله نرم افزار متلب اقدام به پیش بینی شاخص کل قیمت شده است. نتیجه تحقیق نشان می دهد که الگوریتم بهینه سازی کاوش باکتری با دقت ۹۷ درصد توانایی پیش بینی شاخص کل قیمت بورس اوراق بهادار تهران را دارد.

کلمات کلیدی:

: بورس اوراق بهادار, بهینه سازی کاوش باکتری, پیش بینی, شاخص سهام

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1490120>

