

عنوان مقاله:

ارائه مدلی در پیش بینی جهت حرکت شاخص کل قیمت سهام بورس اوراق بهادار تهران

محل انتشار:

اولین همایش منطقه ای رویکردهای نوین حسابداری و حسابرسی (سال: 1391)

تعداد صفحات اصل مقاله: 15

نویسندگان:

محمود معین الدین - استادیار و عضو هیئت علمی دانشگاه آزاد اسلامی واحد یزد

حسن دهقان دهنوی - استادیار و عضو هیئت علمی موسسه آموزش عالی امام جواد (ع)

سمیه انتظاری - کارشناسی ارشد حسابداری دانشگاه آزاد اسلامی واحد یزد

خلاصه مقاله:

مهم ترین عامل موثر بر تصمیم گیری سرمایه گذاران در بورس اوراق بهادار، شاخص قیمت سهام است، در واقع شاخص قیمت سهام نمایانگر وضعیت کلی بازار سهام است. از این رو، پیش بینی دقیق حرکات شاخص قیمت سهام برای سرمایه گذاران از اهمیت بسزایی برخوردار است. در سال های گذشته در زمینه پیش بینی شاخص مذکور، در داخل و خارج کشور تحقیقات متعددی صورت گرفته است که در اغلب تحقیقات داخلی، از متغیرهای کلان اقتصادی در پیش بینی شاخص قیمت سهام استفاده شده است. لذا، هدف پژوهش حاضر پیش بینی جهت حرکت شاخص کل قیمت سهام (TEPIX) استفاده از مقادیر تاریخی شاخص قیمت سهام که شامل، قیمت بسته شده، بالاترین قیمت و پایین ترین قیمت شاخص قیمت سهام است و ایجاد مدل های ترکیبی از آنها می باشد و قلمرو زمانی مورد بررسی، فاصله زمانی سال های 1380 الی 1387 می باشد به منظور پیش بینی شاخص، از تکنیک حداقل مربعات معمولی (OLS) استفاده شده که با طراحی سه مدل ترکیبی متفاوت، عمل پیش بینی انجام می شود. جهت ارزیابی کارایی و همچنین مقایسه توانایی هر یک از مدل ها، مدل های مذکور از لحاظ عملکرد آماری و مالی، با استفاده از معیارهای MAE, RMSE, MAPE و همچنین نرخ پیش بینی Prediction Rate مورد مقایسه قرار گرفته اند که به طور کلی، نتایج حاکی از برتری مدل سوم که ترکیبی از مقادیر قیمت بسته شده، بالاترین قیمت و پایینی ترین قیمت شاخص قیمت سهام می باشد، است.

کلمات کلیدی:

پیش بینی، شاخص کل قیمت سهام، بورس اوراق بهادار تهران

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/169414>

