

عنوان مقاله:

پیش بینی شاخص کل قیمت بورس اوراق بهادار تهران با استفاده از مدل های پیوندی

محل انتشار:

اولین همایش بین المللی اقتصاد سنجی، روشها و کاربردها (سال: 1391)

تعداد صفحات اصل مقاله: 21

نویسندگان:

هوشیار رحمانیانی - مدیر گروه تحلیل کارگزاری مبین سرمایه- کارشناسی ارشد اقتصاد دانشگاه آژ

مولود رحمانیانی - مدرس دانشگاه پیام نور واحد پاوه- کارشناسی ارشد اقتصاد دانشگاه علامه ط

خلاصه مقاله:

گسترش اطلاعات و ورود ابزارهای نوین مالی باعث شده است که تبیین نوسانات بازارها بدون بهره گیری از مدل ها و شیوه های نوین غیر ممکن باشد. در این پژوهش با استفاده از 260 داده روزانه قیمت هر انس طلا، قیمت نفت برنت اروپا، شاخص بورس اوراق بهادار نیویورک و نرخ ارز با کمک مدل های منفرد، ترکیبی و پیوندی که در آنها از روشهای شبکه عصب مصنوعی چند لایه و مدل های سری زمانی استفاده شده است، شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران برای 5 دوره بعد پیش بینی شده است. نتایج بدست آمده نشان می دهد پیش بینی شاخص کل قیمت بورس اوراق بهادار تهران با روشهای پیوندی نسبت به روشهای منفرد و ترکیبی دارای خطای کمتری می باشد و همچنین تغییر در ترتیب پیوند مدل های خطی و غیر خطی پیش بینی را بهبود می بخشد. با مقایسه روشهای مختلف دریافتیم که شاخص کل قیمت بورس اوراق بهادار تهران بیشترین تأثیر را از مقادیر تاریخی خود می پذیرد.

کلمات کلیدی:

روشهای پیش بینی پیوندی، شبکه های عصبی مصنوعی، شاخص بورس اوراق بهادار تهران

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/176160>

