

عنوان مقاله:

الگوسازی و پیش بینی نوسانات شاخص کل قیمت بورس اوراق بهادار تهران با استفاده از الگوهای واریانس ناهمسان شرطی خود رگرسیو

محل انتشار:

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

تعداد صفحات اصل مقاله: 22

نویسندگان:

محمدرضا ادراکی - کارشناس ارشد آمار کاربردی دانشگاه شهید بهشتی (۱۳۷۷) - کارشناس ارشد مدیریت ما

رضا تهرانی - دانشیار دانشکده مدیریت دانشگاه تهران

خلاصه مقاله:

در این مقاله، با برآزش تعدادی الگوی خانواده واریانس ناهمسان شرطی برای سری شاخص کل قیمت بورس اوراق بهادار تهران (TEPIX) مقایسه ای بین دقت برآزش این الگوها بر پایه معیارهای هنان- کوئین (HQ)، اطلاع آکائیک (AIC) و شوارز (SC) انجام شده است. الگوهای در نظر گرفته شده کلاس الگوهای واریانس ناهمسان شرطی خودرگرسیو تعمیم یافته، واریانس ناهمسان شرطی خودرگرسیو تعمیم یافته نمایی و واریانس ناهمسان شرطی خودرگرسیو تعمیم یافته انباشته را شامل می شود که در هر کلاس از سه نوع توزیع نرمال، t - استیودنت و توزیع خطای تعمیم یافته استفاده شده که نتایج حاکی از این است که الگوی IGARCH با توزیع نرمال از برآزش بهتری نسبت به سایر الگوها برخوردار است. در ادامه به بررسی قدرت پیش بینی کنندگی و مقایسه پیش بینی های 1، 5، 10 و 22 گامی (متناظر با پیش بینی یک روز، یک هفته، دو هفته و یک ماه بعد) الگوهای مورد بررسی بر اساس معیار اطلاع آکائیک، معیار شوارز، معیار میانگین توان دوم فاصله واریانس شرطی و توان دوم بازده های لگاریتمی و معیار خطای پیش بینی استاندارد شده؛ پرداخته شده که نتایج مبین این است که الگو IGARCH-N در رقابت با سایر الگوها، نتایج قابل قبولی را بدست آورده و به نظر می رسد که برای پی بینی کوتاه مدت بهتر است از این الگوها استفاده نمائیم اما هر چه افق پیش بینی ها بلند تر می شود نتیجه به نفع الگو GARCH-t و GARCH- و GED تغییر می کند.

کلمات کلیدی:

الگوهای واریانس ناهمسان شرطی خود رگرسیو، الگوسازی و پیش بینی نوسان، شاخص کل قیمت بورس اوراق بهادار تهران

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/176337>

