

عنوان مقاله:

مروری بر مدلها و روشهای نوین پیش بینی شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران

محل انتشار:

ششمین کنفرانس بین المللی تحولات نوین در مدیریت، اقتصاد و حسابداری (سال: 1402)

تعداد صفحات اصل مقاله: 18

نویسندگان:

ابوبالاب زندی - دانشجوی کارشناسی ارشد، دانشکده مهندسی صنایع، دانشگاه صنعتی خواجه نصیرالدین طوسی، تهران

حسین محسنی - استادیار گروه مهندسی مالی، دانشکده مهندسی صنایع، دانشگاه صنعتی خواجه نصیرالدین طوسی، تهران

خلاصه مقاله:

شاخص قیمت سهام نشان دهنده وضعیت کلی اقتصاد یک کشور است. افزایش این شاخص به معنی رونق و بهبود در اوضاع و احوال اقتصادی و کاهش آن بیانگر بحران و رکود است. از اینرو می توان نتیجه گیری کرد که پیش بینی این شاخص می تواند در تصمیم گیری های سرمایه گذاران، صاحبان صنایع و حتی تحلیلگران بازار سرمایه و اقتصاد مفید فایده واقع شود. اگرچه پژوهش های تجربی بسیاری در ارتباط با موضوع پیش بینی شاخص قیمت سهام صورت گرفته است. هدف این مطالعه، بررسی کاربرد مدلها و روشهای نو در زمینه پیش بینی شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران است. در این مقاله، ضمن معرفی مدلها و روشهای مختلف از جمله شبکه عصبی، شبکه حالت پژواک، هوش مصنوعی، یادگیری ماشین، زنجیره مارکف، مدلهای پیوندی، مدلهای واریانس ناهمسان شرطی خود رگرسیون، مدل انفییس، مدل ترکیبی الگوریتم های فراابتکاری، هوش مصنوعی و معادله پارامتریک موجک، مدل ترکیبی شبکه یادگیری عمیق و مدلهای خانواده GARCH، الگوریتم بهینه سازی کاوش باکتری، روش تحلیل طیفی تکین و الگوریتم ژنتیک، روشهای هوشمند یادگیری عمیق، روش هیبریدی نوین، روش معادلات دیفرانسیل تصادفی بازگشت به میانگین خطی و غیرخطی و ARFIMA، الگوریتم پرواز پرندگان به بیان کاربردشان در زمینه پیش بینی شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران خواهیم پرداخت. پژوهش حاضر از لحاظ هدف کاملا کاربردی بوده و از منظر مطالعات دانشگاهی، در دسته مطالعات مبتنی بر پیشینه می باشد که به مرور ادبیات موضوع پرداخته و آن را تبیین می کند. در این پژوهش نشان خواهیم داد که چگونه استفاده از این تکنیک ها و روشها سبب بهبود پیش بینی شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران گشته اند. همچنین، این مقاله می تواند برای سایر پژوهش های تخصصی آتی در این حوزه به عنوان یک راهنمای مرجع در نظر گرفته شود.

کلمات کلیدی:

پیش بینی، شاخص کل، بورس اوراق بهادار تهران، یادگیری ماشین، الگوریتم های فراابتکاری

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1861400>

