

عنوان مقاله:

پیش بینی قیمت سهام شرکت فرآورده های نفتی پارس با استفاده از شبکه عصبی و روش رگرسیونی مطالعه موردی: قیمت سهام شرکت فرآورده های نفتی پارس

محل انتشار:

فصلنامه مدل سازی اقتصادی، دوره 6، شماره 18 (سال: 1391)

تعداد صفحات اصل مقاله: 16

نویسندگان:

سید نظام الدین مکیان - استادیار دانشگاه یزد

فاطمه السادات موسوی - دانشجوی کارشناسی ارشد دانشگاه یزد

خلاصه مقاله:

یکی از راه های تامین سرمایه برای سرمایه گذاری، انتشار اوراق قرضه و سهام از طریق بازار بورس می باشد. افراد در این بازار انتظار دستیابی به سود را دارند. اولین و مهم ترین عاملی که در اتخاذ سرمایه گذاری در بورس فراروی سرمایه گذار قرار دارد عامل قیمت سهام است که به تبع آن مقوله ارزیابی و پیش بینی قیمت آینده نیز مطرح می شود. فعالان در این بازار درصدد دستیابی و به کارگیری روش هایی هستند تا با پیش بینی آتی قیمت سهام، سود سرمایه خود را افزایش دهند. مطالعه حاضر با هدف پیش بینی قیمت پایانی سهام- مطالعه موردی شرکت فرآورده های نفتی پارس- با به کارگیری داده های روزانه در دوره زمانی ۱۳/۸/۱۳۸۸ تا ۱۱/۱۱/۱۳۸۹ از طریق دو روش شبکه عصبی مصنوعی و رگرسیونی ARIMA صورت پذیرفته است. نتایج به دست آمده به وسیله مدل شبکه عصبی دارای خطای کمتر، قدرت توضیح دهنده بالاتر و در نتیجه پیش بینی بهتری را نسبت به روش رگرسیونی نشان می دهد.

کلمات کلیدی:

شبکه عصبی مصنوعی، پیش بینی قیمت سهام، مدل خودرگرسیون میانگین متحرک انباشته (ARIMA)

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1873012>

