

عنوان مقاله:

الگوسازی و پیش بینی شاخص بورس اوراق بهادار تهران و تعیین متغیرهای موثر بر آن

محل انتشار:

فصلنامه پژوهشها و سیاست های اقتصادی، دوره 17، شماره 50 (سال: 1388)

تعداد صفحات اصل مقاله: 21

نویسندگان:

محسن مهرآرا

علی معینی

مهدی احراری

امیر هامونی

خلاصه مقاله:

در این مقاله با الگوسازی و پیش بینی شاخص قیمت و بازده نقدی بورس اوراق بهادار تهران مبتنی بر ساختار تلفیقی الگوریتم ژنتیک با رویکرد شبکه عصبی GMDH، سعی در شناخت متغیرهای موثر بر شاخص بورس اوراق بهادار شده است. بازده متغیر کلان اقتصادی مرتبط با بازار سرمایه به همراه وقفه های یک و دو ماهه هر کدام از آنها و وقفه های متغیر وابسته، الگوی با ۳۵ متغیر ورودی را ایجاد کرد که نتایج به دست آمده نشان دهنده تاثیر قوی و معنادار شاخص قیمت زمین، هزینه مسکن، CPI، پایه پولی، کرایه مسکن اجاره ای و قیمت جهانی نفت خام بر شاخص قیمت و بازده نقدی بورس اوراق بهادار است. در مقابل، بازار ارز خارجی و طلا، ارتباط کمتری با بازار سهام داشته است.

کلمات کلیدی:

GMDH, Stock Price Index, Iran economy, شبکه عصبی GMDH، الگوریتم ژنتیک، شاخص قیمت و بازده نقدی بورس تهران

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/2022877>

