

عنوان مقاله:

پیشبینی قیمت سهام بانک های ایران در بورس اوراق بهادار با استفاده از شبکه‌ی عصبی مصنوعی مطالعه موردی بانک انصار

محل انتشار:

نخستین کنفرانس ملی توسعه مدیریت پولی و بانکی (سال: 1392)

تعداد صفحات اصل مقاله: 23

نویسندگان:

سیداحمد شیبت الحمدي - دانشگاه آزاد اسلامی، واحد فیروزکوه، گروه مدیریت، فیروزکوه، ایران

منصور حقی - دانشگاه آزاد اسلامی، واحد فیروزکوه، گروه مدیریت، فیروزکوه، ایران

خلاصه مقاله:

درسالهای اخیر با ورود تکنولوژیهای جدید و اینترنت، رقابت موجود بین بانک ها افزایش چشمگیری داشته است. بانکهای بزرگ و قدرتمند، اهداف پیش بینی شده خود را با جدیت پیگیری می کنند تا توان رقابتی خود را بالا ببرند. یکی از بازارهای مالی موجود بازار سهام است که سهام بانکها در آن معامله می شود. اولین و مهم ترین عاملی که در اتخاذ سرمایه گذاری در بورس فرا روی سرمایه گذار قرار دارد، عامل قیمت سهام است که به تبع آن مقوله ارزیابیو پیش بینی قیمت آینده نیز مطرح می شود. فعالان در این بازار درصدد دستیابی و بکارگیری روش های هستند تا با پیش بینی قیمت آتی سهام سود سرمایه خود را افزایش دهند. متغیرهای بسیار زیادی در قیمت سهام بانکها تأثیرگذارمی باشند که در این متغیرهای نرخ ارز، قیمت نفت، قیمت طلا به عنوان شاخص های اقتصادی و متغیرهای حجم معاملات سهام بانکها در این تحقیق مورد استفاده قرار گرفتند. دراین تحقیق با استفاده از شبکه عصبی پرسپترون چندلایه 1 مدلی ارائه شده است که قیمت سهام بانک ها را با به کارگیری داده های روزانه در دوره زمانی 1409 تا 1402 پیش بینی نماید. در ادامه پیش بینی با مدل رگرسیون خطی صورت پذیرفت که نتایج حاصل شده، نشان می دهد که از نقطه نظر معیارهای ارزیابی عملکرد، پیش بینی قیمت سهام توسط مدل شبکه عصبی نسبت به رگرسیون خطی دارای خطای کمتری است که نشان از برتری مدل شبکه عصبی در برابر مدل رگرسیون خطی در پیش بینی قیمت سهام دارد و همچنین قابلیت شبکه عصبی در پیش بینی قیمت سهام بانک ها را تایید می کند

کلمات کلیدی:

شبکه عصبی مصنوعی، پیش بینی، قیمت سهام، بازار بورس، بانک

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/244762>

