

عنوان مقاله:

مقایسه دقت پیش بینی دو مدل GARCH و State Space با استفاده از روش شبیه سازی مونت کارلو برای شاخص تپیکس و شاخص S&P500

محل انتشار:

کنفرانس بین المللی حسابداری، اقتصاد و مدیریت مالی (سال: 1393)

تعداد صفحات اصل مقاله: 16

نویسندگان:

عقیق فرهادی چشمه مرواری - دانش آموخته کارشناسی ارشد علوم اقتصادی، دانشگاه آزاد اسلامی واحد علوم و تحقیقات تهران، دانشکده مدیریت و اقتصاد

فرهاد غفاری - استادیار، عضو هیئت علمی تمام وقت گروه اقتصاد دانشگاه آزاد اسلامی واحد علوم و تحقیقات تهران، دانشکده مدیریت و اقتصاد (مسئول مکاتبات)

خلاصه مقاله:

در این مقاله دقت پیش بینی دو مدل GARCH و State Space برای تخمین و پیش بینی شاخص قیمت بورس اوراق بهادار تهران (تپیکس) و شاخص S&P500 مورد مقایسه قرار گرفتند. برای این منظور از داده های روزانه 1 بهمن سال 1389 تا 30 بهمن سال 1392 به عنوان درون داده و 1 اسفند 1392 تا 31 اردیبهشت 1393 به عنوان برون داده برای بررسی شاخص تپیکس و نیز از داده های روزانه 27 اسفند 1389 تا 7 اسفند 1392 به عنوان درون داده و 8 اسفند 1392 تا 31 اردیبهشت 1392 به عنوان برون داده برای بررسی شاخص S&P500، استفاده شده است. از معیار RMSE و روش شبیه سازی مونت کارلو برای مقایسه دقت پیش بینی مدلها و مقایسه نتایج پیش بینی حاصل از 2 شاخص مورد نظر، با استفاده از برون داده، در سه افق زمانی بلندمدت، میان مدت، کوتاه مدت و یک مقایسه کلی با درون داده، استفاده شده است. در نهایت نتایج به دست آمده حاکی از این موضوع بود که مدل GARCH در سه افق زمانی بلند مدت، میان مدت و کوتاه مدت، و با استفاده از مقایسه کلی با برون داده، از دقت پیش بینی بیشتری نسبت به مدل State Space برخوردار بوده است که به علت ماهیت بازار سهام ایران آمریکا برای 2 شاخص تپیکس و S&P500 می باشد.

کلمات کلیدی:

ARCH، State Space، مونت کارلو، دقت پیش بینی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/325533>

