

عنوان مقاله:

ارائه مدل پیش بینی شاخص کل قیمت سهام در بورس و اوراق بهادار تهران با استفاده از رویکرد الگوریتم ژنتیک

محل انتشار:

چهارمین کنفرانس ملی و دومین کنفرانس بین المللی حسابداری و مدیریت (سال: 1394)

تعداد صفحات اصل مقاله: 16

نویسندگان:

حسن ندری - دانش آموخته کارشناسی ارشد حسابداری، پردیس علوم و تحقیقات لرستان.

مسعود طاهری نیا - استاد دانشگاه آزاد اسلامی پردیس علوم و تحقیقات لرستان.

محمود همت فر - استاد دانشگاه آزاد اسلامی پردیس علوم و تحقیقات لرستان.

خلاصه مقاله:

شاخص قیمت سهام هر کشور، مهمترین ابزار شناسایی بورس و اوراق بهادار آن کشور است. بنابراین نوسانات این شاخص همیشه مورد توجه برنامه ریزان و سیاستگذاران اقتصادی بوده است. از این رو روش هایی که پیش بینی را با دقت مناسبی انجام دهد، می تواند اثر مثبت زیادی در رونق این بازار های مالی و کاهش ریسک آنها داشته باشد. هدف اصلی تحقیق حاضر، ارائه مدلی جهت پیش بینی شاخص کل قیمت سهام در بورس اوراق بهادار تهران با استفاده از الگوریتم ژنتیک می باشد. به جهت کمک به استفاده کنندگان از اطلاعات مالی و سرمایه گذاران در شرکت های پذیرفته شده در بورس و اوراق بهادار تهران تلاش داریم تا با استفاده از این روش چگونگی پیش بینی شاخص سهام را بررسی نماییم. در این پژوهش اثر متغیرهای کلان اقتصادی (شامل نرخ ارز، نرخ تورم، نسبت P/E حجم مبادلات و قیمت نفت) بر شاخص کل قیمت سهام بورس و اوراق بهادار تهران، مدل سازی و پیش بینی می گردد.

کلمات کلیدی:

شاخص قیمت سهام، کارایی بازار، الگوریتم ژنتیک، قیمت نفت، نرخ تورم

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/427944>

