

عنوان مقاله:

پیش بینی قیمت سهام با استفاده از الگوریتم ژنتیک شواهدی از بورس اوراق بهادار تهران

محل انتشار:

کنفرانس بین المللی پژوهشهای نوین در مدیریت، اقتصاد و حسابداری (سال: 1394)

تعداد صفحات اصل مقاله: 13

نویسندگان:

امیرحسین بیگ زاده عباسی - دانشجوی کارشناسی ارشد مدیریت دولتی گرایش مالی، گروه مدیریت، واحد کرمان، دانشگاه آزاد اسلامی کرمان، ایران

فرزانه بیگ زاده عباسی - استادیار، گروه مدیریت، واحد کرمان، دانشگاه آزاد اسلامی، کرمان، ایران

مسعود پورکیانی - استادیار، گروه مدیریت، واحد کرمان، دانشگاه آزاد اسلامی، کرمان، ایران

خلاصه مقاله:

سرمایه گذاری در سهام عرضه شده در بورس اوراق بهادار یکی از گزینه های پرسود در بازار سرمایه است. بازار سهام دارای سیستمی غیرخطی و آشوب گونه است که تحت تاثیر شرایط سیاسی، اقتصادی و رونشناسی می باشد و می توان از سیستم های غیرخطی همچون الگوریتم های ژنتیک برای پیش بینی قیمت سهام استفاده کرد. در این مقاله به طراحی و ارائه مدل پیش بینی قیمت سهام با استفاده از الگوریتم ژنتیک و کاهش خطای پیش بینی قیمت سهام با استفاده از تابع نمایی پرداخته شده است. نمونه مورد بررسی در این تحقیق شرکت سایپا می باشد. مقایسه میانگین مجذورخطا در دو مدل تابعخطی و تابع نمایی نشان دهنده این عامل است که مدل تابع نمایی از خطای کمتری برخوردار است. باتوجه به دقت قابل ملاحظه و مشهود مدل تابع نمایی در پیش بینی قیمت سهم سایپا ، این مدل به عنوان مدل دقیق تر شبیه سازی، برای پیشبینی قیمت این سهم می تواند مورد استفاده قرار گیرد

کلمات کلیدی:

پیش بینی قیمت سهام، الگوریتم ژنتیک، بورس اوراق بهادار تهران

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/436939>

