

عنوان مقاله:

ارائه یک مدل تصمیم گیری برای خرید و فروش سهام مبتنی بر دو فاکتور قیمت پایانی و حجم معاملات

محل انتشار:

اولین کنفرانس بین المللی ابزار و تکنیکهای مدیریت (سال: 1393)

تعداد صفحات اصل مقاله: 14

نویسندگان:

سجاد خالصی - دانشجوی مهندسی صنایع، دانشگاه صنعتی خواجه نصیرالدین طوسی، تهران، ایران

میلاد جاسمی زرگانی - استادیار مهندسی صنایع، دانشگاه صنعتی خواجه نصیرالدین طوسی، تهران، ایران

خلاصه مقاله:

در این پژوهش مسئله اصلی مورد تحقیق، وجود یا عدم وجود رابطه مشخصی بین تغییرات حجم و قیمت پایانی یک سهم به عنوان متغیرهای پیش بینی کننده و تغییرات قیمت پایانی آتی به عنوان پیش بینی شونده می باشد. تا به امروز پژوهش های متعددی در این حوزه و بر روی متغیرهای مختلف انجام شده که در برخی مواقع به تایید و گاهی به رد نتایج یکدیگر نیز پرداخته اند. اما ما در این پژوهش به این مسئله خواهیم پرداخت که آیا با دانستن تغییرات حجم و قیمت پایانی در هر روز این قابلیت را خواهیم داشت که تغییرات قیمت آتی را پیش بینی کنیم یا خیر. البته لازم به ذکر است که لازمه این نتیجه گیری در ابتدا اثبات وجود ارتباط معنادار بین متغیرهای پیش بینی کننده با متغیر پیش بینی شونده می باشد. به این منظور داده های روزانه 02 شرکت از صنایع مختلف در بورس اوراق بهادار تهران به کمک مدل رگرسیون لجستیک باینری و نیز آزمون فرض، مورد بررسی قرار گرفته که در نهایت منجر به تایید معناداری ارتباط بین تغییرات قیمت پایانی هر روز با تغییرات قیمت پایانی روز بعد و هم چنین رد فرضیه وجود ارتباط معنادار بین تغییرات حجم در هر روز و تغییرات قیمت سهام در روز بعد گردید که در نتیجه منجر به حذف آن از بین متغیرهای پیش بینی کننده شد

کلمات کلیدی:

تغییرات حجم، تغییرات قیمت پایانی، رگرسیون لجستیک باینری، پیش بینی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/477129>

