

عنوان مقاله:

پیش بینی قیمت سهام با استفاده از مدل‌های ترکیبی صنعت مواد دارویی

محل انتشار:

اولین کنفرانس بین المللی دستاوردهای نوین پژوهشی در مدیریت، حسابداری و اقتصاد (سال: 1395)

تعداد صفحات اصل مقاله: 15

نویسندگان:

هیمه ایروانی قلعه سرخ - کارشناس ارشد حسابداری دانشگاه آزاد اسلامی واحد نیشابور

مهدی صالحی - استادیار دانشگاه فردوسی مشهد

خلاصه مقاله:

پیش بینی قیمت سهام، یکی از چالش برانگیزترین مباحث در زمینه پیش بینی می باشد. قیمت سهام دارای ویژگی‌هایی از جمله نوسانات بالا، پیچیدگی، پویایی بوده، در نتیجه رابطه ضمنی بین قیمت سهام و پیش بینی کاملاً پویا است. پژوهش حاضر تلاش می کند مدل‌هایی برای پیش بینی قیمت سهام پیشنهاد کند و به مقایسه دقت این مدل‌ها در پیش بینی قیمت سهام بپردازد. چارچوب مدل‌های بکاررفته در این پژوهش، ترکیبی از الگوریتم ژنتیک و نقشه خودسازماندهی، ترکیب رگرسیون بردار پشتیبان و نقشه ویژگی خودسازماندهی، ترکیب الگوریتم جغرافیای زیستی و شبکه عصبی پرسپترون چندلایه و ترکیب نقشه خودسازماندهی و شبکه عصبی پس انتشار خطا است. متغیرهای مستقل این تحقیق، 17 شاخص تکنیکی از جمله میانگین متحرک، شاخص بیاس، شاخص مومنتوم و ... می باشد. همچنین از اطلاعات شرکت‌های صنعت مواد دارویی پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار تهران در بازه زمانی 6 ساله یعنی از سال 1386 الی 1391 به صورت روزانه استفاده شده است. نتایج اجرای مدل‌های پیش بینی، براساس دو معیار خطا (مجدور میانگین مربعات خطا و میانگین مربعات خطا) و معیار دقت مدل (ضریب تعیین) مورد بررسی قرار گرفته است. نتایج نشان دهنده دقت بالای 99 درصد هر چهار مدل ترکیبی در پیش بینی قیمت سهام می باشد. برای مقایسه خطاهای پیش بینی مدل‌ها با یکدیگر آزمون مک نمار بکار رفته است. نتایج این آزمون نشان دهنده این امر است که تفاوت معناداری بین مدل‌های بکار رفته وجود ندارد لیکن با مقایسه خطاهای پیش بینی آنها میتوان نتیجه گرفت که مدل ترکیبی رگرسیون بردار پشتیبان و نقشه خودسازماندهی از خطای کمتری نسبت به سایر مدل‌ها برخوردار بوده و مدل ترکیبی الگوریتم ژنتیک و نقشه خودسازماندهی با خطای بیشتری به پیش بینی قیمت سهام پرداخته است

کلمات کلیدی:

پیش بینی قیمت سهام، شاخصهای تکنیکی، مدل‌های ترکیبی، شبکه های عصبی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/535642>

