

عنوان مقاله:

پیش بینی بازده بازار سهام با استفاده از مدل آریم

محل انتشار:

ششمین کنفرانس ملی مدیریت، اقتصاد و حسابداری (سال: 1395)

تعداد صفحات اصل مقاله: 9

نویسندگان:

بهراد معین نژاد - باشگاه پژوهشگران جوان و نخبگان، واحد قوچان، دانشگاه آزاد اسلامی، قوچان، ایران

شعبان محمدی - موسسه آموزش عالی حکیم نظامی، ایران

حامد اسماعیلی اوغاز - کارشناس ارشد مهندسی کامپیوتر گرایش نرم افزار دانشگاه غیرانتفاعی امام رضا (ع)

خلاصه مقاله:

تاثیرپذیری از عوامل مختلف چه به صورت مستقیم چه غیر مستقیم از تحولات اقتصادی و اجتماعی که تعداد آنان در دهه اخیر کم نبوده باعث تحولات و چرخه ها یی در روند قیمت سهام در بورس اوراق بهادار شده است. سرمایه گذاری در سهام بازار با بازده زیاد جزء سرمایه گذاری های پر خطر در نظر گرفته می شود. به این ترتیب پیش بینی بازدهی سهام در بازار ثانویه برای سرمایه گذاران از اهمیت بسیار زیاد برخوردار است. بازدهی بازار سهام مانند الگوهای امواج (نوسانات) است. امواج را می توان یا در حوزه زمان و یا حوزه فرکانس مشاهده کرد. حوزه زمان ثبت یک واقعه از آنچه برای یک پارامتر از یک سیستم در مقابل زمان و یا فضا رخ می دهد. روش باکس- جنکینز و میانگینمتحرک خودگردان یکپارچه (ARIMA) (روش گسترده ای در توضیح الگوهای موجی شکل هنگامی که موج از نوع ثابت است مورد استفاده قرار می گیرد. این مطالعه بر روی مدل های ARIMA در آزمایش پیش بازدهی بازار سهام متمرکز شده است. سری های ایستا (ثابت) توسط توابع همبستگی خودگردان و توابع همبستگی جزئی خودگردان (مشتقات جزئی) مورد آزمایش قرار گرفتند. مدل های ARIMA در بازدهی کل بازار تجارت، بازدهی بخش و بازدهی شرکت خصوصی از بورس مورد آزمایش قرار گرفت. خطا میانگین مربعات، میانگین قدر مطلق انحرافات، باقی مانده ها و آزمون اندرسون دارلینگ، در ارزیابی مدل استفاده شد.

کلمات کلیدی:

ARIMA، همبستگی خودگردان، تجزیه و تحلیل بنیادی، ایستا، تجزیه و تحلیل فنی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/600034>

