

## عنوان مقاله:

پیش بینی بازده بازار سهام با استفاده از مدل آریم

## محل انتشار:

هفتمین کنفرانس بین المللی حسابداری و مدیریت و چهارمین کنفرانس کارآفرینی و نوآوری های باز (سال: 1395)

تعداد صفحات اصل مقاله: 13

## نویسنده:

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

## 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 درحوزه 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 میانگین متحرک 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:

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

## لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/639423>

