

عنوان مقاله:

کاربرد مدل الگوریتم ژنتیک در پیش بینی قیمت سهام در بازار سرمایه ایران

محل انتشار:

سومین کنفرانس بین المللی مدیریت و مهندسی صنایع (سال: 1396)

تعداد صفحات اصل مقاله: 15

نویسندگان:

فاطمه جوانمرد - گروه حسابداری، دانشکده اقتصاد و حسابداری، واحد تهران جنوب، دانشگاه آزاد اسلامی، تهران، ایران

سیده محبوبه جعفری - استادیار گروه حسابداری، واحد تهران جنوب، دانشگاه آزاد اسلامی، تهران، ایران

خلاصه مقاله:

پیش بینی آینده همواره به صورت یک ضرورت در زندگی روزمره و به عنوان یک حوزه مشترک در بسیاری از علوم مطرح بوده است. پژوهش های انجام شده نشان می دهد که رفتار بازار یک رفتار غیرخطی و آشوب گونه است، لذا نیاز به استفاده از ابزارها و الگوهای غیرخطی جهت پیش بینی، مشاهده می گردد. هدف از این پژوهش تعیین الگویی با استفاده از متغیرهای مالی جهت بالا بردن توان تصمیم گیری استفاده کنندگان صورت های مالی در پیش بینی قیمت سهام شرکت ها می باشد. بدین منظور به بررسی توانمندی مدل الگوریتم ژنتیک در این زمینه پرداخته شد. نمونه های مورد استفاده در این پژوهش شامل شرکت های پذیرفته شده در بازار سرمایه ایران در بین سال های 1390 تا 1394 می باشد. این شرکت ها به دو گروه آموزشی شامل 672 شرکت-سال ابتدایی (شرکت-سال های 90 تا 93) و گروه آزمایشی متشکل از 168 شرکت-سال انتهایی (شرکت-سال 94)، تفکیک گردیدند. برای پیش بینی قیمت سهام شرکت ها از نسبت های مالی پیش بینی کننده قیمت سهام که تحقیقات پیشین بکاررفته استفاده گردید. نتایج این مطالعه نشان داد که الگوریتم ژنتیک با درصد پیش بینی 92.86 دارای قدرت پیش بینی قیمت سهام می باشد.

کلمات کلیدی:

الگوریتم ژنتیک، نسبت های مالی و قیمت سهام

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/756796>

