

عنوان مقاله:

تاثیر مذاکرات هسته ای بر شک لگیری و فروپاشی حباب قیمتی در بورس اوراق بهادار تهران و بررسی توان پیش بینی ها

محل انتشار:

دهمین کنفرانس بین المللی انجمن تحقیق در عملیات ایران (سال: 1396)

تعداد صفحات اصل مقاله: 8

نویسندگان:

داود شیشه بری - دانشکده مهندسی صنایع، دانشگاه یزد

محمد حسن رحمانیان - دانشجو دانشکده مهندسی صنایع دانشگاه یزد

زهرا السادات دشتی - دانشجو دانشکده مهندسی صنایع دانشگاه یزد

خلاصه مقاله:

مسئله ی ایجاد حباب قیمتی و گرفتار شدن در دام آن از مهم ترین مسایل پیش روی سرمایه گذاران در بازار بورس داخل و خارج می باشد، و جو روانی حاصل از تنش های سیاسی ایجاد شده در عرصه ی داخل و بین الملل از مهم ترین عوامل اثرگذار بر ایجاد هیجان در بازار و شکل گیری حباب های قیمتی می باشد. از مهم ترین رخدادهای سیاسی در چند سال اخیر که کل اقتصاد کشور، از جمله بازار بورس، را تحت تاثیر خود قرار داد مسئله ی مذاکرات هسته ای و تحریم های وابسته به آن است. در این پژوهش، دوره های ی پیش از شروع مذاکرات، شروع مذاکرات رسمی با انعقاد قرارداد ژنو، زمان های میانی انجام مذاکرات، اتمام مذاکرات و تصویب برجام مورد بررسی قرار گرفته و با بررسی وضعیت شرکت ها از لحاظ حبابدار و یا بیحباب بودن آنها با دو روش آزمون تسلسل و آزمون چولگی نحوه ی اثرگذاری این وقایع سیاسی بر بازار سهام را مورد بررسی قرار داده و در ادامه روش های مختلف برای پیش بینی حباب قیمتی بر اساس متغیرهای اثرگذار بر آن را در چهار دوره ی عنوان شده پیاده سازی و توان پیش بینی آنها در هر دوره مورد بررسی قرار گرفته و در پایان به ثبت و تشریح نتایج پرداخته شده است.

کلمات کلیدی:

حباب قیمتی، مذاکرات هسته ای، رگرسیون لجستیک، شبکه عصبی، ماشین بردار پشتیبان، آزمون تسلسل

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/767174>

