

## عنوان مقاله:

ارایه مدل پیش بینی شاخص کل قیمت سهام با رویکرد شبکه های عصبی (مطالعه موردی: بورس اوراق بهادار تهران)

## محل انتشار:

دوفصلنامه جستارهای اقتصادی، دوره 6، شماره 11 (سال: 1388)

تعداد صفحات اصل مقاله: 26

## نویسندگان:

علیرضا پاکدین امیری - کارشناس ارشد مدیریت مالی و عضو باشگاه پژوهشگران جوان دانشگاه آزاد اسلامی

مجتبی پاکدین امیری - مدیریت بازرگانی دانشکده علوم اقتصاد و اداری دانشگاه مازندران

مرتضی پاکدین امیری - کارشناس ارشد حسابداری، دانشگاه آزاد اسلامی

## خلاصه مقاله:

هدف تحقیق حاضر ارایه مدل پیش بینی شاخص قیمت سهام در بورس اوراق بهادار با استفاده از شبکه های عصبی مصنوعی است. بر این اساس، شاخص صنعت، شاخص مالی و شاخص بازده نقدی به صورت سالانه به عنوان متغیرهای ورودی (مستقل) طرح شد. برای ارزیابی مدل شبکه عصبی از طرح MLP با الگوریتم آموزش پس انتشار و مدل چند عاملی بهره گرفته شده است. نتایج نشان می دهد که مدل شبکه عصبی پیشنهادی، توانایی بالایی در پیش بینی شاخص قیمت سهام در بورس اوراق بهادار تهران را دارا می باشد. در پایان مقاله، بحث، نتیجه گیری، پیشنهادات کاربردی و نیز مواردی در خصوص ادامه و پیگیری تحقیقات مشابه در آینده بیان شده است.

## کلمات کلیدی:

پیش بینی، شاخص بورس اوراق بهادار، شبکه های عصبی، مدل چند عاملی

## لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/794253>

