

عنوان مقاله:

پیش‌بینی نوسان پذیری بازده در بازار سهام با استفاده از یک مدل ترکیبی

محل انتشار:

پانزدهمین کنفرانس بین‌المللی مهندسی صنایع (سال: 1397)

تعداد صفحات اصل مقاله: 10

نویسندگان:

کیمیا زندگیگلی

محمد امینی - فارغ التحصیل کارشناسی ارشد مهندسی صنایع، دانشگاه صنعتی شریف، دانشکده مهندسی صنایع، سیستم‌های اقتصادی اجتماعی، تهران

خلاصه مقاله:

هدف پژوهش انجام شده پیش‌بینی نوسان پذیری بازده سهام است. بدین منظور ویژگی‌های مربوط به نرمال ایستایی مدل‌های گارچ بررسی شده است. پس از برقراری ویژگی‌ها، مدل‌های گارچ مورد برازش قرار گرفته است. در بین مدل‌های گارچ مدل EGARCH-T(1,1) از نظر معیارهای تعریف شده بهینه‌ترین مدل از بین مدل‌های خانواده گارچ است. همچنین شبکه عصبی بهینه‌ای طراحی شده داده‌های مورد مطالعه برازش داده شده است که مقدار خطا برابر با 0/0745 بود. در انتها قبل از ورود داده‌های خروجی شبکه عصبی به عنوان ورودی مدل‌های گارچ، ویژگی‌های نرمال، ایستایی وجود اثرات آرچ مورد بررسی قرار گرفته است شبکه عصبی بهینه با مدل‌های خانواده گارچ ترکیب شده است. خطای مدل ترکیبی حاصل مدل ANN-EGARCH-T(3,1) برابر 0/0438 بوده است. در مطالعه انجام شده بر اساس نتایج اثبات شده است که مدل ترکیبی شبکه عصبی EGARCH با توجه به معیارهای تعیین شده، مدلی مناسب برای پیش‌بینی نوسان پذیری بازده پرتفو مشخص شده، است.

کلمات کلیدی:

پیش‌بینی نوسانات بازار سهام، مدل‌های ترکیبی، شبکه عصبی مصنوعی، مدل‌های خانواده گارچ

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/839815>

