

عنوان مقاله:

پیش بینی قیمت گذاری عرضه عمومی اولیه با استفاده از الگوریتم بهینه سازی انبوه ذرات (PSO) و ماشین بردار پشتیبان (SVM)

محل انتشار:

دومین کنفرانس ملی توسعه پایدار در علوم مدیریت و حسابداری ایران (سال: 1397)

تعداد صفحات اصل مقاله: 15

نویسندگان:

نواب کیامهر - دانشجوی دکتری حسابداری و مدرس دانشگاه

مهدی خرم آبادی - عضو هیات علمی دانشگاه پیام نور-گروه حسابداری

خلاصه مقاله:

در پژوهش حاضر به مقایسه قدرت شبکه های عصبی ، ماشین بردار پشتیبان و مدل برخاسته از ترکیب الگوریتم بهینه سازی انبوه ذرات (PSO) و ماشین بردار پشتیبان (SVM) به منظور پیش بینی قیمت گذاری عرضه های عمومی اولیه پرداخته می شود. هدف این تحقیق طراحی مدلی است که به سرمایه گذاران در تشخیص صحت قیمت گذاری عرضه های عمومی اولیه و شکار فرصتهای سودآوری یاری رساند. بنابراین متغیرهای استفاده شده در این پژوهش از میان آن دسته از متغیرهای انتخاب شده اند که قبل از عرضه در اختیار سرمایه گذارانی که دسترسی محدودی به اطلاعات دارند، قرار داشته باشند. از سوی دیگر، نتایج این تحقیق می تواند برای شرکت ناشر، مشاور پذیرش، پذیره نویسان و نیز قانون گذاران بورس اوراق بهادار سودمند باشد. قیمت گذاران، که قیمت روز نهم عرضه را در نظر گرفته ایم زیرا نوسانات قیمت از بین رفته و قیمت واقعی تر به نظر می رسد. نتایج تحقیق نشان می دهد ترکیب الگوریتم بهینه سازی انبوه ذرات (PSO) و ماشین بردار پشتیبان (SVM) قدرت پیش بینی را به طور محسوسی افزایش می دهد. در نتیجه، مدل های ماشین بردار پشتیبان می توانند با افزایش صحت قیمت گذاری عرضه های عمومی اولیه منافع اقتصادی با اهمیتی به صورت کاهش هزینه های قیمت گذاری کمتر از واقع فراهم کنند.

کلمات کلیدی:

عرضه های عمومی اولیه ، قیمت گذاری ، شبکه های عصبی ، ماشین بردار پشتیبان ، الگوریتم بهینه سازی انبوه ذرات

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/929171>

