

عنوان مقاله:

پیش بینی بازده سهام با استفاده از روش های داده کاوی (مطالعه موردی بورس اوراق بهادار تهران)

محل انتشار:

چهارمین کنفرانس بین المللی مدیریت صنعتی (سال: 1398)

تعداد صفحات اصل مقاله: 11

نویسندگان:

عالیه کاظمی - دانشیار گروه مدیریت صنعتی دانشکده مدیریت دانشگاه تهران، تهران، ایران

سارا آریائی - دانشجو دکتری مدیریت صنعتی، دانشکده مدیریت، دانشگاه تهران، تهران، ایران

مینا کاظمی - دانشجو دکتری مدیریت صنعتی، دانشکده مدیریت، دانشگاه تهران، تهران، ایران

حسین طالبی - دانشجو دکتری مدیریت صنعتی، دانشکده مدیریت، دانشگاه تهران، تهران، ایران

خلاصه مقاله:

پیش بینی و بررسی رفتار قیمت اوراق بهادار مقوله ای است که دانشمندان علوم مالی و سرمایه گذاران همواره در پی بهینه سازی آن می باشند. این امر به خاطر ماهیت پویا، غیرخطی، غیر پارامتریک و سیستم های آشفته بازار سهام است. در این پژوهش با استفاده از داده های بازار بورس تهران و با استفاده از نرم افزار رپیدماینر به پیش بینی بازده سهام با استفاده از تکنیک های داده کاوی پرداخته شده است. به این منظور از صورت های مالی شرکت های بورس ایران از سال 88 تا سال 94 استفاده شده است. این داده ها از طریق نرم افزار ره آورد نوین جمع آوری شدند و مربوط به نسبت های مالی 185 شرکت هستند. به منظور پیش بینی بازار سهام 16 صورت مالی و بازده سهام به عنوان برجسب که بر اساس 4 بازه تقسیم بندی شد در نظر گرفته شدند. در ادامه برای پیش بینی بازده سهام از انواع روش طبقه بندی شامل روش درخت تصمیم، شبکه عصبی، روش ترکیبی (جنگل تصادفی و بیز ساده و درخت تصمیم) استفاده شده است. با توجه به نتایج و مقدار عملکرد هر روش، روش ترکیبی درخت تصمیم با داشتن مقدار عملکرد 87/06 بهترین روش پیش بینی می باشد.

کلمات کلیدی:

پیش بینی بازده سهام، بورس اوراق بهادار، داده کاوی، طبقه بندی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/938009>

