

عنوان مقاله:

پیش بینی بازده سهام شرکت های پذیرفته شده در بورس و اوراق بهادار تهران با استفاده از تکنیک های داده کاوی (درخت تصمیم QUEST، رگرسیون منطقی)

محل انتشار:

فصلنامه تحقیقات جدید در علوم انسانی، دوره 5، شماره 15 (سال: 1398)

تعداد صفحات اصل مقاله: 16

نویسندگان:

راضیه رجبی - کارشناسی ارشد، مدیریت مالی، دانشکده مدیریت و حسابداری، واحد یادگار امام خمینی (ره) شهرری، دانشگاه آزاد اسلامی، تهران، ایران

محمد رضا عسگری - دانشیار و عضو هیات علمی، مدیریت مالی، دانشکده مدیریت و حسابداری، واحد یادگار امام خمینی (ره) شهرری، دانشگاه آزاد اسلامی، تهران، ایران

عبدالمجید دهقان - استادیار و عضو هیات علمی، مدیریت مالی، دانشکده مدیریت و حسابداری، واحد یادگار امام خمینی (ره) شهرری، دانشگاه آزاد اسلامی، تهران، ایران

خلاصه مقاله:

در این پژوهش به پیش بینی بازده سهام شرکت های پذیرفته شده در بورس و اوراق بهادار تهران با استفاده از تکنیک های داده کاوی اعم از درخت تصمیم QUEST و رگرسیون منطقی، طی سال های 1391 الی 1396 می پردازیم. مسیله اصلی در پژوهش حاضر این است که از بین تکنیک های داده کاوی مطرح کدامیک در پیش بینی بازده سهام شرکت های پذیرفته شده در بورس و اوراق بهادار تهران کاراتر می باشد. لذا این پژوهش در قالب دو فرضیه مطرح شده و برای آزمون این مسیله 67 شرکت پذیرفته شده در بورس - بازار اول - تابلوی اصلی و تابلوی فرعی به عنوان جامعه هدف انتخاب شده اند. همچنین از بین عوامل متعددی که بر بازده سهام اثر می گذارند، چهار عامل به عنوان عوامل موثر بر بازده سهام از قبیل سود (زیان) عملیاتی، سود هر سهم، نسبت جاری و نسبت آنی به عنوان ورودی های پژوهش انتخاب شده اند. برآزش هر یک از مدل های مذکور بر مبنای فرم خطی تابع کاب - داگلاس می باشد. یافته های بدست آمده حاکی از عملکرد مناسب الگوریتم درخت تصمیم QUEST و رگرسیون منطقی در پیش بینی بازده سهام، تنها با استفاده از اثرگذارترین متغیر مستقل بر متغیر وابسته می باشد.

کلمات کلیدی:

بازده سهام، پیش بینی، داده کاوی، درخت تصمیم، رگرسیون منطقی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/948243>

