

عنوان مقاله:

پیش بینی قیمت سهام بر اساس شبکه عصبی LM-BP و برآورد نقطه بیش از حد توسط شمارش فواصل زمانی: شواهدی از بورس اوراق بهادار

محل انتشار:

مهندسی مالی و مدیریت اوراق بهادار، دوره 10، شماره 39 (سال: 1398)

تعداد صفحات اصل مقاله: 26

نویسندگان:

محمد رضا وطن پرست - استادیار گروه حسابداری، واحد رشت، دانشگاه آزاد اسلامی، رشت، ایران.

مسعود اسدی - دانشجوی دکتری مهندسی مالی، واحد رشت، دانشگاه آزاد اسلامی، رشت، ایران.

شعبان محمدی - کارشناسی ارشد حسابداری، دانشکده شهید رجایی، دانشگاه فنی و حرفه ای استان خراسان، ایران

عباس بابایی - دانشجوی دکتری مهندسی مالی، واحد رشت، دانشگاه آزاد اسلامی، رشت، ایران

خلاصه مقاله:

در این پژوهش برای تعیین روش پیش بینی قیمت سهام، یک شبکه عصبی LM-BP بر اساس سری های زمانی با توجه به قیمت باز، بالاترین قیمت، پایین ترین قیمت، قیمت بسته و حجم معاملات ارائه شد. در پژوهش حاضر، 315 روز قیمت سهام را برای ایجاد 10 نمونه انتخاب و مجموعه آزمون شامل قیمت سهام از روز 316 تا روز 320 را انتخاب و از شبکه عصبی LM-BP استفاده شده است. در این پژوهش، تعیین نقطه بحرانی بیش از حد، عدم تقارن و شمارش فواصل زمانی بررسی شد. منحنی MRE2-MRE1 رسم شده و دقت مربوط به بهترین پیش بینی شبکه عصبی BP بر اساس چند تکرار مستقل برآورد شد. پس آزمون نیز به روش آزمون کوپیک و آزمون کریستوفرسون انجام شد. نتایج نشان داد که پیش بینی قیمت سهام بر اساس شبکه عصبی LM-BP و برآورد نقطه بیش از حد توسط شمارش فواصل زمانی، نتایج بهتری نسبت به روش های موجود ارائه می دهد.

کلمات کلیدی:

پیش بینی قیمت سهام، شبکه عصبی LM-BP، شمارش فواصل زمانی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/958503>

