

عنوان مقاله:

تحلیل نوسان قیمت سهام شرکت های پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار تهران با استفاده از روش یادگیری ماشین

محل انتشار:

دوفصلنامه سیاست گذاری پیشرفت اقتصادی، دوره 6، شماره 1 (سال: 1397)

تعداد صفحات اصل مقاله: 23

نویسندگان:

شادی شاهوردیانی - استادیار دانشگاه آزاد اسلامی واحد تهران شهر قدس

سامیران خواجه زاده - دانشجوی دکتری دانشگاه آزاد اسلامی واحد تهران شهر قدس

خلاصه مقاله:

نوسانات قیمت سهام که منجر به نوسانات بازده شرکت ها می گردد، یکی از مسائل مورد توجه بازار سرمایه و سرمایه گذاران می باشد. هدف این پژوهش، پیش بینی نوسان قیمت سهام در بازار سرمایه ایران با استفاده از روش یادگیری ماشین بردار ارتباطی می باشد. در این پژوهش در یک رویکرد دو مرحله، ابتدا از بین اطلاعات مالی 1750 سال- شرکت و 31 متغیر اولیه متغیرهای تاثیرگذار بر نوسان قیمت سهام شناسایی شده است و با توجه به متغیرهای انتخاب شده، اقدام به پیش بینی نوسان قیمت سهام شد. نتایج پژوهش نشان می دهد که الگوریتم غیرخطی ارتباطی در پیش بینی نوسان قیمت سهام با استفاده از متغیرهای حسابداری نسبت به الگوریتم ارتباطی خطی، توانایی بالاتری دارد. لذا به صاحبان سرمایه و تصمیم گیران شرکت توصیه می شود در تصمیم گیری های خود پیرامون سرمایه گذاری در بازار سرمایه از قدرت پیش بینی الگوریتم های هوش مصنوعی بویژه حالت غیر خطی الگوریتم ارتباطی استفاده کنند.

کلمات کلیدی:

نوسان قیمت سهام، الگوریتم ارتباطی، بورس اوراق بهادار تهران

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/969933>

