

پیش بینی و مقایسه شاخص قیمت سهام در بازار اوراق بهادار تهران با استفاده از روش های فیبوناچی و فازی

دکتر اسمعیل ابونوری

استاد اقتصادسنجی و آمار اجتماعی

بخش اقتصاد دانشگاه سمنان، سمنان-ایران.

Email: esmaiel.abounoori@gmail.com

علی اصغر ضیاچی

دانشجوی کارشناسی ارشد مدیریت بازرگانی-گرایش مالی

بخش مدیریت دانشگاه سمنان، سمنان-ایران.

Email: aliziachi@yahoo.com

نیره فخاریان

دانشجوی کارشناسی ارشد ریاضی

بخش ریاضیات دانشگاه سمنان، سمنان-ایران.

Email: n_fakharian@staff.semnan.ac.ir

چکیده:

بورس اوراق بهادار در اکثر کشورها، هسته مرکزی بازار سرمایه است و سالانه مبلغ هنگفتی سرمایه های سرگردان را به سمت واحدهای مولد و فعال جامعه، نظیر واحدهای تولیدی و خدماتی هدایت می کند. این امر موجب اشتغال، تولید و رشد اقتصادی پایدار خواهد شد. در این راستا، پیش بینی اندازه و روند شاخص های قیمت سهام مورد توجه سرمایه گذاران است. برای پیش بینی شاخص قیمت تکنیکهای مختلفی وجود دارد. در این تحقیق برای پیش بینی شاخص قیمت سهام در بازار اوراق بهادار تهران، از دو روش فیبوناچی و فازی استفاده شده است. برای این منظور از داده های سری زمانی روزانه در دوره 85 تا 90 استفاده گشت: دقت برآورد مدلها با شاخص آماری میانگین مربع خطا مقایسه شد. نتایج مبین دقت پیش بینی بیشتر با روش فیبوناچی میباشد.

واژه های کلیدی: شاخص قیمت سهام، فیبوناچی، فازی، بازار اوراق بهادار، تهران