

پیش بینی قیمت سهام در بورس اوراق بهادار تهران با استفاده از روش های فراابتکاری IWO و ABC

الناز پیمان^{۱*}، علی غلامی^۲، سمانه کیانرسی^۳، اسماعیل صفی خانی^۴

۱- کارشناس ارشد مدیریت صنعتی دانشگاه علم و هنر یزد، elnazpeyman23@yahoo.com

۲- کارشناس ارشد مدیریت صنعتی، دانشگاه آزاد اسلامی واحد آبادان، gholami.ali5859@yahoo.com

۳- دانشجوی کارشناسی ارشد مدیریت بازرگانی دانشگاه خلیج فارس خرمشهر، s.kianer30@yahoo.com

۴- دانشجوی کارشناسی ارشد مهندسی صنایع دانشگاه خلیج فارس خرمشهر، safikhani@aacc.ir

چکیده

رشد بلند مدت و مداوم اقتصادی نیازمند تجهیز و تخصیص بهینه ی منابع در سطح اقتصاد ملی است و این مهم بدون کمک بازارهای مالی، به ویژه بازار سرمایه گسترده و کارآمد به سهولت امکان پذیر نیست. در صورتی که بتوان روند آتی بازار سهام را به روش های مناسب و دقیق پیش بینی نمود، سرمایه گذار می تواند بازده حاصل از سرمایه گذاری خود را بیشینه سازد و ریسک را کاهش دهد، که در این صورت شاید بتوان به اقتصاد باثبات تری دست یافت. با توجه به نتایج این تحقیق بر اساس هدف کاربردی و از لحاظ جمع آوری داده ها از نوع توصیفی می باشد. در این مقاله از دو تکنیک قدرتمند الگوریتم علف های هرز و الگوریتم زنبورهای مصنوعی جهت پیش بینی قیمت سهام استفاده شده است. برای این بررسی از اطلاعات مربوط به قیمت سهام شرکت داروسازی دکتر عبیدی در بازه زمانی (۱۳۹۴-۱۳۹۳) از پایگاه اطلاع رسانی بورس استفاده شده است. نتایج ارزیابی نشان داد که الگوریتم فراابتکاری علف های هرز با توجه به معیار MSE نسبت به تکنیک زنبورهای مصنوعی دقت بیشتری است.

واژه های کلیدی: زنبورهای مصنوعی، علف های هرز، قیمت سهام، بازار مالی

۱-مقدمه

رشد بلند مدت و مداوم اقتصادی نیازمند تجهیز و تخصیص بهینه ی منابع در سطح اقتصاد ملی است و این مهم بدون کمک بازارهای مالی، به ویژه بازار سرمایه گسترده و کارآمد به سهولت امکان پذیر نیست. سرمایه گذاری در سهام عرضه شده در بورس اوراق بهادار یکی از گزینه های پرسود در بازار سرمایه است. اهمیت ویژه بازار سرمایه در توسعه اقتصادی از طریق هدایت موثر سرمایه ها و تخصیص بهینه منابع غیر قابل انکار است. سرمایه گذاری و بقا در بازار سرمایه مستلزم تصمیم گیری می باشد که این امر نیازمند دستیابی به اطلاعاتی در خصوص وضعیت آینده قیمت بازار سهام و برخی از عوامل اقتصادی موثر می باشد. لذا در صورتی که بتوان روند آتی بازار سهام را به روش های مناسب و دقیق پیش بینی نمود، سرمایه گذار می تواند بازده حاصل از سرمایه گذاری خود را بیشینه سازد و ریسک را کاهش دهد، که در این صورت شاید بتوان به اقتصاد باثبات تری دست یافت. با این وجود پیش بینی رفتار مجموعه ی پیچیده ای نظیر بازار سرمایه در یک مجموعه ی اقتصادی مدرن نه تنها