



پایان‌نامه‌ی کارشناسی ارشد: مینا عباس پور، ۱۳۹۷

مقایسه الگوریتم کرم شب تاب و آدابوست در پیش‌بینی بازده سهام

اصلی‌ترین عاملی که هر سرمایه‌گذار در تصمیم‌گیری‌های خود مورد توجه خاص قرار می‌دهد بازده است یعنی سرمایه‌گذاران به دنبال پربازده‌ترین فرصت‌ها برای سرمایه‌گذاری منابع مازاد خود در بازارهای سرمایه هستند. هدف این پژوهش پیش‌بینی بازده سهام با استفاده از روش الگوریتم آدابوست و کرم شب تاب می‌باشد. بدین منظور از اطلاعات مالی 1062 سال شرکت طی سال‌های 1390 تا 1395 با استفاده از نرم‌افزار متلب نشان داده شد که با به‌کارگیری متغیرهای بازده دارایی، بازده حقوق صاحبان سهام، نسبت گردش دارایی، نسبت بدهی بلند مدت به کل دارایی‌ها، نسبت وجه نقد عملیاتی به دارایی‌ها، بازده فروش، نسبت سود تقسیمی و نسبت p/e و استفاده از الگوریتم‌های هوش مصنوعی (آدابوست و کرم شب تاب) می‌توان بازده سهام آتی شرکت‌های پذیرفته‌شده در بورس اوراق بهادار تهران را با خطای کم مورد ارزیابی و پیش‌بینی قرارداد.

کلیدواژه‌ها: بازده سهام، الگوریتم هوش مصنوعی، بورس اوراق بهادار تهران

شماره‌ی پایان‌نامه: ۱۲۷۲۱۳۰۱۹۶۱۰۱۱

تاریخ دفاع: ۱۳۹۷/۱۰/۱۲

رشته‌ی تحصیلی: حسابداری

دانشکده: علوم انسانی

استاد راهنما: دکتر مهدی فیل سرایی

M.A. Thesis:

Comparison of algorithms fireflies and Adaboost for Stock return forecasting in Tehran Stock Exchange

The main factor that each investor pays attention to in their decision-making is return, meaning investors are looking for the most productive opportunities to invest their surplus resources in capital markets. The purpose of this research is to predict stock returns using Laser Firefly algorithm and Adabot. For this purpose, the financial information of 1062 years of the year 1390 to 1395 was shown using MATLAB software, which uses the variables of operating profit margin, return on assets, inventory turnover ratio, dividend profit ratio and use of artificial intelligence algorithms (Adaboos and Firefighting) can assess the future stock returns of listed companies in the Tehran Stock Exchange with a low error and predict the contract.