

اطلاعات منتشر شده سهام و قیمت سهام

نویسنده

زینب صلواتی

www.ketab.ir



سرشناسه	:	صلواتی، زینب؛ ۱۳۶۷-
عنوان و نام پدیدآور	:	اطلاعات منتشر شده سهام و قیمت سهام / نویسنده زینب صلواتی.
مشخصات نشر	:	کرج: موسسه نشر سیمرغ آسمان آذرگان، ۱۴۰۰.
مشخصات ظاهری	:	۱۰۸ص. : جدول، نمودار.
شابک	:	۹۷۸-۶۲۲-۲۸۲-۱۵۵-۵
وضعیت فهرست نویسی	:	فیا
یادداشت	:	کتابنامه: ص. ۹۷-۱۰۵.
موضوع	:	بورس -- ایران -- تهران -- نمونه پژوهی
موضوع	:	Stock exchanges -- Iran -- Tehran -- Case studies
موضوع	:	سهام -- ایران -- قیمت ها -- پیش بینی -- الگوهای ریاضی -- نمونه پژوهی
موضوع	:	Stocks price forecasting -- Iran -- Mathematical models -- Case studies
موضوع	:	سهام -- ایران -- قیمت ها -- نمونه پژوهی
موضوع	:	Stocks -- Prices -- Iran -- Case studies
رده بندی کنگره	:	HG۵۷۲۰/۲
رده بندی دیویی	:	۳۳۲/۶۴۲۵۵۱۲۲
شماره کتابشناسی ملی	:	۷۵۷۹۴۴۰

اطلاعات منتشر شده سهام و قیمت سهام

نویسنده: زینب صلواتی

مؤسسه نشر سیمرغ آسمان آذرگان

نوبت چاپ: اول ۱۳۹۹

چاپ و لیتوگرافی: چاپ پارمیدا

شمارگان: ۵۰۰

قیمت: ۴۵۰۰۰۰ ریال

شابک: ۹۷۸-۶۲۲-۲۸۲-۱۵۵-۵

آدرس: کرج، جاده ملارد، گلستان ۴۳، ساختمان دیبا، واحد ۲۹ - کد پستی: ۳۱۶۶۹۳۶۸۶۹



چکیده

قیمت سهام و عوامل مؤثر بر آن از دیرباز جزء مباحث بحث‌برانگیز و جذاب در حوزه بازار سرمایه بوده و همواره در پژوهش‌های مختلفی مورد بررسی قرار گرفته است. اهمیت این موضوع بدین خاطر است که قیمت سهام، مورد توجه استفاده‌کنندگان داخلی (مانند مدیران مالی و مدیران اجرایی) و استفاده‌کنندگان خارجی (مانند اعتباردهندگان و سرمایه‌گذاران) است. هدف این تحقیق، بررسی تأثیر اطلاعات منتشره در سایت کدال بر قیمت سهام در شرکت‌های پذیرفته‌شده در بورس اوراق بهادار تهران است. نمونه‌نمایی تحقیق با استفاده از روش نمونه‌گیری حذفی سیستماتیک (غربالگري) و غیر تصادفی روی بازه زمانی ۱ ساله (۱۳۹۳) انتخاب گردید. فرضیات تحقیق با استفاده از رگرسیون خطی و همچنین روش فیچر سلکشن مورد بررسی قرار گرفت. نتایج حاصل از بررسی با این دو روش نتایج تقریباً مشابهی به دست داد که نشان می‌دهد اطلاعات منتشره در بورس ایران دارای محتوای اطلاعاتی است و می‌تواند بر قیمت سهام تأثیر گذار باشد. همچنین سایر عوامل از جمله اندازه شرکت، نسبت بدهی و رشد شرکت نیز بر قیمت سهام شرکت‌های پذیرفته‌شده در بورس اوراق بهادار تهران تأثیر گذار می‌باشند.

کلیدواژه: اطلاعات منتشرشده سهام، قیمت سهام، بورس اوراق بهادار تهران، شبکه‌های

عصبی

فهرست

۵	چکیده
۱۱	فصل اول: کلیات تحقیق
۱۱	۱-۱- مقدمه
۱۲	۲-۱- بیان مسئله
۱۳	۳-۱- اهمیت موضوع
۱۴	۴-۱- هدف تحقیق
۱۴	۵-۱- سؤالات تحقیق
۱۴	۱-۵-۱- سؤالات فرعی تحقیق
۱۴	۶-۱- قلمرو تحقیق
۱۴	۱-۶-۱- قلمرو مکانی- جامعه تحقیق
۱۴	۲-۶-۱- قلمرو زمانی
۱۵	۷-۱- روش نمونه‌گیری و نمونه‌آوری
۱۵	۸-۱- روش تجزیه و تحلیل
۱۵	۹-۱- چارچوب نظری، مدل و متغیرهای تحقیق
۱۶	مدل مفهومی تحقیق
۱۶	متغیرهای تحقیق
۱۸	۱۰-۱- نقشه راه
۱۸	۱۱-۱- تعریف مفهومی و عملیاتی متغیرهای پژوهش
۱۸	تعریف مفهومی
۲۰	تعریف عملیاتی
۲۱	فصل دوم: ادبیات و پیشینه تحقیق
۲۱	۱-۲- مقدمه
۲۲	۲-۲- بازار مالی
۲۳	۱-۲-۲- طبقه‌بندی بازارهای مالی
۲۳	۲-۲-۲- بازار پول
۲۳	۳-۲-۲- بازار سرمایه
۲۵	۳-۲- تعریف بورس اوراق بهادار
۲۶	۱-۳-۲- تاریخچه بورس و اوراق بهادار در جهان
۲۶	۲-۳-۲- تاریخچه بورس و اوراق بهادار تهران
۲۹	۴-۲- نقش گزارشگری مالی در بازار سرمایه
۲۹	۵-۲- استفاده‌کنندگان از اطلاعات حسابداری

۳۰	۲-۵-۱- اثرات ارائه صورت‌های مالی بر قضاوت سرمایه‌گذاران در تصمیمات سرمایه‌گذاری
۳۰	۲-۶- صورت‌های مالی اساسی
۳۱	۲-۷- قیمت سهام
۳۲	۲-۷-۱- شاخص‌های قیمت سهام
۳۸	۲-۸- نوسانات قیمت
۳۸	۲-۸-۱- فرضیه فراواکنشی
۴۰	۲-۸-۲- فراواکنشی در کوتاهمدت
۴۰	۲-۸-۳- متوقف کننده‌های خودکار
۴۲	۲-۸-۴- حد نوسان قیمت
۴۳	۲-۸-۵- حد نوسان قیمت در سایر کشورها
۴۶	۲-۹- مفهوم خبر
۴۶	۲-۹-۱- ویژگی اخبار
۴۷	۲-۹-۲- ابعاد ارزش خبر
۴۹	۲-۹-۳- تعریف اطلاعات
۵۰	۲-۹-۴- اخبار و اطلاعات در بازارهای مالی
۵۱	۲-۹-۵- انواع اخبار ارزیابی قیمت اوراق بهادار
۵۱	۲-۹-۶- اطلاعات نهانی
۵۲	۲-۹-۷- اطلاعات در بازار سهام
۵۲	۲-۹-۸- انواع اطلاعات در بازار سهام
۵۳	۲-۱۰- شبکه عصبی
۵۵	۲-۱۰-۱- کیفیت پردازش اطلاعات در یک نرون مصنوعی
۵۶	۳-۱۰-۲- سبک‌های معماری شبکه‌های عصبی
۵۷	۲-۱۰-۳- قواعد یادگیری در شبکه‌های عصبی
۵۸	۲-۱۰-۴- مدل شبکه عصبی
۵۹	۲-۱۱- الگوریتم بهینه‌سازی توده ذرات
۶۲	۲-۱۲- پیشینه تحقیق
۶۲	تحقیقات خارجی
۶۳	تحقیقات داخلی
۶۴	۲-۱۱- خلاصه فصل دوم
۶۵	فصل سوم: روش‌شناسی تحقیق
۶۵	۳-۱- مقدمه
۶۵	۳-۲- سؤال تحقیق
۶۵	۳-۲-۱- سوالات فرعی تحقیق

۶۶	۳-۳- روش تحقیق
۶۶	۱- پردازش داده‌ها
۶۷	۲- انتخاب نوع شبکه از نظر برگشت پذیری
۶۷	۳- انتخاب مناسبترین شبکه در مکانیزم تنظیم وزن‌ها
۶۷	۴- یافتن مناسبترین الگوریتم پس انتشار خطا
۶۷	۵- انتخاب بهترین ترکیب نرونها
۶۷	۳-۴- جامعه و نمونه آماری و روش نمونه‌گیری
۶۷	۳-۴-۱- قلمرو مکانی- جامعه تحقیق
۶۷	۳-۴-۲- قلمرو زمانی
۶۸	۳-۴-۳- قلمرو موضوعی
۶۸	۳-۵- روش نمونه‌گیری و نمونه آماری
۶۸	۳-۶- روش گردآوری اطلاعات
۶۹	۳-۷- روش تجزیه و تحلیل داده‌ها
۶۹	۳-۷-۱- مدل شبکه عصبی
۷۱	۳-۷-۲- الگوریتم بهینه‌سازی توده ذرات
۷۲	۳-۷-۳- ترکیب شبکه‌ی عصبی و الگوریتم بهینه‌سازی توده ذرات
۷۲	۳-۸- مدل و متغیرهای تحقیق
۷۲	مدل مفهومی تحقیق
۷۳	متغیرهای تحقیق
۷۳	متغیر وابسته
۷۳	متغیرهای مستقل
۷۳	متغیرهای کنترلی
۷۴	۳-۹- خلاصه فصل
۷۵	فصل چهارم: تجزیه و تحلیل داده
۷۵	۴-۱- مقدمه
۷۵	۴-۲- توصیف متغیرهای تحقیق
۷۶	۴-۲-۱- توصیف آماری متغیرهای تحقیق
۷۶	۴-۳- آمار استنباطی
۷۷	۴-۳-۱- تبیین روابط بین متغیرهای مستقل و توضیحی با متغیر وابسته با استفاده از الگوریتم FEATURE SELECTION
۸۱	۴-۴-۲- تبیین روابط بین متغیرهای مستقل و توضیحی با روش رگرسیون خطی
۸۳	۴-۲-۳-۲- بررسی فرضیه‌های تحقیق
۸۷	۴-۴- خلاصه فصل ۴

۸۹	فصل پنجم: نتیجه‌گیری و پیشنهادها.....
۸۹	۵-۱- مقدمه.....
۸۹	۵-۲- چکیده‌ای از ماهیت و تحلیل‌های پژوهش.....
۹۰	۵-۳- خلاصه نتایج حاصل از پژوهش.....
۹۱	۵-۴- پیشنهادها تحقیق.....
۹۱	۵-۴-۱- پیشنهادهایی برگرفته از یافته‌های پژوهش.....
۹۳	۵-۴-۲- پیشنهادهایی برای پژوهش‌های آتی.....
۹۴	۵-۵- محدودیت‌ها تحقیق.....
۹۵	۵-۷- خلاصه‌ی فصل پنجم.....
۹۷	منابع.....
۹۷	منابع فارسی.....
۱۰۰	منابع لاتین.....
۱۰۳	منابع اینترنتی.....
۱۰۵	پیوست.....
۱۰۵	کد تلفیقی شبکه عصبی و الگوریتم PSO.....
۱۰۵	کد برنامه Feature Selection.....