

Сарвешвар Кумар Інані, Харш Прадхан, Сурендер Кумар, Байдянат Бісвас

Навігація по технічному аналізу на фондових ринках: результати бібліометричного та тематичного моделювання

На фондових ринках технічний аналіз відіграє надзвичайно важливу роль, пропонуючи цінну інформацію про цінові тенденції, закономірності й очікувані зміни ринку, а також допомагаючи інвесторам приймати обґрунтовані рішення. У цьому дослідженні використовуються підходи бібліометричного та тематичного моделювання 589 англomовних журнальних статей, індексованих у Scopus за останні двадцять років (з 2003 до 2023), з наголосом виключно на технічний аналіз фондових ринків. У ході аналізу спільного використання ключових слів визначено п'ять тематичних кластерів. Застосування структурного тематичного моделювання також розкриває п'ять відомих тематичних кластерів, а саме прогнозування на основі шаблонів, торгівлю на основі правил, алгоритмічну торгівлю, технофундаментальну торгівлю, а також машинне навчання й аналіз настроїв. Тема прогнозування на основі шаблонів передбачає дослідження застосування різних шаблонів або моделей для прогнозування цін на акції. Торгівля на основі правил зосереджена на використанні інструментів технічного аналізу для генерації сигналів купівлі та продажу з метою отримання прибутку. Кластер алгоритмічної торгівлі досліджує використання алгоритмів для систематичного виконання дій купівлі та продажу, особливо в сценаріях високочастотної торгівлі. Технофундаментальна торгівля досліджує інтеграцію як фундаментального, так і технічного аналізу в торгівлі та інвестиційні рішення. Нарешті, машинне навчання та аналіз настроїв зосереджуються на застосуванні передових методів машинного навчання й аналізу настроїв для прогнозування цін на акції, підкреслюючи використання складних методів у цій сфері. Трьома переважними темами в наборі даних є «торгівля на основі правил», «машинне навчання та аналіз настроїв» і «алгоритмічна торгівля», що становить 26,79 %, 23,52 % і 21,11 % набору даних відповідно. Отримані результати підкреслюють важливість цих тем у контексті досліджуваної галузі.

Ключові слова: тематичний аналіз, VOSviewer, технічний аналіз, структурна тематична модель, бібліометричний аналіз

Класифікація JEL: G11, G12, G17, G41



Стаття знаходиться у відкритому доступі і може розповсюджуватися на умовах ліцензії Creative Commons Attribution 4.0 International license, що дозволяє необмежене повторне використання, розповсюдження та відтворення на будь-якому носії за умови наявності відповідного посилання на оригінальну версію статті.