

عنوان مقاله:

پیش بینی قیمت سهام به کمک تبدیل موجک و سیستم استنتاج عصبی-فازی تطبیقی (ANFIS)

محل انتشار:

شانزدهمین کنفرانس بین المللی مهندسی صنایع (سال: 1398)

تعداد صفحات اصل مقاله: 10

نویسندگان:

امیرمحمد ملکی - دانشجو کارشناسی ارشد، دانشکده مهندسی صنایع دانشگاه صنعتی امیرکبیر تهران

اکبر اصفهانی پور - دانشیار، دانشکده مهندسی صنایع دانشگاه صنعتی امیرکبیر تهران

خلاصه مقاله:

امروزه اهمیت سرمایه گذاری برای همه روشن شده است و مردم هرچه بیشتر در فعالیتهای مختلف اقدام به سرمایه گذاری میکنند. اما اساس یک سرمایه گذاری موفق درکی مناسب از وضع موجود و پیشبینی آینده است. بازار بورس به عنوان یکی از اصلی ترین محله ای سرمایه گذاری شناخته شده که ارزش پیشبینی درست در آن بسیار بالاست و با یک پیشبینی مناسب میتوان بازدهی بالایی را کسب کرد. در این تحقیق برای پیشبینی قیمت سهام مدلی مبتنی بر شبکه عصبی و تبدیل موجک ارائه میدهیم و برای ارزیابی آن از قیمت 8 سهم در بورس اوراق بهادار تهران در 10 سال اخیر برای ارزیابی سه مدل پیش بینی (1 مدل سیستم استنتاج عصبی-فازی (2)، ANFIS مدل ترکیبی ANFIS و تبدیل موجک بدون حذف سیگنال بالا و (3 مدل ترکیبی ANFIS با حذف سیگنال بالا استفاده شد. نتایج نشان دهنده برتری مدل دوم با توجه به متوسط درصد خطای کمتر است.

کلمات کلیدی:

پیشبینی قیمت سهام، سیستم استنتاج عصبی-فازی تطبیقی (ANFIS)، تبدیل موجک، بورس اوراق بهادار تهران

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1034941>

