

عنوان مقاله:

توسعه یک روش هوشمند مبتنی بر شاخص‌های تکنیکال فازی برای پیش بینی و معامله نرخ برابری یورو- دلار.

محل انتشار:

مهندسی مالی و مدیریت اوراق بهادار، دوره 11، شماره 45 (سال: 1399)

تعداد صفحات اصل مقاله: 22

نویسندگان:

علیرضا صادقی - گروه مدیریت مالی، واحد علوم تحقیقات، دانشگاه آزاد اسلامی، تهران، ایران

امیر دانشور - گروه مدیریت فناوری اطلاعات، واحد الکترونیک، دانشگاه آزاد اسلامی، تهران، ایران

مهدی معدن چی زاج - گروه مدیریت مالی، واحد الکترونیک، دانشگاه آزاد اسلامی، تهران، ایران

خلاصه مقاله:

امروزه بازار فارکس بزرگترین بازار مالی در دنیا می‌باشد. تعیین استراتژی مناسب برای خرید یا فروش در بازار فارکس بر پایه پیش بینی از روند قیمت‌ها استوار است. لذا برای انتخاب یک استراتژی مناسب در فارکس، استفاده از مدل‌های پیچیده فراابتکاری استفاده می‌شود. در این تحقیق با پیش بینی روند بازار و بر اساس قواعد معاملاتی مبتنی بر شاخص‌های تکنیکال فازی روش جدیدی را برای سرمایه‌گذاری در بازار فارکس ارائه می‌کند. برای پیش بینی، ترکیبی از الگوریتم ماشین بردار پشتیبان ترکیبی (HSVM) و برای طبقه بندی بازار در سه کلاس مختلف (روند صعودی، روند نزولی، بدون روند) و یک الگوریتم پویای ژنتیک برای بهینه سازی قواعد معاملاتی استفاده شده است. برای تعیین قواعد معاملاتی از 5 شاخص تکنیکال فازی استفاده شده است. داده‌های جفت ارز یورو به دلار، در یک بازه زمانی روزانه بین سال‌های 2010 تا 2019 به عنوان داده‌های آموزش و آزمون استفاده می‌شود. نتایج بدست آمده در مقایسه با روش‌های سنتی نتایج امیدوارکننده‌ای داشته است

کلمات کلیدی:

فارکس، ماشین بردار پشتیبان، شاخص‌های تکنیکال فازی، الگوریتم ژنتیک

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1146671>

