

عنوان مقاله:

کالیبراسیون اندیکاتورهای تحلیل تکنیکال با استفاده از الگوریتم آتوماتای سلولی به منظور استفاده در معاملات با تواتر بالا

محل انتشار:

مهندسی مالی و مدیریت اوراق بهادار، دوره 12، شماره 47 (سال: 1400)

تعداد صفحات اصل مقاله: 19

نویسندگان:

سیدعلیرضا احمدی - گروه مهندسی مالی، واحد تبریز، دانشگاه آزاد اسلامی، تبریز، ایران.

سیدعلی پایتختی اسکویی - گروه اقتصاد، واحد تبریز، دانشگاه آزاد اسلامی، تبریز، ایران.

سیروس فحیمی آذر - گروه مدیریت، واحد تبریز، دانشگاه آزاد اسلامی، تبریز، ایران

یونس بادآور نهندی - گروه حسابداری، واحد تبریز، دانشگاه آزاد اسلامی، تبریز، ایران

خلاصه مقاله:

هدف این پژوهش بومی سازی شاخص های تحلیل تکنیکال در بازار بورس اوراق بهادار تهران به منظور پیش بینی روندهای حرکت قیمت سهام در پیاده سازی انجام معاملات با بسامد بالا به روش مومنتوم می باشد. در این پژوهش با استفاده از الگوریتم آتوماتای سلولی به کالیبراسیون اندیکاتورهای میانگین متحرک نمایی، بولینگر باندز، شاخص قدرت نسبی، درجه تغییرات، اندیکاتور استوکاستیک و اندیکاتور شاخص جریان مالی پرداخته شد. در این پژوهش داده های بررسی شده به عنوان جامعه آماری، معاملات انجام شده در بورس اوراق بهادار تهران طی بازه سه ساله از ۱۳۹۵/۰۵/۰۱ الی ۱۳۹۸/۰۴/۳۱ می باشد. نتایج بدست آمده گویای لزوم تغییر دوره های تناوب محاسبات اندیکاتورهای می باشد، بطوری که اندیکاتورهای میانگین متحرک نمایی از ۱۴ روز به ۲ روز، بولینگر باندز از ۲۰ روز به ۲ روز، شاخص قدرت نسبی از ۱۴ روز به ۱۳ روز، درجه تغییرات از ۱۲ روز به ۲ روز، اندیکاتور استوکاستیک از ۱۴ روز به ۴ روز و اندیکاتور شاخص جریان مالی از ۱۴ روز به ۲۰ روز تغییر پیدا کرد. نتیجه این تغییرات منجر به افزایش قدرت پیش بینی به ترتیب اندیکاتورهای یاد شده ۱.۳۵٪، ۳۶.۹۰٪، ۱.۸۹٪، ۳۰.۵۲٪، ۶۴.۲۰٪، ۰.۲۴٪ گردید.

کلمات کلیدی:

معاملات با بسامد بالا، آتوماتای سلولی، کالیبراسیون، اندیکاتور، تحلیل تکنیکال

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1240850>

