

عنوان مقاله:

بررسی مقایسه ای بین مدل ترکیبی سیستم ژنتیک فازی عصبی خودسازمانده و مدل خطی در پیش بینی قیمت توافقی قراردادهای آتی سکه طلا

محل انتشار:

فصلنامه تحقیقات مالی، دوره 17، شماره 2 (سال: 1394)

تعداد صفحات اصل مقاله: 20

نویسندگان:

شهاب الدین شمس - استادیار دانشگاه مازندران، بابلسر، ایران

مرضیه ناجی زواره - کارشناس ارشد مدیریت بازرگانی، دانشگاه مازندران، بابلسر، ایران

خلاصه مقاله:

این مقاله به بررسی پیش بینی قیمت قرارداد آتی سکه طلا در بورس کلای ایران پرداخته است. این تحقیق مدلی ترکیبی بر اساس سیستم ژنتیک فازی (GFS) و شبکه عصبی مصنوعی (ANN) برای پیش بینی قرارداد آتی سکه طلا ارائه داده است. در این روش، ابتدا با استفاده از روش رگرسیون گام به گام متغیرهایی مشخص می شود که بیشترین تاثیر را بر قیمت قرارداد آتی سکه طلا دارند. در گام بعدی داده های خام با استفاده از شبکه عصبی خودسازمانده به k دسته تقسیم می شود. در نهایت، این دسته ها به سیستم ژنتیک فازی وارد و پیش بینی انجام می شود. در آخر، نتیجه پیش بینی حاصل از مدل ترکیبی ارائه شده، با نتیجه حاصل از پیش بینی روش خطی آریمبا با استفاده از معیار سنجش خطا MAPE با هم مقایسه شد. نتایج نشان داد که مدل ترکیبی ارائه شده، پیش بینی بسیار مناسب تری از روش آریمبا دارد و خطای پیش بینی آن بسیار کمتر بوده است.

کلمات کلیدی:

سیستم ژنتیک فازی، شبکه عصبی مصنوعی خودسازمانده، قرار داد آتی سکه طلا، مدل آریمبا

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1395022>

