

## عنوان مقاله:

به کارگیری مدل میانگین متحرک خودرگرسیون انباشته فازی به منظور پیش بینی نرخ ارز

## محل انتشار:

دوفصلنامه روشهای عددی در مهندسی، دوره 26، شماره 2 (سال: 1386)

تعداد صفحات اصل مقاله: 9

## نویسنده:

مهدی خاشعی و مهدی بیجاری

## خلاصه مقاله:

در دنیای امروز به کارگیری روشهای کمی پیش بینی در زمینه های مختلف مورد توجه گسترده قرار گرفته است. تغییرات سریع محیطهای ناشناخته در دنیای واقعی و به ویژه بازارهای مالی سبب ایجاد مشکلاتی برای پیش بینی کنندگان به منظور تامین داده های مورد نیاز شده است. مدل های میانگین متحرک خود رگرسیون انباشته (ARIMA) دارای محدودیت تعداد داده های گذشته بوده و شبکه های عصبی مصنوعی (ANNs) نیز به منظور حصول نتایج دقیق احتیاج به داده های زیادی دارند. مدل های رگرسیون فازی، مدل هایی مناسب در شرایط پیش بینی با داده های قابل حصول کم اند. در این مقاله به منظور برطرف ساختن مشکل مذکور و حصول نتایج دقیقتر، مدل های میانگین متحرک خود رگرسیون انباشته با رگرسیون فازی ترکیب شده ان. نتایج حاصله از به کارگیری روش ترکیبی در بازار ارز بیانگر کارآمدی این روش در پیش بینی بازه تغییرات نرخ ارز بوده است.

## کلمات کلیدی:

Exchange rate, Auto Regressive Integrated Moving Average, Fuzzy regression, Time series forecasting, Combined forecast, پیش بینی نرخ ارز، مدل اریما (ARIMA)، مدل میانگین متحرک خود رگرسیون انباشته فازی (FARIMA)

## لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1442050>

