

## عنوان مقاله:

پیش بینی روند بازارهای مالی جهانی با استفاده از روش های شبکه عصبی -فازی تطبیقی و شبکه عصبی مصنوعی

## محل انتشار:

اولین کنفرانس ملی سیستم های پیچیده با محوریت علم شبکه (سال: 1400)

تعداد صفحات اصل مقاله: 6

## نویسندگان:

محمدرضا متقی پور - کارشناس برق الکترونیک، دانشگاه آزاد اسلامی، واحد تبریز، تبریز، ایران

فهیمه سلیمانی - کارشناس حقوق، دانشگاه پیام نور، واحد تبریز، تبریز، ایران

مینا علیاری - کارشناس ارشد مدیریت صنعتی تحقیق در عملیات، دانشگاه آزاد اسلامی، واحد تبریز، تبریز، ایران

## خلاصه مقاله:

بازارهای مالی جهانی نه تنها از عوامل کلان بلکه از هزاران عامل دیگر نیز متاثر می شوند. تعداد زیاد و ناشناخته بودن عوامل موثر بر بازار مالی جهانی موجب عدم اطمینان در زمینه سرمایه گذاری شده است. در این گونه شرایط، یکی از راههای مناسب برای مقابله با پیچیدگی، پیش بینی است. بر همین اساس هدف این تحقیق پیش بینی روند بازارهای مالی جهانی با استفاده از روشهای شبکه عصبی- فازی تطبیقی و شبکه عصبی مصنوعی می باشد. برای نیل به هدف تحقیق، نخست سه متغیر کلان اقتصادی به همراه مقادیر حجم بازار روزانه به عنوان متغیرهای مدل انتخاب شده اند. سپس ساختارهای گوناگون شبکه عصبی مصنوعی و سیستم عصبی فازی انطباقی برای بررسی پیش بینی پذیری و شناسایی مدل مناسب انتخاب گردیده است. نتایج بدست آمده از نرم افزار متلب برای دو روش شبکه عصبی مصنوعی و سیستم عصبی فازی انطباقی برای داده های سری زمانی ۲۰۱۳ تا ۲۰۲۰ به کمک شاخصهای برآورد خطای مدل ها، بررسی گردیده است. نتایج بررسی ها نشان می دهد که در مقایسه بین شبکه عصبی مصنوعی و سیستم عصبی- فازی انطباقی بهترین عملکرد برای پیش بینی با خطای کمتر از طریق شبکه های عصبی مصنوعی بدست آمده است. همچنین نتایج تحقیق نشان می دهد که در ساختارهای مختلف شبکه عصبی نیز بهترین ساختار مربوط به وجود چهار تاخیر و سه متغیر کلان اقتصادی می باشد.

## کلمات کلیدی:

بازارهای مالی جهانی، شبکه عصبی فازی، شبکه عصبی مصنوعی، حجم بازار

## لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1444425>

