

عنوان مقاله:

طراحی مدل بهینه سازی شیمیایی مصنوعی برای پیش بینی قیمت سهام و مقایسه آن با مدل‌های مبتنی بر شبکه عصبی مصنوعی و مدل های ترکیبی در بورس اوراق بهادار تهران

محل انتشار:

دومین کنفرانس سراسری مطالعات و یافته های نوین در مدیریت و حسابداری ایران (سال: 1401)

تعداد صفحات اصل مقاله: 13

نویسندگان:

سیدکاظم میرجعفری - دکتری شیمی کاربردی، دانشگاه صنعتی مالک اشتر تهران، تهران، ایران

شعبان محمدی - دکتری ریاضی، دانشگاه صنعتی شاهرود، سمنان، ایران

حسین سیفی - کارشناسی ریاضی، اداره آموزش و پرورش منطقه سروایت، چکنه، ایران

خلاصه مقاله:

بدلیل عدم اطمینان و پیچیدگی مرتبط با داده های سهام پیش بینی موفق قیمت آتی سهام نیازمند یک سیستم پیشبینی دقیق است. این پژوهش یک بهینه سازی واکنش شیمیایی مصنوعی مبتنی بر شبکه پیوند عملکردی را برای پیشبینی قیمت سهام پیشنهاد می کند. در این راستا قیمت پنج سهام در یک دوره ۸ ساله طی سال ۱۳۹۰ تا ۱۳۹۷ جمعآوری شد. کارکرد مدل پیشنهادی توسط پیش بینی قیمت سهام ارزیابی شده است. آزمایش های مختلف برای ارزیابی عملکرد مدل پیشنهادی مانند پیش بینی قیمت سهام ۱ روز بعد، ۱ هفته بعد و ۱ ماه بعد صورت گرفته اند. از طریق مطالعات شبیه سازی و بکار بردن نرم افزار متلب، نشان داده شد که مدل پیشنهادی پیش بینی دقیق تری نسبت به دیگر مدل ها ارائه می دهد. مدل پیش بینی مبتنی بر مدل شبکه پیوند عملکردی شیمیایی مصنوعی، حداقل زمان را در مقایسه با مدل های پیش بینی مبتنی بر شبکه عصبی مصنوعی و مدل های ترکیبی دارد.

کلمات کلیدی:

بهینه سازی شیمیایی مصنوعی، پیش بینی قیمت سهام، شبیه سازی، شبکه عصبی مصنوعی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1477275>

