

عنوان مقاله:

شبیه سازی بازار: رویکرد مبتنی بر عامل

محل انتشار:

نخستین کنفرانس ملی مدل سازی و شبیه سازی سیستم های پویا (سال: 1401)

تعداد صفحات اصل مقاله: 14

نویسندگان:

محمدامین واحدی نیا - دانشجوی کارشناسی، گروه مهندسی صنایع، دانشگاه تهران، تهران، ایران

سما صداقت - دانشجوی کارشناسی، گروه مدیریت مالی، دانشگاه تهران، تهران، ایران

خلاصه مقاله:

در این مقاله، در مورد شبیه سازی بازارهای مالی با بهره گیری از مدل های مبتنی بر عامل بحث شده است. ابتدا بازار مالی مورد نظر انتخاب شده، استراتژی های معمول و مورد استفاده در آن بازار تدوین شده و به نظرسنجی گذاشته شده؛ سپس مدلی مبتنی بر عامل با توجه به نتایج نظرسنجی و تئوری های پایه ای در این حوزه تدوین شده، به زبان برنامه نویسی پایتون همراه با محیط اجرای مناسب مدل توسعه داده شد و بهینه سازی هایی جهت اجرای سریع تر مدل بر روی آن انجام شد؛ در نهایت مدل مورد صحت سنجی و تصدیق با توجه به انتظارات بیان شده قرار گرفت. جهت صحت سنجی مدل نیز از روش های بررسی حالات مرزی، تکرار شبیه سازی ها و مشورت با خبرگان حوزه ی بازارهای مالی استفاده شد. پس از موفقیت فرآیند تصدیق و تایید صحت مدل، فرضیه ی مناسب بودن استراتژی سرمایه گذاری بلندمدت در بازار مورد بررسی قرار گرفته و در نهایت نتیجه حاصل شد که این استراتژی مناسب بازار کالا میباشد

کلمات کلیدی:

شبیه سازی مبتنی بر عامل، نظریه ی بازی ها، بازارهای مالی، بهینه سازی از طریق شبیه سازی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1506743>

