

عنوان مقاله:

کاربرد رهیافت شبکه عصبی در پیش بینی قیمت کنجاله سویا در بورس کالای ایران

محل انتشار:

فصلنامه اقتصاد مالی، دوره 9، شماره 33 (سال: 1394)

تعداد صفحات اصل مقاله: 13

نویسندگان:

علی اکبر باغستانی - استادیار دانشگاه آزاد واحد علوم تحقیقات

سعید یزدانی - استاد اقتصاد دانشگاه تهران

مجید احمدیان - استاد اقتصاد دانشگاه تهران

خلاصه مقاله:

چکیده وابستگی روزافزون صنعت دام و طیور کشور به کنجاله سویا، موجب شده است تا هرگونه نوسان قیمت این محصول از نگاه فعالان بازار آن به دقت و حساسیت پی گیری شود. این نوسان ها در برخی مقاطع، دغدغه ها و نگرانی های جدی در خصوص وضعیت تامین کنجاله سویا و قیمت آن به وجود آورده است. به منظور دست یابی به پیش بینی های بهتر در بازار بورس کنجاله سویا، قواعد موجود در آن شناسایی شود. در این مطالعه با استفاده از داده های قیمت ماهانه و هفتگی کنجاله سویا در بازار بورس، ضمن بررسی جایگاه کنجاله سویا در معاملات بورس کالا، قیمت کنجاله سویا با رهیافت شبکه عصبی مبتنی بر الگوریتم [GMDH] پیش بینی و نتایج با پیش بینی های مدل خودرگرسیو میانگین متحرک مقایسه می گردد. نتایج نشان می دهد الگوریتم شبکه عصبی GMDH، توانایی و دقت بالاتری در پیش بینی قیمت نسبت به روش خودرگرسیو میانگین متحرک داشته است. [i].Group (Method of Data Handling (GMDH

کلمات کلیدی:

واژگان کلیدی: کنجاله سویا، روش GMDH، مدل خودرگرسیو میانگین متحرک، پیش بینی قیمت، بورس کالا، طبقه بندی Q13، D53، D43، C12، C1

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1570283>

