

عنوان مقاله:

یکپارچه سازی تکنیک های هوش مصنوعی جهت ارائه مدل پیش بینی قیمت سهام

محل انتشار:

پژوهش های حسابداری مالی و حسابرسی، دوره 6، شماره 24 (سال: 1393)

تعداد صفحات اصل مقاله: 13

نویسندگان:

مهدی مرادزاده فرد - استادیار، گروه آموزشی حسابداری، واحد کرج، دانشگاه آزاد اسلامی، کرج، ایران

رویا دارابی - استادیار، گروه آموزشی حسابداری، واحد تهران جنوب، دانشگاه آزاد اسلامی، تهران، ایران

رامین شاهعلی زاده - کارشناس ارشد حسابداری

خلاصه مقاله:

اوراق بهادار روش مطمئنی است برای جلب اعتماد عمومی جهت سرمایه گذاری در انواع اوراق بهادار با خطرهای متفاوت است و با این روش می توان سرمایه های کوچک و پراکنده را که به تنهایی نمی توانند مورد بهره برداری قرار گیرند جمع آوری نمود از آنها سرمایه هنگفتی جهت توسعه و پیشرفت اقتصادی فراهم آورد. در بورس های اوراق بهادار حساسیت های زیادی نسبت به روند قیمت وجود دارد این امر باعث گردیده تا تحولات مرتبط با چنین پدیده ای مورد تحلیل های منظم قرار گیرد. در سال های اخیر مدل های متفاوتی جهت پیش بینی قیمت سهام توسط محققین مورد استفاده قرار گرفته است و از آنجایی که تکنیک های هوش مصنوعی که شامل شبکه های عصبی، الگوریتم ژنتیک و منطق فازی است نتایج موفقیت آمیزی در زمینه حل مسایل پیچیده به دست آورده اند در این راستا بیشتر مورد بهربرداری قرار گرفته اند. هدف از این تحقیق رسیدن به این پاسخ است که آیا می توان با استفاده از ترکیب روش های هوش مصنوعی مدلی ایجاد نمود که نسبت به سایر روش های خطی و غیر خطی پیش بینی قیمت سهام (بورس اوراق بهادار تهران - شرکت ایران خودرو) را با میزان خطای کمتری انجام دهد. در این تحقیق جهت پیش بینی قیمت سهام از ترکیب روش های هوش مصنوعی شامل شبکه های عصبی - فازی و الگوریتم ژنتیک استفاده شده است و این مدل ترکیبی با روش های شبکه عصبی به عنوان یکی دیگر از مدل های هوش ۲ مصنوعی و مدل خطی ARIMA با توجه به معیارهای MSE, MAPE, MAE, R مقایسه گردیده اند. نتایج این پژوهش نشان از برتری مدل ترکیبی نسبت به سایر مدل ها مورد بررسی دارد.

کلمات کلیدی:

قیمت سهام، پیش بینی، شبکه های عصبی، شبکه های عصبی - فازی، الگوریتم ژنتیک

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1615995>

