

## عنوان مقاله:

ارائه مدلی برای پیش بینی قیمت سهام شرکت ایران خودرو به کمک شبکه‌های عصبی

## محل انتشار:

چهارمین کنفرانس ملی مهندسی صنایع (سال: 1384)

تعداد صفحات اصل مقاله: 15

## نویسندگان:

محمد رضا عباس پور - کارشناس ارشد مهندسی سیستم های اقتصادی

محمد رضا امین ناصری - استادیار دانشگاه تربیت مدرس

## خلاصه مقاله:

بی تردید امروزه بیشترین مقدار سرمایه از طریق بازارهای بورس در تمام جهان مبادله می شود. در حال حاضر عرضه و تقاضای سالانه 50 میلیون خودرو در جهان صنعت خودروسازی را به یکی از صنایع بزرگ تبدیل کرده است. شرکت ایران خودرو با در اختیار داشتن حدود 65% از سهم بازار خودرو کشور چه از نظر تولید و چه از نظر فروش، یکی از شرکت های مهم در بازار خودرو ایران و در نتیجه در بازار بورس می باشد و لذا تمایل روزافزونی مبنی بر پیش بینی قیمت سهام آن مشاهده می شود. از طرف دیگر، امروزه علاقه فزاینده ای در استفاده از شبکه های عصبی برای پیش بینی قیمت سهام در بازار بورس بوجود آمده است. قدرت بالای تشخیص انواع الگوهای موجود در داده های بازار و تقریب توابع پیچیده از مشخصات ممتاز شبکه عصبی در کشف فرایند مولد قیمت بازار می باشد. در این مقاله به پیش بینی قیمت سهام ایران خودرو (Iran Khodro Stock Exchange Price)) به کمک شبکه های عصبی پرسپترون خواهیم پرداخت. از این رو، پس از بررسی ادبیات موضوع، بوسیله آزمون گردش، امکان پیش بینی قیمت سهام شرکت ایران خودرو بررسی گردیده است. به علت نوسانات شدید موجود در داده های قیمت سهام شرکت ایران خودرو، روش خاصی برای انتخاب مجموعه تست و آموزش بکار گرفته شده و در نتیجه، قدرت برازش مدل شبکه به مراتب بهبود یافته است. همچنین تأثیر انواع توابع تبدیل برای لایه مخفی و خروجی و انواع ساختار شبکه از لحاظ تعداد گره های ورودی و مخفی بر عملکرد شبکه مورد بررسی قرار گرفته و آنها که در بهبود مدل شبکه موثر بوده اند، در مدل نهایی لحاظ گردیده اند و در نهایت بهترین مدل شبکه برای پیش بینی دوره های مختلف زمانی ارائه گردیده است.

## کلمات کلیدی:

پیش بینی، شبکه عصبی، بازار بورس، پیش بینی قیمت سهام، شرکت ایران خودرو

## لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/17483>

