

عنوان مقاله:

ترکیب شبکه های عصبی برای پیش بینی قیمت سهام

محل انتشار:

پژوهشنامه اقتصاد کلان، دوره 10، شماره 39 (سال: 1389)

تعداد صفحات اصل مقاله: 0

نویسندگان:

نیما حاتمی - دانشجوی کارشناسی ارشد برق- الکترونیک دانشگاه شاهد

حجت میرزازاده - دانشجوی کارشناسی ارشد مدیریت مالی دانشگاه شاهد

رضا ابراهیم پور - استادیار گروه مهندسی برق دانشگاه تربیت دبیر شهیدرجایی تهران

خلاصه مقاله:

در این مقاله، یک مدل ابتکاری با ترکیب شبکه های عصبی مصنوعی (ANN) برای پیش بینی رفتار قیمت سهام پیشنهاد و اجرا می شود. این مدل ترکیبی، به صورت ساختار دو طبقه می باشد: شبکه های عصبی طبقه اول یا پیشگوهای پایه (Base Predictor) مسئول پیش بینی روزانه داده ها با ویژگی مختلف یک سهام می باشند و در طبقه دوم، شبکه دیگر، به عنوان ترکیب کننده پیش بینی نهایی را با بررسی و آنالیز اطلاعات پیشگوهای طبقه اول انجام می دهد. نتایج تجربی بر روی یکی از مجموعه داده های بورس ایران، برتری و کارایی مدل پیشنهادی را در مقایسه با مدل رایج پیش بینی نشان می دهد.

کلمات کلیدی:

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1853423>

