

عنوان مقاله:

ارزیابی پیش بینی پذیری قیمت سهام با استفاده از شبکه های عصبی فازی در بورس تهران

محل انتشار:

فصلنامه سیاست های مالی و اقتصادی، دوره 5، شماره 17 (سال: 1396)

تعداد صفحات اصل مقاله: 19

نویسندگان:

سید جلال صادقی شریف - دانشگاه شهید بهشتی

سجاد فرازمنند - دانشگاه شهید بهشتی

خلاصه مقاله:

فعالان بورس برای تصمیم‌گیری در بازارهای مالی و کسب حداکثر بازدهی نیازمند ابزارهای پیشرفته و کاربردی هستند تا با دقت مناسب به پیش بینی بپردازند. در این راه ضروری است ارزیابی پیش-بینی‌ها متناسب با حوزه‌ی مالی انجام شود. این مقاله برای دستیابی به این هدف قیمت سهام پتجاه شرکت بورس تهران را با استفاده از شبکه های عصبی فازی پیشخور مدل‌سازی کرده است. همچنین با استفاده از سیستم کنترلگر انفیس، مدل شبکه عصبی در هر تکرار کنترل می‌شود. برای انجام محاسبات از قیمت های روزانه سهام شرکت های بورسی از آذر ۱۳۸۴ تا آذر ۱۳۹۴ استفاده شده است. دقت پیش بینی ها نیز ابتدا بر مبنای چهار شاخص های معتبر آماری ارزیابی گردید. سپس با استفاده از روش نرخ برخورد، صحت پیش بینی ها ارزیابی شده است. نتایج نشان می‌دهد دقت پیش بینی شبکه های عصبی فازی بسیار بالاست؛ همچنین در برخی موارد با وجود اینکه پیش بینی مربوط به یک سهم دارای دقت بالاتری دارد، از صحت پایین تری برخوردار است؛ لذا برآورد صحت پیش بینی ها در ارزیابی پیش بینی ها سهمی تاثیرگذار دارد؛ از این رو پیشنهاد می‌شود در انجام و ارزیابی مدل های پیش بینی علاوه بر توجه به خطاهای آماری مرسوم از روش های کیفی ارزیابی صحت پیش بینی ها نظیر معیار نرخ برخورد استفاده شود.

کلمات کلیدی:

Neural Networks, Prediction, Stock Return, Tehran Stock Exchange, شبکه های عصبی مصنوعی, پیش بینی, بازده

قیمت سهام, بورس تهران

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/2022234>

