

عنوان مقاله:

پیش بینی قیمت سهام بانک صادرات با استفاده از شبکه عصبی مصنوعی

محل انتشار:

همایش ملی علوم و مهندسی کامپیوتر با محوریت امنیت ملی و توسعه پایدار (سال: 1393)

تعداد صفحات اصل مقاله: 8

نویسندگان:

نیما فرجیان - گروه کامپیوتر، موسسه آموزش عالی ایوانکی

مینا محمدی - گروه کامپیوتر، موسسه آموزش عالی ایوانکی

خلاصه مقاله:

امروزه سرمایه گذاری در بورس، بخش مهمی از اقتصاد جامعه را تشکیل می دهد. تغییرات قیمت سهام یکی از مهم ترین موضوعات مورد توجه هر سرمایه گذار است. به همین دلیل پیش بینی قیمت سهام برای سهامداران از اهمیت بالایی برخوردار است تا بتوانند از سرمایه گذاری خود، سود بیشتری کسب کنند. در این نوشتار سعی بر این است که به پیش بینی قیمت سهام روز بعد بانک صادرات در بورس اوراق بهادار تهران با استفاده از مدل پرسپترون چند لایه از شبکه های عصبی مصنوعی پردازیم و سعی میکنیم مدلی را انتخاب کنیم که میانگین مجموع مربعات خطای آن (MSE) کمتر باشد. متغیرهای زیادی بر قیمت سهام تاثیرگذار هستند، اما از بین آن ها تاثیر شاخص های اقتصادی را می توان بیشتر دانست. از جمله: نرخ ارز، قیمت طلا و قیمت نفت. این شاخص ها به عنوان متغیرهای مستقل برای پیش بینی قیمت سهام در نظر گرفته می شوند. نتایج حاصل نشان می دهد شبکه با ترکیب 20-80 و معماری 1-14-4 به بهترین پاسخ همگرا می شود.

کلمات کلیدی:

بورس اوراق بهادار تهران، شبکه های عصبی مصنوعی، قیمت سهام

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/387473>

