

عنوان مقاله:

پیش بینی بازده سهام با استفاده از شبکه ی عصبی تطبیقی

محل انتشار:

کنفرانس ملی حسابداری و مدیریت (سال: 1392)

تعداد صفحات اصل مقاله: 20

نویسندگان:

عطیه رنگین کمان - دانشجوی کارشناسی ارشد مهندسی صنایع - سیستم های اقتصادی و اجتماعی ، دانشگاه

بوعلی سینا - استادیار گروه مهندسی صنایع ، دانشگاه بوعلی سینا

خلاصه مقاله:

کسب بازده اولویت اصلی سرمایه گذاران فعال در بازار بورس است. بنابراین ارزیابی و پیش بینی بازده سهام می تواند نقش بسزایی در زمینه انتخاب سهام توسط سرمایه گذاران داشته باشد. شبکه های عصبی مصنوعی یکی از ابزارهای هوشمندی هستند که در زمینه پیش بینی بسیار مورد توجه قرار گرفته اند. عوامل مختلفی در طراحی شبکه های عصبی موثرند که بسته به نوع مسئله ، فردخبره باید توپولوژی شبکه ، تابع فعال سازی، تعداد لایه ها و نرون ها در هر لایه را مشخص کند. در این تحقیق یک روش خودکار جدید برای طراحی شبکه های عصبی بر اساس داده های ورودی و خروجی پیشنهاد شده است . در این پژوهش الگوریتم تکامل تفاضلی، عهده دار طراحی شبکه عصبی نزدیک به بهینه به جای فردخبره است. پارامترهای الگوریتم تکامل تفاضلی به صورت تطبیقی و با استفاده از اتوماتای یادگیر درحین فرایند جست و جو تنظیم می گردند. نتایج حاکی از پیش بینی قابل قبول شبکه ی عصبی پیشنهادی از بازده سهام در بورس اوراق بهادار تهران است

کلمات کلیدی:

بازده سهام، شبکه عصبی مصنوعی، الگوریتم تکامل تفاضلی، اتوماتای یادگیر

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/420251>

