

عنوان مقاله:

پیش بینی شاخص سهام مبتنی بر داده کاوی با الگوریتم ژنتیک و SVM و طبقه بندی با شبکه عصبی- فازی (ANFIS)

محل انتشار:

کنفرانس بین المللی پژوهش های کاربردی در فناوری اطلاعات، کامپیوتر و مخابرات (سال: 1394)

تعداد صفحات اصل مقاله: 14

نویسندگان:

محمد شاکری - کارشناسی ارشد، گروه هوش مصنوعی، دانشکده فنی و مهندسی کامپیوتر، دانشگاه آزاد اسلامی واحد علوم و تحقیقات بوشهر، ایران

مرضیه دادور - استادیار، گروه هوش مصنوعی، دانشکده فنی و مهندسی کامپیوتر، دانشگاه آزاد اسلامی واحد علوم و تحقیقات بوشهر، ایران

سارا کاوه - کارشناسی ارشد، گروه هوش مصنوعی، دانشکده فنی و مهندسی کامپیوتر، دانشگاه آزاد اسلامی واحد علوم و تحقیقات بوشهر، ایران

خلاصه مقاله:

اساساً پیش بینی متغیرهای اقتصادی، از کاربرد وسیعی در برنامه ریزی و سیاست گذاری های اقتصادی از یک سو و نیز سرمایه گذاری بخش های مختلف از سوی دیگر، برخوردار است. همچنین، یکی از مهمترین اهداف مدل سازی های اقتصادی، پیش بینی آتی متغیرهای اقتصادی بوده و بالطبع قدرت این مدل ها بر اساس صحت پیش بینی شان مورد ارزیابی قرار می گیرند. این تحقیق به بررسی دقت با داده کاوی با الگوریتم ژنتیک و SVM، شبکه عصبی- فازی (ANFIS) جهت پیش بینی قیمت سهام در سه سطح روزانه، هفتگی و ماهیانه می پردازد. جامعه آماری این تحقیق دربرگیرنده کلیه شرکت های پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار در بازه زمانی 1380 تا 1394 می باشد که نمونه مورد بررسی شامل 10 شرکت می باشد. نتایج نشان می دهد که همه مدل ها قابلیت پیش بینی قیمت سهام را دارا هستند اما مدل پیشنهاد داده کاوی با الگوریتم ژنتیک و SVM و طبقه بندی با شبکه عصبی فازی (ANFIS) در توانایی بالاتری جهت پیش بینی قیمت سهام دارا می باشند.

کلمات کلیدی:

پیش بینی شاخص سهام، الگوریتم ژنتیک، ماشین بردار پشتیبان (SVM)، شبکه عصبی- فازی (ANFIS)

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/451029>

