

## عنوان مقاله:

پیش بینی شاخص بورس اوراق بهادار ایران با استفاده از شبکه عصبی سری زمانی

## محل انتشار:

کنفرانس جهانی افق های نوین در علوم انسانی، آینده پژوهی و توانمند سازی (سال: 1394)

تعداد صفحات اصل مقاله: 9

## نویسنده:

احسان ابوالفتحی - باشگاه پژوهشگران جوان و نه بدان، دانشگاه آزاد اسلامی، واحد علوم و تحقیقات

## خلاصه مقاله:

در این مقاله با هدف پیش بینی مقدار شاخص بورس در 12 ماه آتی به ارائه شبکه عصبی سری زمانی NARX پرداخته ایم. تا از این رهگذر بتوانیم به بررسی یکی از فاکتورهای بسیار مهم در بورس اوراق بهادار که می تواند نقش مهمی در میزان معاملات در بورس داشته باشد بپردازیم. داده های ما در این مقاله از نوع سری زمانی و به صورت ماهیانه از ابتدای سال 1,390 تا مرداد 1,394 بوده است همچنین برای شبکه عصبی شش ورودی و یک خروجی داشته ایم. سپس داده ها را برای آموزش به شبکه عصبی سری زمانی داده و اقدام به به دست آوردن خطا نموده ایم و در نهایت پیش بینی شاخص بورس را برای 12 ماه آتی انجام داد و شبکه عصبی سری زمانی NARX را برای پیش بینی مقدار شاخص بورس ابزاری مناسب دانسته ایم.

## کلمات کلیدی:

شاخص بورس، شبکه عصبی سری زمانی، NARX بورس اوراق بهادار

## لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/485787>

