

عنوان مقاله:

ارزیابی توانایی مدل‌های ترکیبی عصبی در پیش بینی قیمت سهام: صنعت خودرو و قطعات

محل انتشار:

پنجمین کنفرانس بین المللی حسابداری و مدیریت و دومین کنفرانس کارآفرینی و نوآوری های باز (سال: 1395)

تعداد صفحات اصل مقاله: 14

نویسندگان:

فهیمة ایروانی قلعه سرخ - کارشناس ارشد حسابداری، دانشگاه آزاد اسلامی، واحد نیشابور

مهدی صالحی - استادیار دانشگاه فردوسی مشهد

خلاصه مقاله:

در پژوهش حاضر، به بررسی دقت مدل های ترکیبی شبکه های عصبی در پیش بینی قیمت سهام پرداخته شده است چارچوب مدل های بکار رفته ترکیبی از الگوریتم ژنتیک و نقشه تودسازماندهی، ترکیب رگرسیون بردار پشتیبان و نقشه خود سازماندهی ترکیب الگوریتم جغرافیای زیستی و شبکه عصبی پرسپترون چندلایه و ترکیب نقشه تودسازماندهی و شبکه عصبی پس انتشار خطا می باشد متغیرهای مستقل در این پژوهش شاتصهای تکنیکی و متغیر وابسته قیمت سهام می باشد، بدین منظور شاخصهای تکنیکی برای شرکت های صنعت خودرو و قطعات به مدت 6 سال (بازه زمانی 1385 الی 1391) محاسبه شده است نتایج نشان دهنده این است که مدل ترکیبی الگوریتم جغرافیای زیستی و شبکه عصبی پرسپترون چندلایه نسبت به سایر مدل های از دقت بالاتری در پیش بینی قیمت سهامبرخوردار می باشد

کلمات کلیدی:

شبکه های عصبی، شاتصهای تکنیکی، الگوریتم جغرافیای زیستی، الگوریتم نقشه خودسازماندهی، رگرسیون بردار پشتیبان

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/501020>

