

عنوان مقاله:

پیش بینی سری های زمانی مالی با استفاده از مدل ARMA- GARCH-GRNN

محل انتشار:

چهاردهمین کنفرانس سالانه انجمن کامپیوتر ایران (سال: 1387)

تعداد صفحات اصل مقاله: 7

نویسندگان:

ساسان حسینعلی زاده - دانشکده ریاضی دانشگاه صنعتی امیرکبیر

رضا صفا بخش - دانشکده ریاضی دانشگاه صنعتی امیرکبیر

خلاصه مقاله:

مدل های خطی ARMA و GARCH دارای کاربردهای زیادی در زمینه پیش بینی سری های زمانی می باشند. همچنین مطالعات و تحقیقات اخیر در زمینه کاربردهای شبکه GRNN برای پیش بینی سری های زمانی نشان می دهد که این شبکه دارای کارایی مناسبی برای مدل نمودن سری های خطی و غیرخطی می باشد. در این مقاله مدل جدید ترکیبی مدل های مذکور ، با نام مدل ARMA-GARCH-GRNN معرفی می شود. در مدل پیشنهادی، ابتدا اطلاعات آماری سری زمانی توسط مدل ARMA-GARCH استخراج می گردد و سپس از شبکه GRNN برای مدل کردن رابطه غیرخطی مشاهدات سری زمانی استفاده می شود. در نهایت کارایی مدل جدید نسبت به مدل های ARMA-GARCH و GRNN مقایسه می شود.

کلمات کلیدی:

پیش بینی ، شبکه GRNN ، سری های زمانی، مدل ARMA ، مدل GRACH

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/60936>

