

## عنوان مقاله:

تشخیص الگو با استفاده از ماشین بردار پشتیبان در نمودارهای کنترل برای پایش فرآیندهای مالی GARCH (مطالعه موردی: نرخ تبادل ارزی دلار به ریال)

## محل انتشار:

سیزدهمین کنفرانس بین المللی مهندسی صنایع (سال: 1395)

تعداد صفحات اصل مقاله: 10

## نویسندگان:

محمدهادی دودرودیان - دانشجوی دکتری مهندسی صنایع، دانشکده فنی مهندسی، دانشگاه یزد

محمد صالح اولیاء - عضو هیات علمی (دانشیار) گروه مهندسی صنایع، دانشگاه یزد

حجت الله صادقی - استادیار گروه مدیریت بازرگانی، دانشکده مدیریت، اقتصاد و حسابداری، دانشگاه یزد

امیرحسین امیری - دانشیار گروه مهندسی صنایع، دانشکده فنی مهندسی، دانشگاه شاهد

## خلاصه مقاله:

تصمیم گیری بر اساس تغییرات در شاخص های مالی یکی از موضوعات مهم در اقتصاد می باشد. در سالهای اخیر استفاده از نمودارهای کنترل برای کمک به تصمیم گیری در فرآیندهای مالی مورد توجه محققان بوده است. علیرغم تحقیقات گسترده در زمینه تشخیص الگو در نمودارهای کنترل، تحقیقات در مورد فرآیندهای خودهمبسته محدود به مدل های ARIMA بوده است. در این مقاله، روشی بر پایه ماشین بردار پشتیبان برای تشخیص الگوی تغییرات در فرآیندهای مالی با مدل سری زمانی GARCH ارائه شده است. عملکرد روش پیشنهادی با استفاده از مطالعات شبیه سازی، بر اساس معیارهای متوسط طول دنباله و درصد تشخیص درست الگو، مورد ارزیابی قرار گرفته است. نتایج نشان دهنده توانایی روش پیشنهادی با متوسط طول دنباله مناسب و درصد بالای تشخیص درست میباشد. در پایان، از روش پیشنهادی برای تشخیص الگوی تغییرات در نرخ تبادل ارزی دلار به ریال استفاده شده است.

## کلمات کلیدی:

فرآیندهای مالی، مدل سری زمانی GARCH، نمودار کنترل، تشخیص الگو، ماشین بردار پشتیبان، نرخ تبادل ارزی

## لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/648602>

