

عنوان مقاله:

مدل سازی و پیش بینی قیمت بنزین با استفاده از شبکه عصبی gmdh

محل انتشار:

فصلنامه پژوهش های اقتصادی ایران، دوره 12، شماره 36 (سال: 1387)

تعداد صفحات اصل مقاله: 23

نویسندگان:

حمید ابریشمی - استاد دانشکده اقتصاد دانشگاه تهران

علی معینی - دانشیار گرایش الگوریتم ها و محاسبات گروه علوم مهندسی پردیس دانشکده های فنی دانشگاه تهران

محسن مهرآرا - استادیار دانشکده اقتصاد دانشگاه تهران

مهدی احراری - پژوهشگر موسسه تحقیقات اقتصادی دانشگاه تهران

خلاصه مقاله:

در این پژوهش از شبکه عصبی GMDH مبتنی بر الگوریتم ژنتیک به عنوان ابزاری با قابلیت بالا در مدل سازی سیستم های غیر خطی پویای پیچیده برای پیش بینی قیمت بنزین با دو روش قیاسی و قواعد تحلیل تکنیکی استفاده کرده ایم متغیرهای ورودی در روش قیاسی شامل تمام عوامل موثر درون و برون سیستمی بر قیمت بنزین و در روش تحلیل تکنیکی شامل میانگین های متحرک کوتاه و بلند مدت است نتایج نشان دهنده دقت بیش از 96 درصد پیش بینی و پایداری روش قیاسی و بیش از 99 درصد تحلیل تکنیکی است اثر روز دوشنبه به عنوان یک معیار تحلیل تکنیکی در روش قیاسی تایید شده است همچنین در مقیاس معیارهای خطا دقت پیش بینی های شبکه عصبی GMDH به طور معناداری از الگوی رگرسیونی بهتر است

کلمات کلیدی:

شبکه عصبی GMDH، قیمت بنزین، الگوریتم ژنتیک، قیمت نفت، پیش بینی، مدل سازی، میانگین متحرک، تحلیل تکنیکی، روش قیاسی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/682113>

