

عنوان مقاله:

ارابه یک مدل هیبریدی فازی جهت پیش بینی بازده سهام با استفاده از شبکه عصبی فازی و الگوریتم کلونی مورچگان

محل انتشار:

دومین کنفرانس ملی محاسبات نرم (سال: 1396)

تعداد صفحات اصل مقاله: 8

نویسندگان:

سیدمصطفی میرغفاری - دانشجوی کارشناسی ارشد رشته مهندسی مالی دانشگاه خاتم

محمدعلی رستگار - استادیار گروه مهندسی مالی، دانشکده صنایع، دانشگاه تربیت مدرس، تهران، ایران

خلاصه مقاله:

همواره پیش بینی قیمت سهام از اهمیت خاصی برای فعالان بازار بورس برخوردار بوده و است. همچنین روش های پیش بینی مختلفی جهت این امر، ابداع و مورد استفاده قرار گرفته است. اما اغلب روش ها متغیرهای ورودی را ثابت در نظر می گیرند، در صورتیکه امکان دارد با عوض شدن سهم مورد پیش بینی یا تغییر زمان، دیگر آن متغیرها جهت پیش بینی قیمت، معنی دار نباشند و کارایی خود را از دست داده باشند. در این مقاله ابتدا با استفاده از الگوریتم NSGAI ابتدا تعداد بهینه متغیرهای ورودی توسط خبره، انتخاب می گردد و سپس بهترین متغیرهای ورودی با استفاده از الگوریتم کلونی مورچگان انتخاب، و در نهایت قیمت سهام با استفاده از الگوریتم فازی عصبی تخمین زده می شوند و در نهایت با استفاده از تکنیکی تحت عنوان شبکه عصبی فازی سازگار adaptive anfis، قیمت های پیش بینی شده تعدیل می شوند

کلمات کلیدی:

پیش بینی قیمت سهام، الگوریتم کلونی مورچگان، شبکه عصبی فازی، ant، anfis، adaptive anfis، colony، NSGAI

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/696674>

