

عنوان مقاله:

بررسی توان پیش بینی کنندگی روش های محاسباتی نوین در بازار بورس

محل انتشار:

کنفرانس ملی اندیشه های نوین و خلاق در مدیریت، حسابداری مطالعات حقوقی و اجتماعی (سال: 1397)

تعداد صفحات اصل مقاله: 10

نویسندگان:

ناصر شهنساری - دانشجوی کارشناسی ارشد حسابداری، واحد الکترونیکی تهران، دانشگاه آزاد اسلامی تهران، ایران

هدی همتی - استاد دانشگاه، گروه حسابداری، واحد الکترونیکی تهران، دانشگاه آزاد اسلامی تهران، ایران

علی باغانی - استاد دانشگاه، گروه حسابداری، واحد الکترونیکی تهران، دانشگاه آزاد اسلامی تهران، ایران

خلاصه مقاله:

در این مقاله سعی بر این است تا با استفاده از سه مجموعه داده از قیمت سهام در سه بازه زمانی سریع، متوسط و کند؛ مشخص نماییم که کدام یک از مدل های شبکه های عصبی LoLiMoT، RBF، بهترین برآورد و پیش بینی را از قیمت آینده سهام در هر یک از مجموعه داده ها ارائه خواهند نمود و برای نیل به این هدف از دو معیار خطای MSE و RMSE استفاده شده و در نهایت با مقایسه این خطاها بهترین مجموعه جهت استفاده در پیش بینی ها را مشخص نموده ایم، جهت تجزیه و تحلیل داده های مورد آزمون نیز از نرم افزار MATLAB استفاده شده است و در نهایت با بررسی نمودارهای مستخرج از نرم افزار و جدول مقایسه آماری مشخص گردید که در هر سه از مجموعه داده ها مدل شبکه عصبی LoLiMoT تقریب بهتری از آینده را ارائه می نماید و قدرت پیش بینی کنندگی بهتری را از مدل RBF داراست.

کلمات کلیدی:

پیش بینی، شبکه های عصبی LoLiMoT، RBF

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/824800>

