

عنوان مقاله:

یک شبکه عصبی مصنوعی منظم بیزی برای پیش بینی بازار سهام

محل انتشار:

فصلنامه حسابداری و منافع اجتماعی، دوره 6، شماره 4 (سال: 1395)

تعداد صفحات اصل مقاله: 16

نویسندگان:

محمود لاری دشت بیاض - استادیار و عضو هیئت علمی گروه حسابداری - دانشگاه فردوسی مشهد

شعبان محمدی - کارشناسی ارشد ریاضی - کارشناسی ارشد حسابداری - دانشگاه حکیم سبزواری و موسسه آموزش عالی حکیم نظامی قوچان

خلاصه مقاله:

در این مقاله شبکه مصنوعی عصبی تنظیم شده بیزی به عنوان یک روش جدید برای پیش بینی وضعیت مالی بازار پیشنهاد داده شده است. قیمت روزانه بازار و شاخص های فنی مالی به عنوان ورودی برای پیش بینی یک روز بعد قیمت سهام فردی بسته شده، استفاده شده است. پیش بینی حرکت قیمت سهام به طور کلی بعنوان یک کار چالش برانگیز و مهم برای تجزیه و تحلیل سری های زمانی مالی در نظر گرفته می شود. پیش بینی دقیق حرکات قیمت سهام می تواند نقش مهمی در کمک به سرمایه گذاران برای بهبود بازده سهام بازی کند. پیچیدگی در پیش بینی این روند در اختلال ذاتی و بی ثباتی در حرکت روزانه قیمت سهام نهفته است. شبکه های منظم بیزی یک ماهیت احتمالی به وزن های شبکه اختصاص داده، اجازه می دهد شبکه به طور خودکار و بهینه مدل های بیش از حد پیچیده را جریمه کند. روش پیشنهادی بطور بالقوه نیاز بیش از حد به برازش و آموزش را کاهش داده و کیفیت پیش بینی و تعمیم شبکه را ارتقا می دهد. آزمایش با سهام شرکت های ایران خودرو و سایپا به منظور تعیین اثربخشی مدل انجام شد. دلیل این انتخاب جذابیت صنعت خودرو برای فعالان بازار سرمایه است، زیرا نرخ بازدهی آن نسبت به شاخص کل بورس و شاخص کل صنعت بالاتر است.

کلمات کلیدی:

شبکه منظم شده بیزی، شبکه عصبی مصنوعی، پیش بینی قیمت سهام

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/884732>

