

عنوان مقاله:

پیش بینی نرخ ارز یورو به دلار با تکنیک شبکه عصبی مصنوعی

محل انتشار:

مهندسی مالی و مدیریت اوراق بهادار، دوره 9، شماره 37 (سال: 1397)

تعداد صفحات اصل مقاله: 15

نویسندگان:

شفق شریف مقدم - دانش آموخته کارشناسی ارشد رشته مدیریت بازرگانی، گروه مدیریت بازرگانی، دانشکده مدیریت، دانشگاه آزاد اسلامی واحد تهران مرکز، تهران، ایران

سیدذبیح اله هاشمی - استادیار گروه مدیریت صنعتی، دانشگاه آزاد اسلامی، واحد تهران مرکزی، تهران، ایران

خلاصه مقاله:

پیش بینی نرخ ارز به عنوان یک متغیر اقتصادی مهم مورد علاقه فعالان اقتصادی است. یکی از رویکردهای متداول در پیش بینی، رویکرد تکنیکال است که از رفتار گذشته نرخ ارز برای پیش بینی استفاده می کند. البته با توجه به ساختار آشوب گونه و غیر خطی بازارهای مالی، نمی توان با یک روش مشخص و ساده که از ترکیب ابزارهای مختلف تکنیکال بدست می آید به پیش بینی بازار پرداخت و نیاز به روش های پیچیده تری می باشد. در دهه اخیر شبکه های عصبی به عنوان یکی از پرکاربردترین روش ها در زمینه طبقه بندی، تشخیص الگو و پیش بینی سری های زمانی پیچیده مورد استفاده قرار گرفته است. در این تحقیق یک مدل شبکه عصبی چندلایه جهت پیش بینی نرخ ارز یورو به دلار ارایه می شود که با بهره گرفتن از داده ها و متغیرهای برگرفته شده از تحلیل تکنیکال به پیش بینی قیمت در روز آینده با دقت مطلوب می پردازد. نتایج بیانگر عملکرد مناسب این روش در مقابل سایر روش های متداول تحلیل تکنیکال و شبکه عصبی می باشد.

کلمات کلیدی:

شبکه عصبی، پیش بینی نرخ ارز، تحلیل تکنیکال

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/958544>

