

عنوان مقاله:

مقایسه بازده خرید و فروش مبتنی بر نماگرهای تکنیکی و منطق فازی و روش ترکیبی الگوریتم ژنتیک - منطق فازی

محل انتشار:

مهندسی مالی و مدیریت اوراق بهادار, دوره 6, شماره 24 (سال: 1394)

تعداد صفحات اصل مقاله: 14

نویسندگان:

رضا راعی - گروه مالی و بیمه - دانشگاه تهران

سیدفرهنگ حسینی

خلاصه مقاله:

بازده بیشتر هدف اصلی سرمایه گذاران در بازارهای مالی است. در بازار ایران با توجه به ناکارایی بازار، تحلیل تکنیکال به عنوان یکی از روش های خرید و فروش کاربرد دارد. در این تحقیق با استفاده از نماگرهای تحلیل تکنیکی و روش تصمیم گیری منطق فازی و بهینه سازی و تصمیم گیری روش ترکیبی فازی ژنتیک برای تصمیم گیری خرید و فروش استفاده شده است. دوره بررسی از ابتدای سال 1387 تا پایان سال 1391 بوده و 4 سال آموزش و یک سال آزمون (تست) بوده است. نمونه شامل 50 شرکت فعال بورس بوده اند. نمونه براساس عملکرد نماگرهای تکنیکی در دوره تست، فیلتر شدند. شرکت هایی به عنوان نمونه نهایی انتخاب گردیدند که رتبه بازده نماگرهای تکنیکی آن ها طی سال های آموزش تفاوت معنی داری نداشتند. بدین ترتیب براساس اطلاعات تاریخی و دوره آموزش نماگرهای مناسب برای کسب بازدهی بیشتر تعیین و در روش فازی براساس قواعد معاملاتی متعارف و در روش فازی ژنتیک براساس یادگیری قواعد معاملاتی استخراج و خرید و فروش با توجه به قدرت سیگنال انجام شد. نتایج این تحقیق نشان داد که روش فازی و فازی ژنتیک بازده بیشتر و معنی داری نسبت به روش خرید و نگهداری دارد.

کلمات کلیدی:

نماگر تکنیکی، منطق فازی، الگوریتم ژنتیک، الگوریتم ترکیبی، خرید و نگهداری

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/958682>

