

عنوان مقاله:

ارزیابی عملکرد ساختارهای ترکیب سری و موازی به منظور پیش بینی و مدل سازی سری های زمانی مالی

محل انتشار:

شانزدهمین کنفرانس بین المللی مهندسی صنایع (سال: 1398)

تعداد صفحات اصل مقاله: 13

نویسندگان:

مهدی خاشعی - استادیار، دانشکده مهندسی صنایع و سیستمها دانشگاه صنعتی اصفهان؛

زهرا حاجی رحیمی - دانشجوی دکتری، دانشکده مهندسی صنایع و سیستمها دانشگاه صنعتی اصفهان؛

خلاصه مقاله:

ترکیب مدل‌های مختلف از پرکاربردترین استراتژی‌های ممکن به منظور بهبود دقت پیش‌بینی‌های مالی است. در حالت کلی تکنیک‌های ترکیب مدل‌های تکی را میتوان به دو دسته سری و موازی تقسیم بندی نمود. هدف نهایی تمامی این روشها استفاده از ویژگیهای خاص هر یک از مدل‌های تکی در مدل سازی ساختارهای پیچیده موجود در داده ها و به ویژه بهبود دقت پیش‌بینی ها است. با وجود مزایای منحصر به فرد مدل‌های ترکیبی، نحوه ترکیب مدل‌های تکی و به عبارت دیگر معرفی یک متد ترکیب کارا در پیش‌بینی های مالی موضوعی مبهم در ادبیات موضوع میباشد. لذا در این مقاله به منظور انتخاب روش ترکیب برتر، عملکرد مدل‌های ترکیبی سری و موازی مدل‌های خودرگرسیون میانگین متحرک انباشته و شبکه عصبی پرسپترون چندلایه در پیش‌بینی سربهای زمانی مالی با یکدیگر مقایسه گردیده اند. نتایج به دست آمده در پیش‌بینی قیمت سهام شاخص های شنزن چین و نیکی ژاپن بیانگر آن است که مدل‌های ترکیبی سری به طور کلی نتایج دقیق تری را نسبت به مدل‌های موازی ارائه میدهد.

کلمات کلیدی:

مدل‌های ترکیبی، ساختار ترکیب موازی، ساختار ترکیب سری، شبکه عصبی مصنوعی، مدل خودرگرسیون میانگین متحرک انباشته، پیش‌بینی قیمت سهام

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1034965>

