



دانشگاه شهید بهشتی و علوم کامپیوتر

دانشگاه شهید بهشتی
دانشکده مهندسی و علوم کامپیوتر



اطلاعیه دفاع

نام دانشجو: علی توسلیان		نام استاد راهنما: جناب آقای دکتر مجتبی وحیدی اصل سرکار خانم دکتر منیره عبدوس	
مقطع: کارشناسی ارشد		رشته: مهندسی کامپیوتر	
نوع دفاع:		تاریخ: ۱۴۰۲/۰۶/۲۱	
<ul style="list-style-type: none"> • دفاع پروپوزال <input type="checkbox"/> • دفاع پایان نامه <input checked="" type="checkbox"/> • دفاع رساله دکترا <input type="checkbox"/> 		ساعت: ۱۲:۳۰	
		مکان: کلاس ۱۱۷	
عنوان: یک مدل جدید برای نرم افزارهای معامله گر الگوریتمی در بازارهای مالی			
داوران خارجی: جناب آقای دکتر اکبر اصفهانی پور		داوران داخلی: جناب آقای دکتر احمد علی آبین	
<p>چکیده: از دیرباز یافتن راه حلی موثر برای افزایش سودآوری در بازارهای مالی مورد توجه محققان و سرمایه گذاران بوده است. طی سال های اخیر با توجه به سرعت و دقت مناسب نرم افزارهای معامله گر الگوریتمی، استفاده از این ابزارها در میان محققان و معامله گران رونق یافته است. در این پژوهش، یک مدل نرم افزاری جدید برای نرم افزارهای معامله گر الگوریتمی با استفاده از ابزارهای یادگیری عمیق پیشنهاد شده است. در ابتدا بر اساس امواج حرکتی قیمت که از اصول پایه تحلیل تکنیکال در بازارهای مالی است، یک بازنمایی از داده های خام ارائه شده است. متعاقباً، هشت ویژگی کلیدی از امواج حرکتی قیمت استخراج شده است. در راستای ایجاد مجموعه داده های بسط پذیر، مقادیر بر اساس میانگین محدوده صحیح هر دارایی تجزیه و تحلیل شده است. در بخش تحلیل گر مدل نرم افزاری، از شبکه های عصبی عمیق به عنوان ابزار تحلیلی استفاده گردیده است. برای دستیابی به نتایج بهتر، شبکه عصبی تحلیل گر تکنیکال معرفی گردید. این شبکه عصبی توانایی انجام وظایف گوناگون را دارا است. علاوه بر این در سایر بخش های مدل پیشنهادی ابزارهایی برای مدیریت ریسک و مقابله با نوسانات ناگهانی در نظر گرفته شده است. در پایان عملکرد روش پیشنهادی در بازارهای مختلف و بازه های زمانی متفاوتی مورد پس آزمون قرار گرفته است. نتایج حاصل با روش های توسعه داده شده توسط سایر پژوهشگران مقایسه گردید و بررسی ها نشان دهنده بهبود چشم گیری در دقت، سودآوری و میزان ریسک است. در نتیجه، مدل نرم افزاری معرفی شده به عنوان یک رویکرد نوین در تحلیل و انجام معاملات در بازارهای مالی توانسته است عملکرد بهتری نسبت به سایر روش های موجود داشته باشد.</p>			