

به نام خدا

دانشگاه تهران

دانشکده علوم مهندسی

معاملات الگوریتمی

نیمسال

اول ۱۴۰۳-۴۰۴

مهلت

تمرین سری اول

تحويل: ۴ آبان

از بین سهم های

پرداخت	مپنا	آلتون	فملی	شپنا
خوساز	بیوتیک	داسوه	سآبیک	بوعلی

دو مورد را به دلخواه انتخاب کنید.

۱- با استراتژی میانگین متحرک و با دوره های کوتاه و بلند مختلف روی دوره ۲ یا ۵ ساله (بسته به سهم انتخاب شده) بک تست بگیرید و نتایج را تحلیل کنید و نهایتا دوره مناسب را برای هر سهم پیشنهاد دهید.

۲- با استفاده از رگرسیون خطی و با طول دوره های مختلف قیمت دو سهم فوق را روی ۲۰ درصد از مجموعه داده پیش بینی کنید و با مقایسه mape دوره مناسب را مشخص کنید.

موفق باشید