

신경망을 이용한 주가예측시스템

신 기영*, 김 종수*

*한양대학교 대학원 산업공학과

Add : 경기도 안산시 대학동 396

한양대학교 산업공학과

Tel : 0345-400-5268

Fax : 0345-409-2423

주가예측분야는 변동이 심할 뿐만 아니라 변동의 시점을 정확히 판단하는 것이 어렵기 때문에, 문제의 성격상 기존의 예측방법으로는 필요한 정보를 얻기가 어렵다. 주가예측은 투자결정으로 인한 이익창출과 직접적인 관계를 가지고 있기 때문에, 정확한 예측방법의 개발이 무엇보다 중요하다.

본 논문에서는 이층 은닉층 구조의 신경망을 이용하여 주가를 예측하는 시스템을 제시하고, 실제데이터에 대한 수행결과를 기존의 예측방법과 비교함으로써 수행도를 평가한다. 비교를 통해 제안된 시스템이 기존의 방법보다 정확한 예측이 가능하고, 주가에 영향을 미칠 수 있는 여러가지 요소를 고려할 수 있는 장점이 있음을 평가한다.