

## عنوان مقاله:

ارائه مدل پیش بینی ریسک ورشکستگی مالی شرکت های بورسی و فرابورسی با بهره گیری از الگوریتم های یادگیری ماشین

## محل انتشار:

فصلنامه تحلیل بازار سرمایه, دوره 2, شماره 2 (سال: 1401)

تعداد صفحات اصل مقاله: 22

## نویسندگان:

محسن عالی - دانشجوی دکتری مدیریت صنعتی دانشگاه آزاد اسلامی واحد رودهن، ایران

سید علیرضا میرعرب بایگی - عضو هیات علمی دانشگاه آزاد اسلامی واحد رودهن، ایران

نیما فرجیان - مدرس دانشگاه کاشان، ایران

## خلاصه مقاله:

ورشکستگی یا شکست کسب و کار می تواند تاثیر منفی هم روی خود شرکت و هم اقتصاد جهانی داشته باشد. در این پژوهش ارائه پیش بینی ریسک ورشکستگی مالی شرکت های بورسی و فرابورسی با بهره گیری از الگوریتم های یادگیری ماشین صورت گرفته است، که در آن هدف پیش بینی نهایی ریسک ورشکستگی مالی شرکت های بورسی و شرکت های فرابورسی است. یادگیری جمعی، حوزه ای از یادگیری ماشین هست که در آن به جای اینکه از یک مدل برای حل یک مسئله استفاده کنند، از چندین مدل به صورت ترکیبی استفاده می کنند تا توان تخمین خروجی مدل را بالاتر ببرند. هر مدل با بهره گیری از ویژگی های بهینه مورد آموزش مجدد قرار می گیرد. در نتیجه دقت پیش بینی مدل یادگیری ماشین به روش Stacking که یکی از قوی ترین تکنیک های یادگیری جمعی است، برای پیش بینی ریسک ورشکستگی مالی از روش های مشابه بالاتر است.

## کلمات کلیدی:

جنگل تصادفی، رگرسیون لجستیک، ورشکستگی مالی، یادگیری جمعی، یادگیری ماشین

## لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1594430>

