

عنوان مقاله:

ارائه مدلی هوشمند برای پیش بینی ورشکستگی شرکت های صنعتی ایرانی با استفاده از تکنیک برنامه نویسی ژنتیک خطی

محل انتشار:

اولین همایش بین المللی اقتصاد سنجی، روشها و کاربردها (سال: 1391)

تعداد صفحات اصل مقاله: 15

نویسندگان:

الهام سادات مصطفوی - دانشجوی کارشناسی ارشد، دانشکده مهندسی صنایع و سیستم ها، دانشگاه صنعت

حمیدرضا فیلی - استادیار، دانشکده فنی مهندسی، دانشگاه الزهرا، تهران

خلاصه مقاله:

ورشکستگی یک مسئله مهم جهان شمول است که رفاه اقتصادی کشورها را تحت تأثیر قرار می دهد. پیش بینی ورشکستگی یکی از راه هایی است که با استفاده از آن می توان از فرصت های سرمایه گذاری به صورت مناسب بهره برداری و از به هدر رفتن منابع جلوگیری کرد. هدف اصلی این مطالعه ارائه مدلی جدید برای پیش بینی ورشکستگی شرکتهای صنعتی موجود در بورس اوراق بهادار تهران با استفاده از یکی از قدرتمندترین تکنیک های هوش مصنوعی به نام برنامه نویسی ژنتیک خطی می باشد. با استفاده از این تکنیک رابطه ای ساختاری بین وضعیت ورشکستگی شرکت های ایرانی و ع وامل مؤثر بر آن که نسبت های مالی شرکت ها می باشند برقرار شده است. برای مدلساز از اطلاعات مالی مربوط به مجموعه ای از شرکت های پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار تهران استفاده شده است. پارامترهای پیش بینی کننده ورشکستگی بر اساس مطالعه گسترده ادبیات فنی انتخاب شده اند. بر اساس نتایج بدست آمده، مدل ارائه شده با دقت بالایی شرکت های ورشکسته و غیر ورشکسته را تفکیک می نماید. نتایج مطالعه صورت گرفته نشانگر عملکرد بهتر مدل برنامه نویسی ژنتیک خطی در مقایسه با نتایج حاصل از مدل های موجود در ادبیات فنی است.

کلمات کلیدی:

ورشکستگی، هو مصنوعی، نسبت های مالی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/176332>

