

عنوان مقاله:

به کار گیری الگوریتم ژنتیک در توسعه تئوری پیش بینی ورشکستگی مالی (مطالعه موردی: شرکت های پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار تهران)

محل انتشار:

دومین کنفرانس ملی مهندسی صنایع و سیستم ها (سال: 1392)

تعداد صفحات اصل مقاله: 8

نویسندگان:

محسن حاجی امیری - گروه صنایع، دانشگاه آزاد اسلامی واحد زاهدان، زاهدان، ایران؛

محمد رضا شهرکی - استادیار گروه صنایع، دانشگاه سیستان و بلوچستان، زاهدان، ایران؛

سیدمسعود برکاتی - استادیار گروه برق الکترونیک، دانشگاه سیستان و بلوچستان، زاهدان، ایران؛

خلاصه مقاله:

مدل های پیش بینی ورشکستگی مدت هاست که به عنوان یکی از موضوعات مهم در حوزه مالی مطرح است. لذا در این پژوهش سعی شده است تا با بهره گیری از مدل الگوریتم ژنتیک به پیش بینی ورشکستگی شرکت ها پرداخته و همچنین از سوی دیگر با بکارگیری الگوریتم ژنتیک در توسعه تئوری ورشکستگی، راههای غلبه بر ضعف های روش های معمول پیش بینی ورشکستگی مورد بحث و بررسی قرار گیرد. نمونه تحت بررسی در این پژوهش شامل 07 جفت شرکت ورشکسته و غیر ورشکسته طی بازه زمانی 80-1390 است. با بررسی اطلاعات مستخرج از صورت های مالی شرکتهای مورد مطالعه در نهایت 5 متغیر مالی بعنوان متغیرهای مستقل جهت استفاده در مدل شناسایی گردید. نتایج این پژوهش نشان داد که استفاده از الگوریتم ژنتیک در پیش بینی ورشکستگی مالی بسیار موثر است بطوریکه این مدل توانست جهت پیش بینی صحیح ورشکستگی مالی شرکتهای به ترتیب در دوسال قبل از سال مبنا، یکسال قبل از سال مبنا و سال مبنا به دقتی معادل 96/44 و 97/94 و 95/53 درصد دست یابد

کلمات کلیدی:

ورشکستگی، پیش بینی ورشکستگی، تحلیل ممیزی چندگانه، رگرسیون لجستیک، شبکه عصبی، الگوریتم ژنتیک

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/251268>

