

عنوان مقاله:

کاربرد شبیه سازی مونت کارلو در مدیریت برآورد مالی سیستم های اقتصادی

محل انتشار:

کنفرانس ملی هزاره سوم و علوم انسانی (سال: 1394)

تعداد صفحات اصل مقاله: 25

نویسندگان:

حسین بدیعی - استادیار گروه مدیریت، دانشگاه آزاد اسلامی واحد قشم

آلا پگاه - دانشجوی کارشناسی ارشد مدیریت بازرگانی، دانشگاه آزاد اسلامی واحد قشم

خلاصه مقاله:

در فرآیند تحلیل و برآورد مالی یک سیستم اقتصادی، عوامل غیر قطعی متعددی دخالت دارند، لذا فرایند مالی و جریان نقدینگی این طرحها دارای پارامترهای با وضعیت عدم قطعیت بوده و برآورد مالی این پروژه ها همیشه دارای ریسک مخصوص به خود می باشند. در تحقیق حاضر امکان استفاده از روش شبیه سازی مونت کارلو که یک روش برای تولید اعداد تصادفی با توجه به تابع توزیع متغیرهای غیر قطعی می باشد بررسی شده و در واقع از یک روش پویا به همراه در نظر گرفتن تغییرات پارامترها با استفاده از تولید اعداد تصادفی و توابع توزیع احتمالی در برآورد مالی استفاده شده است. روش مونت کارلو یک روش شبیه سازی است که با در نظر گرفتن پویایی سیستم به پیش بینی تغییرات آینده آن پرداخته و این تغییرات را شبیه سازی می کند. متغیرها در این مطالعه توابع توزیع پارامترهای مختلف جدول فرایند مالی یا جریان نقدینگی خواهند بود که در هر مورد باید تابع توزیع مربوطه و نحوه تغییرات به دست آید. در واقع سوال های تحقیق شامل 1- آیا شبیه سازی مونت کارلو می تواند به نحو مطلوبی تغییرات را پیش بینی کند. 2- توابع توزیع هر یک از متغیرها چیست. 3- به ازای توابع توزیع به دست آمده تغییرات خروجی ها (مثلا درآمد خالص) به چه صورت خواهد بود. می باشد. در انتخاب جامعه آماری، از اطلاعات گذشته و حال (در صورت موجود بودن) متغیرهای دارای عدم قطعیت، برای پیش بینی آینده و به دست آوردن توابع توزیع و تولید اعداد تصادفی در شبیه سازی مونت کارلو استفاده می شود. بنابراین روش نمونه گیری مونت کارلو و تولید اعداد تصادفی و نحوه محاسبه آنها، استفاده از توابع توزیع خواهد بود. همچنین شیوه تجزیه و تحلیل استفاده از تکنیک مدل سازی و شبیه سازی مد نظر است.

کلمات کلیدی:

برآورد مالی، مدیریت، شبیه سازی مونت کارلو، سیستم اقتصادی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/399265>

