

عنوان مقاله:

پیش بینی ورشکستگی شرکت های پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار با استفاده از روش های شبکه عصبی مصنوعی و ماشین بردار پشتیبان

محل انتشار:

دومین کنفرانس بین المللی مهندسی صنایع و مدیریت (سال: 1395)

تعداد صفحات اصل مقاله: 20

نویسنده:

راضیه علیزاده - دانشجوی کارشناسی ارشد مهندسی صنایع

خلاصه مقاله:

در چند دهه اخیر، پژوهش های گسترده ای در زمینه پیش بینی ورشکستگی انجام گرفته و مدل های متفاوتی معرفی شده اند و اغلب این مدل ها دارای موفقیت های زیادی شده اند. با این وجود، عموماً به کارگیری مجدد این مدل ها برای مجموعه داده های متفاوت از داده های اولیه (داده های متفاوت از نظر زمانی و یا داده های مربوط به شرایط یا سیستم های اقتصادی متفاوت) نتوانسته اند موفقیت های پیشین را تکرار کنند. لذا یکی از الزامات مسائل اقتصادی، راه های پیشگیری از ورشکستگی و پیش بینی وقوع آن قبل از در معرض ورشکستگی قرار گرفتن و یا نمایان شدن علائم آشفتگی مالی می باشد. در این پژوهش سعی شده است به پیش بینی ورشکستگی بورس با استفاده از شبکه عصبی و ماشین بردار پشتیبان پرداخته شود. طبق بررسی ها مشخص شد که شبکه عصبی مصنوعی بیش از 0/9 و ماشین بردار پشتیبان بیش از 0/78 بر اساس متغیرهای ورودی می تواند احتمال ورشکستگی شرکت های بورس را پیش بینی نماید که این کارایی این مدل ها را نشان می دهد.

کلمات کلیدی:

ورشکستگی، شبکه عصبی، ماشین بردار پشتیبان، داده کاوی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/504527>

