

Лоан Тхи Ву, Лиен Тхи Ву, Нга Тху Нгуйен, Пхуонг Ти Туй До, Донг Пхуонг Дао

Аналіз методів вибору характеристик та методів вибірки для прогнозування фінансового краху для в'єтнамських лістингових компаній

Метою дослідження є поєднання впливу методів вибору показників, а також методів вибірки, з ефективністю моделі прогнозування фінансового краху для компаній, які мають лістинг акцій на фондових біржах В'єтнаму. Фінансовий крах компанії має місце в разі делістингу акцій за вимогою В'єтнамської фондової біржі через понесення збитків протягом 3 років або накопичення збитків, сума яких перевищує суму власного капіталу компанії. Існує 12 моделей, побудованих за різними методами вибору характеристик, методами вибірки та класифікаторами. Методами вибору характеристик є факторний аналіз та вибір F-показника, в той час як три вибірки даних було обрано за допомогою методу вибірки з різним процентним співвідношенням компаній, що зазнали фінансового краху. Що стосується методу класифікації, у вищезгаданих моделях було використано логістичну регресію разом з методом опорних векторів. Дані було зібрано від лістингових компаній у В'єтнамі за період з 2009 по 2017 рр. за 1, 2 і 3 роки до повідомлення з вимогою про делістинг. Результати аналізу свідчать про покращення показників у моделі на основі методу опорних векторів з методом вибору F-показника у вибірці даних, що включає в себе найбільший відсоток компаній, які не зазнали фінансового краху.

Ключові слова: прогнозування фінансового краху, вибір характеристик, метод вибірки, модель логістичної регресії, метод опорних векторів.

Класифікація JEL: G32, G33, G38.



Стаття знаходиться у відкритому доступі і може розповсюджуватися на умовах ліцензії [Creative Commons Attribution 4.0 International license](https://creativecommons.org/licenses/by/4.0/), що дозволяє необмежене повторне використання, розповсюдження та відтворення на будь-якому носії за умови наявності відповідного посилання на оригінальну версію статті.

Лоан Тхи Ву, Лиен Тхи Ву, Нга Тху Нгуйен, Пхуонг Ти Туй До, Донг Пхуонг Дао

Анализ методов выбора характеристик и методов выборки для прогнозирования финансового краха для вьетнамских листинговых компаний

Целью исследования является сочетание влияния метода выбора показателей, а также методов выборки, с эффективностью модели прогнозирования финансового краха для компаний, имеющих листинг акций на фондовых биржах Вьетнама. Финансовый крах компании имеет место в случае делистинга акций по требованию Вьетнамской фондовой биржи из-за понесения убытков в течение 3 лет или накопления убытков, сумма которых превышает сумму собственного капитала компании. Существует 12 моделей, построенных по разным методам выбора характеристик, методами выборки и классификаторами. Методами выбора характеристик являются факторный анализ и выбор F-показателя, в то время как три выборки данных были выбраны при помощи метода выборки с разным процентным соотношением компаний, потерпевших финансовый крах. Что касается метода классификации, в вышеупомянутых моделях была использована логистическая регрессия вместе с методом опорных векторов. Данные были собраны от листинговых компаний во Вьетнаме за период с 2009 по 2017 гг. за 1, 2 и 3 года до уведомления с требованием о делистинге. Результаты анализа свидетельствуют об улучшении показателей в модели на основе метода опорных векторов с методом выбора F-показателя в выборке данных, включающей в себя наибольший процент компаний, не потерпевших финансовый крах.

Ключевые слова: прогнозирование финансового краха, выбор характеристик, метод выборки, модели логистической регрессии, метод опорных векторов.

Классификация JEL: G32, G33, G38.



Статья находится в открытом доступе и может распространяться на условиях лицензии [Creative Commons Attribution 4.0 International license](https://creativecommons.org/licenses/by/4.0/), что позволяет неограниченное повторное использование, распространение и воспроизведение на любом носителе при условии наличия соответствующей ссылки на оригинальную версию статьи.