

Нурдан Дегірменчі, Туба Якічі Айан

Розподіл компаній за рейтингом фінансової діяльності за допомогою методу I-distance

Метою статті є розподіл компаній за рейтингом фінансової діяльності за допомогою статистичного методу I-distance, що дає можливість визначити місце в рейтингу та важливі фактори. З цією метою метод було використано у дослідженні 110 турецьких промислових компаній без розподілу за галузями і потім з розподілом за 7 різними галузями, а також було отримано різні результати про фірми, галузі та показники. Метод I-distance використовується для запобігання значній кореляції між показниками під час аналізу. Вибір методу I-distance зумовлений тим, що він дозволяє класифікувати показники в порядку їх важливості та виключити неважливі показники, а також врахувати кореляцію між показниками. Автори стверджують, що завдяки цим характеристикам цей метод переважає над іншими альтернативними методами. Ряд аналізів дає можливість визначити місце компаній у загальній вибірці та їх галузь. Більше того, цей метод дає цінну інформацію про важливі фактори оцінки фінансової діяльності компаній. В ході аналізу було виявлено, що коефіцієнт рентабельності є найбільш ефективним фактором розподілу компаній за рейтингом та їх відокремлення одна від одної, а показники ліквідності та фінансового левериджу не є ефективними взагалі. В ході аналізу з точки зору галузей, галузь добування неметалів, хімічна, нафтодобувна галузі та галузь з виробництва пластмаси знаходяться вище в рейтингу, ніж інші галузі.

Ключові слова: багатофакторний аналіз, I-distance, фінансова діяльність, рейтинг.

Класифікація JEL: C38, C44, G39.



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.

Нурдан Дегірменчи, Туба Якичи Айан

Распределение компаний по рейтингу финансовой деятельности при помощи метода I-distance

Целью статьи является распределение по рейтингу финансовой деятельности при помощи статистического метода I-distance, что дает возможность определить место в рейтинге и важные факторы. С этой целью метод был использован в исследовании 110 турецких промышленных компаний без распределения по отраслям и затем с распределением по 7 отраслям, а также были получены различные результаты о фирмах, отраслях и показателях. Метод I-distance используется для предотвращения значительной корреляции между показателями во время анализа. Выбор метода I-distance обусловлен тем, что он позволяет классифицировать показатели в порядке их важности и исключить неважные показатели, а также учесть корреляцию между показателями. Авторы утверждают, что благодаря данным характеристикам данный метод преобладает над другими альтернативными методами. Ряд анализов дает возможность определить место компаний в общей выборке и их отрасль. Более того, данный метод дает ценную информацию о важных факторах оценки финансовой деятельности компаний. В ходе анализа было выявлено, что коэффициент рентабельности является наиболее эффективным фактором распределения компаний по рейтингу и их отделения друг от друга, а показатели ликвидности и финансового левериджа не являются эффективными вообще. В ходе анализа с точки зрения отраслей, отрасль добытия неметаллов, химическая, нефтедобывающая отрасли и отрасль по производству пластмассы находятся выше в рейтинге, чем другие отрасли.

Ключевые слова: многофакторный анализ, I-distance, финансовая деятельность, рейтинг.

Классификация JEL: C38, C44, G39.



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.