

ОЦЕНКА СОСТОЯНИЯ И ПЕРСПЕКТИВ

РАЗВИТИЯ КОРПОРАЦИИ «Х»

В качестве объекта исследований при расчетах использовались фрагменты публикаций, содержащие упоминания условно названной корпорации «Х» за 8 месяцев 2010 года, начиная с января.

Сценарии задавались следующими текстами:

«Крах компании (снижение курса)»

«Рост напряженности вокруг компании и соответствующие колебания курса акций связаны со значительной переоценкой капитализации. Такая переоценка (раздутая капитализация) связана с политикой руководства, заинтересованного в расширении возможностей кредитования. Наиболее вероятно, что компания стоит на грани банкротства, предстоят расследования прокуратуры и других правоохранительных органов. В связи с этим ожидается падение курса акций как основной тренд»;

«Дружественное поглощение (рост курса)»

«Колебания курса акций компании, наиболее вероятно, связаны с подготовкой к смене собственников. Осуществлены мероприятия по снижению курса акций в интересах скупки пакета, позволяющего установить контроль над активами компании. Существующий менеджмент в рамках предварительных договоренностей не препятствует проведению такой смены собственников. Наиболее вероятно, что после перехода собственности акции компании будут демонстрировать устойчивый рост (следует ожидать положительного тренда)».

Все оценки проводились на интервале с 01.10 по 08.10 ежемесячно. В связи с тем, что практически по всем исследуемым факторам с 06.04 по 08.04 имеет место значимое изменение тенденций, дополнительно к годовому (ежемесячному) просчету были проведены оценки тенденций с 01.06.04 по 20.08.04 с дискретностью – «еженедельно».

Основной вывод

По результатам месячных расчетов на интервале с 01.10 по 08.10 были сформулированы следующие автоматизированные выводы. Графическое отображение развития исследуемой ситуации представлено на графиках ниже.

Обнаружено развитие ситуации в сторону аналога "Крах компании" (падение акций).

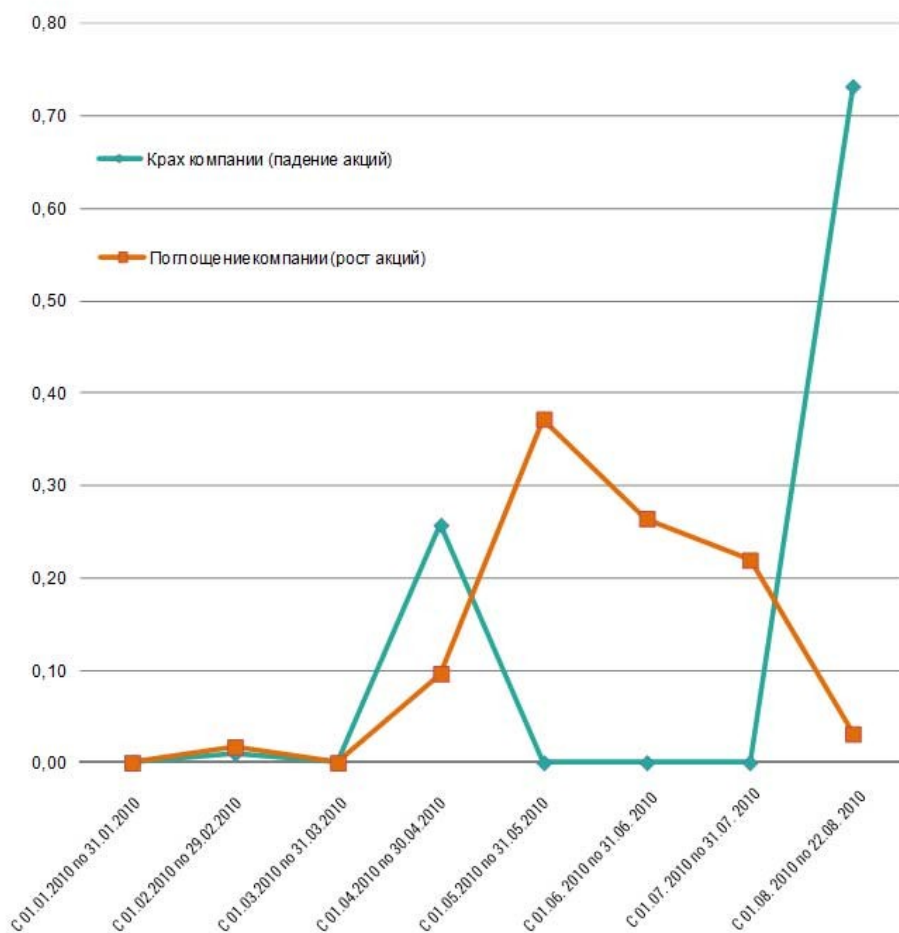
Прогнозируется усиление этой тенденции ("пик событий" еще не пройден)

Рейтинг значимости аналогов в порядке убывания "Крах компании" (падение курса акций).

Тенденция развития ситуации вокруг объекта исследования относительно аналога Крах компании (падение акций)"

- Ситуация вокруг объекта исследования развивается в сторону увеличения меры схожести с аналогом
- Отмеченная тенденция **ЗНАЧИМА**
- На интервале с 01.08.2010 по 22.08.2010 наибольшая схожесть ситуации наблюдается с данным аналогом
- Отмеченная тенденция изменения меры схожести будет усиливаться
- На интервале исследования ситуация значимо (с вероятностью более 80%) приближается к критически значимым в следующие моменты: с 01.04.2010 по 30.04.2010, с 01.08.2010 по 22.08.2010
- На интервале с 01.08.2010 по 22.08.2010 наибольшей является вероятностная мера схожести с данным аналогом

Мера схожести



Тенденция развития ситуации вокруг объекта исследования относительно аналога "Поглощение компании (рост акций)"

- Ситуация вокруг объекта исследования развивается в сторону снижения меры схожести с аналогом
- Отмеченная тенденция **ЗНАЧИМА**
- Отмеченная тенденция изменения меры схожести будет ослабляться
- На интервале исследования ситуация значимо (с вероятностью более 80%) приближается к критически значимым в следующие моменты: с 01.04.2010 по 30.04.2010, с 01.05.2010 по 31.05.2010

Центрированная мера схожести

