

OBSAH

Content	5
Zoznam tabuliek, obrázkov a kódov	7
Úvod.....	11
1. Teoretické východiská predikcie finančného zdravia podnikov.....	13
1.1. Životný cyklus podnikov	13
1.2. Finančné zdravie podniku.....	15
1.3. Diagnostika finančného zdravia	19
1.4. Vývoj ekonomického prostredia v SR	23
1.4.1. Klasifikácia nástrojov a metodologický aparát finančnej analýzy ex ante pri predikcii finančného vývoja podniku	25
1.4.2. Prehľad a vývoj vybraných nástrojov finančnej analýzy ex ante pri predikcii finančného vývoja podniku	34
2. Matematicko-štatistické metódy a softvérová báza na konštrukciu variantných modelov finančného zdravia podnikov	44
2.1. Dáta na konštrukciu variantných modelov finančného zdravia.....	44
2.1.1. Dátová množina reprezentujúca obdobie rokov 2002 – 2004.....	44
2.1.2. Dátová množina reprezentujúca obdobie rokov 2009 – 2010 a obsahujúca alternatívne definovanú premennú ohrozené finančné zdravie podniku.....	46
2.1.3. Dátová množina reprezentujúca obdobie rokov 2009 – 2013	47
2.2. Matematicko-štatistické metódy a softvérová báza na konštrukciu.....	48
2.2.1. Lineárna a kvadratická diskriminačná analýza.....	48
2.2.2. Logistická regresia a penalizovaná logistická regresia	49
2.2.3. Rozhodovací strom	51
2.2.4. Náhodný les	53
2.2.5. RE-EM stromy.....	53
2.2.6. Neurónové siete.....	57
2.2.7. Kombinovanie modelov	57
2.3. Kritériá hodnotenia klasifikačných modelov a interpretácia ich klasifikačnej schopnosti.....	58

3. Variantné modely finančného zdravia	67
4. Aplikácia na predikciu finančného zdravia podniku.....	94
Záver	109
Zoznam použitej literatúry	111
Summary	126