

Táto bakalárska práca obsahuje predstavenie, odvodenie a implementáciu rekurentnej metódy najmenších štvorcov. Metóda je analógiou klasickej metódy najmenších štvorcov pre lineárnu regresnú úlohu, pričom používa rekurzívny postup na aktualizáciu koeficientov. Cieľom tejto práce je predstavenie algoritmu rekurentnej metódy a oboznámenie sa s jej výhodami. Metódu využijeme na tri rôzne simulácie, v ktorých ukážeme jej vlastnosti a modifikácie. Taktiež metódu aplikujeme na odhady pri použití na reálne dáta v spojitosti s CAPM modelom.