

Tato práce se zabývá průběžným odhadováním závislosti modelů diskrétních veličin na náhodných veličinách, které mají diskrétní nebo spojitě rozdělení. Využívá se na to Bayesův vzorec, popsáný v první kapitole, kde je přidán předpoklad podmíněné nezávislosti, aby jej bylo možné používat dynamicky. Ve druhé kapitole je následně popsán aproximační algoritmus, pomocí kterého se průběžně aproximuje bayesovsky odhadnutá hustota náhodné veličiny. Celý tento postup je aplikován na speciální tvar modelu logistické regrese, popsáný ve třetí kapitole. Výsledek je dále ukázán na příkladech se simulovanými daty. Nakonec je model spolu s aproximačním mechanismem vyzkoušen aplikovat na obchodování s futures.