

Táto práca sa zaoberá problémom nájdenia najbližšej korelačnej matice k danej symetrickej matici, ktorých vzdialenosť je meraná vzhľadom ku Frobeniovej norme. Teoretická časť opisuje metódu pre nájdenie riešenia tohto problému na základe duálneho prístupu a aplikácie Newtonovej metódy. Ďalej je táto metóda modifikovaná pre iné prípady. V praktickej časti je teória aplikovaná na jednoduchých príkladoch.