

Tato práce se zabývá aplikacemi heteroagentních modelů (HAM) v oblasti finančních trhů. V první části práce je obecně vyložena metodologie HAM spolu s prezentací několika dřívějších modelů tak, aby získal čtenář obecnou představu o aplikacích HAM v oblasti finančních trhů. Dále podáváme popis původního modelu vyvinutého v Brock, Hommes (1998), dále navazujeme popisem jeho rozšíření představeného v Baruník, Vácha, Vošvrda(2009). V analytické části se věnujeme analýze chování rozšířeného modelu včetně jeho schopnosti simulovat stylizovaná fakta typická pro reálné finanční trhy. Práci zakončujeme shrnutím výsledků provedených experimentů a navržením případných témat pro budoucí vývoj modelu.