

## **Abstrakt**

Předkládaná práce se zabývá předpovídáním časových řad denní realizované volatility vybraných měnových párů EUR/USD, GBP/USD a USD/CHF, pomocí neuronových sítí. Jejich výsledky jsou porovnány s výsledky aktuálně populárního modelu HAR (Heterogenous Autoregressive) a již tradičních modelů ARIMA. Vedlejším produktem těchto snah je zdokonalení modelu HAR, které je nazváno HARD rozšířením. Po otestování jeho predikčních schopností je tento model dále použit jako referenční model pro testování neuronových sítí a modelu ARIMA.