

Tato diplomová práce se zabývá modelováním a predikcí objemu oběživa, která patří mezi hlavní autonomní veličiny ovlivňující likviditu trhu. v práci jsou objasněny potřeby jeho modelování a prezentovány tři zkonstruované stochastické modely. Jsou jimi ARIMA a GARCH model vycházející z Box-Jenkinsovy metodologie a STS model. STS model je strukturovaný model časové řady využívající Kalmanovy rekurze. Předpovědi jednotlivých modelů jsou dále kombinovány a statisticky porovnány. Výsledky ukazují, že nejvhodnějším modelem pro předpovídání objemu oběživa je kombinace STS a ARIMA modelu, který dosáhl stejné kvality předpovědi jako expertní doad používaný v ČNB. Lzde jej tedy použít přinejmenším jako podpůrný prostředek pro řízení likvidity v ČNB.