

Tato práce se zabývá detekcí změn parametrů v ekonometrických regresních modelech v situaci, kdy existuje stabilní trénovací množina pro počáteční odhad parametrů. Podrobně jsou prezentovány dva známé sekvenční testy – CUSUM test pro lineární regresní model a test založený na vážených reziduích pro autoregresní časovou řadu – včetně asymptotických vlastností za daných předpokladů. Pro malý počet pozorování jsou Monte Carlo simulacemi porovnány dva asymptoticky ekvivalentní odhady rozptylu a dále jsou prezentovány výsledky aproximací kritických hodnot bootstrapovými metodami pro oba zmiňované odhady rozptylu. Na závěr je test založený na vážených reziduích aplikován na historická data indexu S&P 500.