

V této diplomové práci zkoumáme vztah mezi výskytem strukturálních změn během daného časového období a odhadem parametru dlouhé paměti. Na základě procesů s přesně danými parametry simulujeme data a uměle upravujeme jejich střední hodnotu. Následně analyzujeme, jak se liší odhad parametru frakční integrace od jeho skutečné hodnoty. Zjistili jsme, že tento odhad je více nadhodnocený, pokud jsou strukturální změny seskupeny v čase. Tato chyba je ještě větší v případě, kdy jsou znaménka těchto strukturálních změn kladně korelovaná. Naopak záporná korelace nadhodnocení snižuje. Naše zjištění umožňují posílení odolnosti odhadu parametru frakční integrace vůči přítomnosti strukturálních změn.