

Abstrakt: Předložená práce se zabývá oblastí detekce změn ve slabě stacionárních vektorových autoregresních modelech. Obsahem práce je návrh testových statistik pro retrospektivní detekci změny v různých parametrech těchto modelů a zejména odvození jejich asymptotického rozdělení za nulové hypotézy, kdy předpokládáme neměnnost těchto parametrů. Testové statistiky jsou založeny na principu maximální věrohodnosti a odvozeny za předpokladu normality, nicméně asymptotické výsledky u těchto statistik jsou platné pro daleko širší třídu rozdělení a zahrnují i modely, kde se vyskytují konkrétní formy závislosti. Součástí práce jsou rovněž simulační studie, které ilustrují kvalitu dosažených výsledků.