

Práce se zabývá autokorelační strukturou časových řad, konkrétně i procesu AR(1). Je odvozen odhad rozptylu výběrových autokorelací a jsou dokázány jeho asymptotické vlastnosti. V simulační studii je generován normálně rozdělený bílý šum a AR(1). V těchto řadách zkoumáme rychlost konvergence odhadu rozptylu výběrových autokorelací. Dále vyšetřujeme empirickou hladinu a sílu některých testů nekorelovanosti časové řady.