

Tato práce se zabývá testováním normality časových řad u AR a ARMA procesů. Nejdříve je zde vyšetřeno chování běžných testů normality, které předpokládají nezávislost pozorování. Je zde hlavně zkoumáno dodržování hladiny a síly těchto testů v závislosti na vzdálenosti kořenů charakteristického polynomu AR procesů od jednotkového kruhu. Dále se tato práce obdobně zabývá testy, které nezávislost pozorování nepředpokládají. Omezíme-li se na AR procesy, můžeme testováním normality reziduí dostat dobré výsledky. U obecnějších testů můžeme také dostat dobré výsledky, ale tyto testy potřebují větší počet pozorování a jsou výpočetně náročnější.