

Cielom tejto práce je podať zrozumiteľný výklad niektorých najnovších metód odhadovania bodu zmeny. V literatúre môžeme nájsť rôzne prístupy k riešeniu tejto problematiky. Medzi ne patria testy založené na procese CUSUM, testy pomerom vierohodností, metóda WBS a metódy pre odhadovanie bodu zmeny v panelových dátach. Okrem spomínaných prístupov je v práci vysvetlený aj prípad závislých panelov. Praktická časť štúdie je zameraná na aplikáciu metódy WBS na týždenné logaritmické výnosy akciového indexu Dow Jones. Najskôr na analyzovaný časový rad aplikujeme GARCH model. Metódu WBS následne použijeme na detekciu štrukturálnych zmien v pôvodnom rade, ako aj v rezíduách z modelu GARCH. Analyzujeme niekoľko typov penalizačných kritérií a skúmame ich vplyv na odhadnutý počet a polohy bodov zmeny v danom dátovom súbore.