

OBSAH

Předmluva	5
1. Základní vlastnosti systému RATS	7
1.1 Zásady ovládání systému	8
1.2 Struktura programu v systému RATS	12
1.3 Definice a používání kalendáře	15
1.4 Dimenzování délky časových řad	16
1.5 Časové údaje a jejich označování	17
1.6 Vstup časových řad do modelu	18
1.7 Výpočty základních statistických charakteristik	20
1.8 Transformace časových řad (základní možnosti)	23
1.9 Aritmetické a logické výrazy	24
1.10 Výstup časových řad	27
1.11 Grafické znázornění časových řad	28
1.12 Lineární regrese	30
1.13 Výpočet vyrovnaných hodnot	35
1.14 Mazání hodnot časových řad	35
1.15 Výpočty se skalárními hodnotami, poli, řetězci	36
1.16 Zakončení programu	46
1.17 Chybová hlášení	47
1.18 Další rady pro používání systému	47
2. Transformace časových řad a další operace	51

3. Další typy regresních odhadů	63
3.1 Vynechání některých hodnot časových řad v regresi	63
3.2 Metoda vážených nejmenších čtverců (heteroskedasticita)	64
3.3 Odhady v případech autokorelace	65
3.4 Odhady v případech multikolinearity	68
3.5 Zpožděné proměnné a modely rozdělených zpoždění	70
3.6 Metoda dvoustupňových nejmenších čtverců	74
3.7 Nelineární jednorovnicové modely	77
4. Další možnosti programování v systému RATS	83
4.1 Příkazy cyklu	83
4.2 Podmíněné a skokové příkazy	86
4.3 Uživatelská menu	89
4.4 Procedury	89
5. Testování hypotéz	93
5.1 Testování heteroskedasticity	96
5.2 Testování autokorelace	97
6. Modely simultánních rovnic	100
6.1 Metoda třístupňových nejmenších čtverců	100
7. Predikce	108
Literatura	114