

Finanční časové řady

2003

opravy

str./řádek: H – horní, D – dolní	chybně	správně
58/9,10H	<p>Ize proces (2.121) přepsat do formy</p> $X_t = a_t + a_{t-1} + a_{t-2} + \dots + \sum_{i=0}^{\infty} a_{t-i} \quad (2.123)$	<p>za předpokladu počátku v čase $t = 0$ lze proces (2.121) přepsat do formy</p> $X_t = X_0 + a_1 + a_2 + \dots + a_t = X_0 + \sum_{j=1}^t a_j, \quad (2.123)$ <p>kde X_0 je počáteční podmínka.</p>
58/4-6D	<p>Potom jej lze vyjádřit ve formě</p> $X_t = X_0 + \sum_{j=1}^t a_j \quad (2.127)$ <p>Z této formy procesu vyplývá, že</p>	<p>Potom ze vztahu</p> $X_t = X_0 + \sum_{j=1}^t a_j \quad (2.127)$ <p>vyplývá, že</p>
75 vzorec (2.189)	$X_t = \pi_1 X_{t-1} + \pi_2 X_{t-2} + \dots + \pi_{T+h-1} X_{t-p^*} + a_t$	$X_t = \pi_1 X_{t-1} + \pi_2 X_{t-2} + \dots + \pi_p^* X_{t-p^*} + a_t$
86/3D	Robinson (1992)	Robinson (1994)
97 vzorec (2.296)	$\hat{\sigma}_{\pi}(q) = T^{-1} \sum_{t=1}^T \hat{u}_t^2 + 2T^{-1} \sum_{q=1}^j w_j(q) \sum_{t=q+1}^T \hat{u}_t \hat{u}_{t-q}$	$\hat{\sigma}_{\pi}(q) = T^{-1} \sum_{t=1}^T \hat{u}_t^2 + 2T^{-1} \sum_{j=1}^q w_j(q) \sum_{t=q+1}^T \hat{u}_t \hat{u}_{t-q}$
163/17,18H	$X_t = a_t + a_{t-1} + a_{t-2} + a_{t-3} + \dots, \quad (4.4)$ <p>takže nepodmíněná střední hodnota je nulová, ...</p>	$X_t = X_0 + \sum_{j=1}^t a_j \quad (4.4)$ <p>Je-li $X_0 = 0$, potom je nepodmíněná střední hodnota nulová,</p>
218/12H	ROBINSON, P.M. (1992)	ROBINSON, P.M. (1994)