Moderní metody modelování ekonomických časových řad
1999

opravy

str./řádek: H – horní, D – dolní	chybně	správně
20/1H	$k = 1, 2, \ldots$	$k = 1, 2, \ldots, T$-1
20/4,6,8H	T^1	T^{-1}
20/6H	$\hat{D}(r_k) = T^{-1}(1 + 2r_1^2 + \ldots + 2r_{k--1}^2)$	$\hat{D}(r_k) = T^{-1}(1 + 2r_1^2 + \ldots + 2r_{k-1}^2)$
20/9H	$2\,\hat{D}(r_k)^{-1/2}$	$2\left[\hat{D}(r_k)\right]^{1/2}$
20/6D	potom	potom pro $k > p$
21/3H	pro zpoždění k.	pro zpoždění k a pro $T = 100$.
32/1H	**ŘÁDU *P* [AR(*P*)]**	**ŘÁDU *p* [AR(*p*)]**
33/16H	Box a Jenkins (1976)	Box a Jenkins (1970)
33/14D	pro $j > 0$	pro $j > 1$
53/1H	$D(H(X_t)) =$	$D(H(X_t)) \cong$
53/5H	$D(X_t) = c^2\mu_t^2$	$D(X_t) = c\mu_t^2$
53/7H	$T(\mu_t) = \ldots$	$H(\mu_t) = \ldots$
55/1,2D	Protože minulé veličiny … střední hodnotu, tj. …	Za předpokladu, že …
56/13D	$D[X_T(h)]$	$D[X_T(h) \mid X_T, X_{T-1}, \ldots]$
56/7D	… se od určitého horizontu přestane rozšiřovat.	… se limitně blíží ke dvěma horizontálně paralelním přímkám.
56/5D	… neustále rozšiřuje.	… rozšiřuje neomezeně.
62/6H	Budeme-li předpokládat $\boldsymbol{Z} = (Z_1, \ldots, Z_T)'$ a počáteční …	Budeme-li značit $\boldsymbol{Z} = (Z_1, \ldots, Z_T)'$ a předpokládat počáteční …
62/17D	Tyto odhady jsou …	Tyto odhady $(\hat{\boldsymbol{\phi}}, \hat{\boldsymbol{\theta}})$ jsou …
62/9D	… odhad rozptylu $\hat{\sigma}^2$ …	… aproximaci maximálně věrohodného odhadu rozptylu nesystematické složky …
63/11H	σ_e^2	$\sigma_e^2 = \sigma_a^2$
63/5D	… odhad rozptylu …	… aproximaci maximálně věrohodného odhadu rozptylu …
67/4D	… lze zapsat jako …	… lze zapsat [Lütkepohl (1993), str. 86] jako

74/6D	(4.18a, b, c)	(4.27a, b, c)
85/1H	T a k	T a K
89/6D, 90/13H	ACI	AIC
98/13H	**[SAR(*p*)]**	**[SAR(*P*)]**
101/10D	$X_t = \sum_{j=1}^{4} c_j D_{jt} + a_t - \Theta_1 a_{t-4} \ldots$	$X_t = \sum_{j=1}^{4} c_j^* D_{jt} + a_t - \Theta_1 a_{t-4} \ldots$
101/3D	… jestliže $\mid \Theta_1 \mid < 1$…	… jestliže $\mid \Phi_1 \mid < 1$ …
106/3H	Obr. 5.4b)	Obr. 5.5b)
126/4H	$t + k$	$t - k$
135/11,10D	$\boldsymbol{I}_l - \theta_1 B - \theta_2 B^2 - \ldots - \theta_p B^p$	$\boldsymbol{I}_l - \theta_1 B - \theta_2 B^2 - \ldots - \theta_q B^q$
139/14D	$\alpha_{11} \neq m_{11}$ a $\alpha_{12} \neq m_{12}$	$\alpha_{11} \neq m_{11}$ nebo $\alpha_{12} \neq m_{12}$
140/4H	$\boldsymbol{D}(B)$	$[\boldsymbol{D}(B)]^{-1}$
140/9D	…aby existovaly operátory $\boldsymbol{D}(B)$, …	… aby neexistovaly jiné operátory než $\boldsymbol{D}(B)$, …
158/12D	.. predeterminovaný, neboť $E(Y_{t-1}a_{1t-i}) \neq 0$ pro $i = 2, 3, \ldots$.	…predeterminovaný v čase t, neboť $E(Y_{t-1}a_{1t-i}) \neq 0$ pro i=1, 2, … .
159/3H	$\theta_{q,ij}(B) = \boldsymbol{0}$	$\theta_q(B) = \boldsymbol{I}_l$
159/8H	… jsou predeterminované.	… jsou v čase t predeterminované.
163/12,10D	$\boldsymbol{Y}_t^e = -[\dot{\phi}_{p,11}(B) + \boldsymbol{I}_m]\boldsymbol{Y}_t + \ldots$	$\boldsymbol{Y}_t^e = [-\dot{\phi}_{p,11}(B) + \boldsymbol{I}_m]\boldsymbol{Y}_t + \ldots$
165/5H	$E(Z_t a_t) = 0$	$E(Z_t a_{t+i}) = 0$ pro všechna i
166/3H	Spanos(1985)	Spanos(1986)
167/3D	$D(a_{1t}) = \sigma_v$	$D(v_{1t}) = \sigma_v$
189/8H	$\mid \lambda \boldsymbol{I}_l + \boldsymbol{S}_p^{-1} \hat{\boldsymbol{B}}_2' \boldsymbol{A}_{22.1} \hat{\boldsymbol{B}}_2 \mid = 0$	$\mid \lambda \boldsymbol{I}_l - \boldsymbol{S}_p^{-1} \hat{\boldsymbol{B}}_2' \boldsymbol{A}_{22.1} \hat{\boldsymbol{B}}_2 \mid = 0$
190/12D	$H_0^M: \phi_2 = \boldsymbol{0}_{l\times l}$ proti $H_1^M: \phi_2 \neq \boldsymbol{0}_{l\times l} \mid \phi_M = \ldots = \phi_3 = \boldsymbol{0}_{l\times l}$	$H_0^M: \phi_1 = \boldsymbol{0}_{l\times l}$ proti $H_1^M: \phi_1 \neq \boldsymbol{0}_{l\times l} \mid \phi_M = \ldots = \phi_2 = \boldsymbol{0}_{l\times l}$
212/3D	Johansen (1996)	Johansen (1992)
216/15H	… redukovaný tvar.	… strukturní tvar.
224/4H	$E(s'^2) = \sigma_u^2 (\sum_{i=1}^{T} m_{ii} \lambda_i^2)/(T-n)$.	$E(s'^2) = \sigma_u^2 (\sum_{i=1}^{T} m_{ii} \lambda_i^2)/(T-n)$, kde m_{ii} jsou diagonální prvky matice $\boldsymbol{M}$.
228/7,8,9,11,13H,4D, 229/13H	d	n
229/4,5H	…je dána kritickými hodnotami …	… je dána párem přímek, které vedou skrze body …
229/6H	$\pm a_1 (T-n)^{-1/2} \{(T-n) + 2(t-n)\}$	$\{n, \pm a_1 (T-n)^{1/2}\}$ a $\{T, \pm 3a_1 (T-n)^{1/2}\}$
229/9H	… hodnot W_t a tolerančních mezí daných těmito kritickými hodnotami …	…bodů $\{t, W_t\}$ a tolerančních mezí daných těmito hodnotami …
229/15,14D	Kritické hodnoty tohoto testu jsou dány vztahem …	Toleranční meze tohoto testu jsou dány párem přímek …
245/1H	$\phi_1 = (\rho_1, \rho_2, \ldots, \rho_l)\boldsymbol{I}_l$	$\phi_1 = \mathrm{diag}\{\rho_1, \rho_2, \ldots, \rho_l\}$

266/6H	t	t - 2
269/4-10H, 270/7H	$\boldsymbol{\mu} = \gamma\boldsymbol{\beta}_0$	$\boldsymbol{c} = \gamma\boldsymbol{\beta}_0$
271/16D	$h(\boldsymbol{R}_i'\boldsymbol{\beta}) = l$-1, i = 1, …, l	$h(\boldsymbol{R}_i'\boldsymbol{\beta}) = r$-1, i = 1, …, r
283/5,9,13 H	$T(\hat{\rho})$	$T\hat{\rho}$
283/9D	$Z(t(\rho))$ = …	$Z(t(\hat{\rho}))$ = …
289/9H	ENGLE, R. F. (ed). (1984)	ENGLE, R. F. (ed). (1995)

str. 68 dole, 69 nahoře:

… [viz Nelson, Granger (1979)].

Odhad parametru λ je však výpočetně poměrně náročná operace, proto se v praxi velmi často dává přednost jednodušším metodám hledání vhodné transformace časových řad. Následující tabulka obsahuje nejčastěji používané hodnoty λ s odpovídajícími transformacemi vycházejícími ze vztahů $H(X_t) = X_t^{\lambda}$ pro $\lambda \neq 0$, $H(X_t) = \ln X_t$ pro $\lambda = 0$ (mocninná transformace).

Tab. 4.2 *Hodnoty λ s odpovídajícími transformacemi*

Metoda volby hodnoty λ spočívá v tom, že se časová řada rozdělí na krátké úseky, které obsahují 4 až 12 pozorování. V každém úseku …

Poznámka [9)] na str. 75

$\phi_p(B) = (1 - \phi_1 B - \phi_2 B^2 - ... - \phi_p B^p) = \phi_p(1) + (1 - B)[\phi_1 + \phi_2(1 + B) + \phi_3(1 + B + B^2) + ... +$
$+ \phi_p(1 + B + B^2 + ... + B^{p-1})] = \phi_p(1) + (1 - B)[(\phi_1 + \phi_2 + ... + \phi_p) + (\phi_2 + \phi_3 + ... + \phi_p)B + ... +$
$+ \phi_p B^{p-1}]$. Obsahuje-li proces (4.28) jeden jednotkový kořen, potom $\phi_p(1) = 0$ [Enders (1995), str. 34], proto $\phi_p(B) = (1 - B)[1 - \phi_1^* B - \phi_2^* B^2 - ... - \phi_{p-1}^* B^{p-1}] = (1 - B)\phi_{p-1}^*(B)$,

kde $\phi_1^* = -\phi_2 - \phi_3 - ... - \phi_p$, $\phi_2^* = -\phi_3 - \phi_4 - ... - \phi_p$, ..., $\phi_{p-1}^* = \phi_p$ [detailněji viz Hatanaka (1996)].

str. 82, Tab. 4.5 ve sloupci PACF:

Omezená exponenciálním nebo oscilačním poklesem

Omezená exponenciálním nebo exponenciálně sinusoidním poklesem

Omezená exponenciálním a/nebo exponenciálně sinusoidním poklesem

Od zpoždění 1 omezená exponenciálním nebo oscilačním poklesem

Od zpoždění (p-q) omezená exponenciálním nebo exponenciálně sinusoidním poklesem

str. 155, Obr. 9.1:

X1 na X1	X1 na X2	X1 na X3
X2 na X1	X2 na X2	X2 na X3
X3 na X1	X3 na X2	X3 na X3

V seznamu literatury chybí:

BARTLETT, M. S. (1946): On the Theoretical Specification of Sampling Properties of Autocorrelated Time Series, J. Royal Stat. Soc., B8, 27-41

ENGLE, R. F. – GRANGER, C. W. J. (ed.) (1991): Long-Run Economic Relationships, Readings in Cointegration, Oxford University Press

NANKERVIS, J. C. – SAVIN, N. E. (1987): Finite Sample Distributions of *t* and *F* Statistics in an AR(1) model with an Exogenous Variable, Econometric Theory, 3, 387-408