

Errata k skriptám

EKONOMETRICKÉ MODELOVANIE V PROGRAMOCH EVIIEWS A GRETL

autori: Martin Lukáčik – Adriana Lukáčiková – Karol Szomolányi

Kapitola 7

– str. 192

Krátkodobý multiplikátor autoregresného modelu predstavujúci okamžitú reakciu závislej premennej na jednotkovú zmenu vysvetľujúcej premennej sa zhoduje s modelom s rozloženým oneskorením. Opäť ho predstavuje parameter δ_0 . Reakcia závislej premennej na jednotkovú zmenu vysvetľujúcej premennej oneskorená o 1 obdobie sa vypočíta ako $\delta_0\gamma_1$. Reakcia oneskorená o 2 obdobia sa vypočíta ako $\delta_0(\gamma_1^2 + \gamma_2)$. Reakcia oneskorená o 3 obdobia sa vypočíta ako $\delta_0(\gamma_1^3 + 2\gamma_1\gamma_2 + \gamma_3)$ atď.

Spočítaním reakcií pre k období získame súhrnnú reakciu závislej premennej na jednorazovú zmenu vysvetľujúcej premennej po k obdobiach, ktorá sa nazýva *priebežný multiplikátor k-teho obdobia*. Celkovú reakciu, ktorú predstavuje *dlhodobý multiplikátor*, vypočítame za predpokladu stability modelu podľa vzťahu:

$$\delta_0 / (1 - \gamma_1 - \gamma_2 - \dots - \gamma_p). \quad (0.1)$$

Spojením modelov (7.2) a (7.10) s vylúčením opakujúcich sa členov dostaneme autoregresný model s rozloženým oneskorením rádu (p, q) , ktorý má tvar:

$$y_t = \beta_0 + \gamma_1 y_{t-1} + \gamma_2 y_{t-2} + \dots + \gamma_p y_{t-p} + \delta_0 x_t + \delta_1 x_{t-1} + \dots + \delta_q x_{t-q} + u_t. \quad (7.12)$$

– str. 193

Krátkodobý multiplikátor autoregresného modelu s rozloženým oneskorením predstavujúci okamžitú reakciu závislej premennej na jednotkovú zmenu vysvetľujúcej premennej predstavuje parameter δ_0 . Reakcia závislej premennej na jednotkovú zmenu vysvetľujúcej premennej oneskorená o 1 obdobie sa vypočíta ako $\delta_0\gamma_1 + \delta_1$. Reakcia oneskorená o 2 obdobia sa vypočíta ako $\delta_0(\gamma_1^2 + \gamma_2) + \delta_1\gamma_1 + \delta_2$. Reakcia oneskorená o 3 obdobia sa vypočíta ako $\delta_0(\gamma_1^3 + 2\gamma_1\gamma_2 + \gamma_3) + \delta_1(\gamma_1^2 + \gamma_2) + \delta_2\gamma_1 + \delta_3$ atď.