

TSP について

Excel は表計算ソフト。

TSP (Time Series Processor) は統計学・計量経済学用ソフト。回帰, シミュレーションが簡単。
主なコマンド。

1. データの種類

freq 期種;

例: freq a; 年次データ (Annual data)
freq q; 四半期データ (Quarterly data)
freq m; 月次データ (Monthly data)
freq n; 非時系列データ (Non-time series data)

2. 期間の設定

smp1 始期 終期;

例: smp1 1982 1993;
smp1 1980:2 1991:4;

3. データの読み込み

read 変数名リスト;

read(file=' ファイル名 ') 変数名リスト;

例: read I GDP r;
read(file='z:invest.txt') I GDP r;

load というコマンドと全く同じ。

4. データの表示

print 変数名リスト;

例: print I;
print I GDP r;

5. データの変換

変数名 = 算術式;

例: RI=NI/PI;
LI=log(I);
GGDP=100*(GDP-GDP(-1))/GDP(-1);
X=A**2;

6. データのグラフ

plot 変数名 記号 変数名 記号 ...;

graph 変数名 (横軸) 変数名 (縦軸) 変数名 (縦軸) ...;

例： plot A + B *;
plot X * Y + Z x;
plot I # GDP .;

例： graph GDP I;
graph r I;

7. 最小自乗法

olsq 被説明変数 c 説明変数 説明変数 ...;

olsq 被説明変数 説明変数 説明変数 ...;

例： olsq I c GDP;
olsq I c GDP r;

注) “c” は定数項を意味する。

8. 予測値

forcst 変数名;

例： forcst iest;

直前の “olsq” で計算された被説明変数の推定値（直線上の値）が計算される。