
ACTFIT 実際の系列名 予測された系列名 ;

機能 :

ACTFIT は、系列の実績値と計算値から、様々な適合度を表す統計量を計算し、プリントします。タイル (H. Theil) (以下の参考文献にある) は、推定された時系列方程式や予測式の評価にこれらの統計量を用いることを提案しています。

使用法:

ACTFIT の直後に、実際のデータ系列、次に計算値を含む系列変数を指定します。

例:

```
ACTFIT R RS ;
```

アウトプット:

ACTFIT は、タイトル、比較する系列名、標本期間とともにいくつかの統計量を出力します。このなかには 2 つの系列間の相関係数、平均平方誤差、平均絶対誤差、タイルの不一致係数 (U)、両系列間の乖離の原因の分解: 平均の差や分散の差などが含まれます。注意: U は 1961 年と 1966 年の文献では異なって定義されています。1966 年の定義は TSP のバージョン 4.0 と 4.1 で用いられており、この定義では U は 1 よりも大きくなる場合があります。TSP バージョン 4.2 以降では、U の両方のバージョンがプリントされます。この統計量が出力された後、PLOTS オプション (OPTIONS コマンドを参照) が指定されていれば、実績値と計算値のグラフが出力されます。RESID オプションが指定されていれば、PLOTS オプションの指定に関係なく、残差系列が @RES という名前で保存されます。

参考文献:

Theil, Henri, **Applied Economic Forecasting**, North Holland Publishing Company, 1966, pp.27-33.

Theil, Henri, **Economic Forecasts and Policy**, North Holland Publishing Company, 1961.