
TSTATS (NAME=(名前のリスト) 係数ベクトル
分散-共分散行列 ;

機能 :

TSTATS は名前, 係数, 標準誤差, t-統計量, そして (UNSUPRES なら) 分散-共分散行列の表をプリントします. TSTATS は, 対角要素の平方根をとったり, 結果の見やすいプリントを作成するのが難しいので分散-共分散行列の独自の推定量を計算するときに役に立ちます.

使用法 :

最も簡単な形は, TSTATS に続けて一組の係数の推定値のベクトル名とその係数の推定された共分散行列を含む対称行列名をかきます. 係数ベクトルが $N \times 1$ なら行列の次元は N です. NAME オプションによって表の係数にラベルを便宜的につけることができます.

オプション :

NAMES=係数名のリスト. 既定値は単に係数 1,2, 等という数字です.

例 :

例えば, 非線形回帰に用いる PDL 変数をいちいち作り, それから回帰係数とその共分散行列を (PDL 変換行列を使って) 分解するとします. 推定されたラグ係数は BETA と呼ばれ, その共分散行列推定値は VARB です. 対応する t-統計量の推定値の表は次のコマンドでプリントされます :

```
TSTATS (NAME=(BETA0-BETA7)) BETA VARB ;
```

アウトプット :

回帰係数, 等の表は SUPRES されていなければプリントされます. @RNMS, @COEF@SES, と @VCOV が保存されます.