

Domácí úloha - data

Z dat národních účtů, která jste zpracovávali na cvičení (Problem set 4, část Measurement) si vyberte poválečné období.

1. Odhadněte cyklické odchylky (gapy) jednotlivých veličin pomocí HP filtru, použijte vyhlazovací konstantu pro roční data ($\lambda = 100$). Před filtrací veličiny zlogaritmujte. Pro čistý export pracujte s podílem čistého exportu na GNP (tuto veličinu už nelogaritmujte). Vykreslete cyklické složky každé veličiny společně s cyklem GNP.
2. Spočítejte (nezpožděný) koeficient korelace gapu příslušné veličiny s gapem GNP.
3. Vypočítejte směrodatnou odchylku gapu každé veličiny.