

# אקונומטריקה ב

פרק 9 - סיכום מתאם סדרתי והטרוקדסטיות

תוכן העניינים

1. כללי ..... 1

## סיכום מתאם סדרתי והטרוקדסטיות:

רקע:

| הטרוסקדסטיות                                              | מתאם סדרתי                                                                           |                           |
|-----------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------|
| $Y_t = \alpha + \beta X_t + u_t$ למשל:                    |                                                                                      | המשוואה העיקרית של המודל  |
| $V(u_t) = \sigma^2$                                       | $\text{cov}(u_t, u_{t-s}) = 0$                                                       | ההנחה הקלאסית המופרת      |
| $V(u_t) = \sigma_t^2$                                     | $\text{cov}(u_t, u_{t-s}) \neq 0$                                                    | המצב לאחר ההפרה           |
| $V(u_t) = W_t \sigma^2$                                   | $u_t = \rho u_{t-1} + \varepsilon_t$                                                 | המשוואה המאפיינת את ההפרה |
| מתקבלים אומדים חסרי הטיה ועקיבים, אך תכונת היעילות נפגעת. |                                                                                      | מה קורה אם אומדים OLS-ב   |
| מבחן GQ<br>מבחן White                                     | מבחן DW<br>מבחן LM                                                                   | זיהוי הבעיה               |
| שיטת WLS                                                  | שיטת קוקרן – אורקוט<br>(רגרסיית ההפרשים)<br>הכנסת משתנה מוסבר בפיגור<br>(מודל דינמי) | פתרון הבעיה               |