# אקונומטריקה

## פרק 13 - הטרוסקדסטיות

### תוכן העניינים

1. כללי ..... 1

# הטרוסקדסטיות:

## רקע:

הטרוסקדסטיות הוא מצב שבו מופרת הנחת ההומוסקדסטיות, הגורסת כי שונות הטעויות היא אותה שונות עבור כל תצפית ותצפית: $V(u_t)=\sigma^2$ לכל $t$, כלומר התצפיות מפוזרות באופן אחיד סביב קו הרגרסיה.
במצב של הטרוסקדסטיות שונות הטעויות של כל תצפית היא שונה: $V(u_t)=\sigma_t^2$.

### ההשלכות של הטרוסקדסטיות על אומדי OLS:

בהינתן הטרוסקדסטיות מופרת תכונת היעילות של אומדי הריבועים הפחותים שכן בכדי לחשב שונות יעילה של האומדים השתמשנו בהנחה של שונות קבועה.

### מבחנים לזיהוי הטרוסקדסטיות:

החשד לקיומה של בעיית הטרוסקדסטיות בנתונים צריך להתעורר כאשר אנו בוחנים את גרף השאריות – באיזה אופן השונות של הטעויות משתנה בין תצפית לתצפית.
שיטות לזיהוי הטרוסקדסטיות: מבחן GQ (Goldfeld-Qauandt) ומבחן White.
מבחן GQ מניח כי במקום שונות אחת אחידה של הטעויות לכל התצפיות, קיימות שתי שונויות שונות בלבד. ואילו מבחן White מניח כי לכל תצפית ותצפית שונות שונה של טעויות.

1. מבחן GQ:
   ההנחה העומדת בבסיס מבחן זה היא כי קיימות שתי שונויות שונות של טעויות.
   ביצוע המבחן:
   - מחלקים את המדגם לשני חלקים:
     1. החלק שבו אנו חושדים שיש שונות גבוהה יותר.
     2. החלק שבו אנו חושדים שיש שונות נמוכה יותר.

   מקובל להשמיט מס' תצפיות (בין 1/6 ל-1/3) במרכז המדגם.

   - אומדים כל אחד מהחלקים בנפרד ומקבלים את ה-ESS של כל חלק.
   - מחשבים את הסטטיסטי: $F_{stat}=\frac{ESS_1/T_1-K-1}{ESS_2/T_2-K-1}$ (תמיד השונות הגבוהה חלקי הקטנה).

- סטטיסטי זה מתפלג: $F_{(\alpha;T_1-K-1,T_2-K-1)}$.
- כלל ההכרעה: אם $F_{stat} > F_C$ אז דוחים את $H_0$.
- ההשערות: $\begin{matrix} H_0:\sigma_1^2=\sigma_2^2 \\ H_1:\sigma_1^2>\sigma_2^2 \end{matrix}$.

2. מבחן White:

ההנחה העומדת בבסיס מבחן זה כי לכל תצפית ותצפית שונות שונה של טעויות. הביטוי המתמטי של הנחה זו היא היותה של השונות פונקציה ליניארית של כל המשתנים המסבירים, ריבועיהם והאיברים הצולבים:

$$\sigma_t^2 = f\left(x_j, x_j^2, x_j x_j\right)$$

$$\sigma_t^2 = \alpha_0 + \alpha_1 x_1 + \ldots + \alpha_k x_k + \beta_1 x_k^2 + \ldots + \beta_k x_k^2 + \gamma_{12} x_1 x_2 + \gamma_{13} x_1 x_3 \ldots$$

האומד ל- $\sigma_t^2$ הוא $\hat{u}_t^2$.

המבחן הוא מבחן LM:

- אומדים את המודל המקורי ומקבלים את הסטיות מקו הרגרסיה $\hat{u}_t$ (המכונה בתוכנה הסטטיסטית RES-SAS).
- אומדים את $\hat{u}_t^2$ כפונקציה ליניארית של כל המשתנים המסבירים, ריבועיהם והאיברים הצולבים: $\hat{u}_t^2 / x_j, x_j^2, x_j x_j$ זוהי רגרסיית העזר.
- נחשב את סטטיסטי LM: $LM_{stat} = T_y \cdot R_y^2$.
- אם $LM_{stat} > \chi_m^2$ כאשר, $m$ = מס' המשתנים ברגרסיית העזר.

השערות: $\begin{matrix} H_0:\alpha_j=\beta_j=\gamma_{jj}=0 \\ H_1:OTHERWISE \end{matrix}$.

**פיתרון בעיית ההטרוסקדסטיות – ריבועים פחותים משוקללים (WLS):**

נניח שאנו רוצים לאמוד את המודל: $Y_t = \alpha + \beta X_t + u_t$ וידוע כי לכל קריזה שונות אחרת. ההנחה שעומדת בבסיס שיטת ה-WLS היא כי השונות המשתנה כוללת בתוכה מרכיב קבוע ומרכיב משתנה: $\sigma_t^2 = Z_t \cdot \sigma^2$ את המרכיב המשתנה בשונות $(Z_t)$ יש לנטרל. לשם כך ניצור משתנה חדש – $W_t$ שיהווה השורש ההופכי לאותו מרכיב משתנה: $W_t = \frac{1}{\sqrt{Z_t}}$.

נכפיל כל תצפית במשתנה החדש $W_t$ וניצור משוואה שהיא קומבינציה ליניארית של

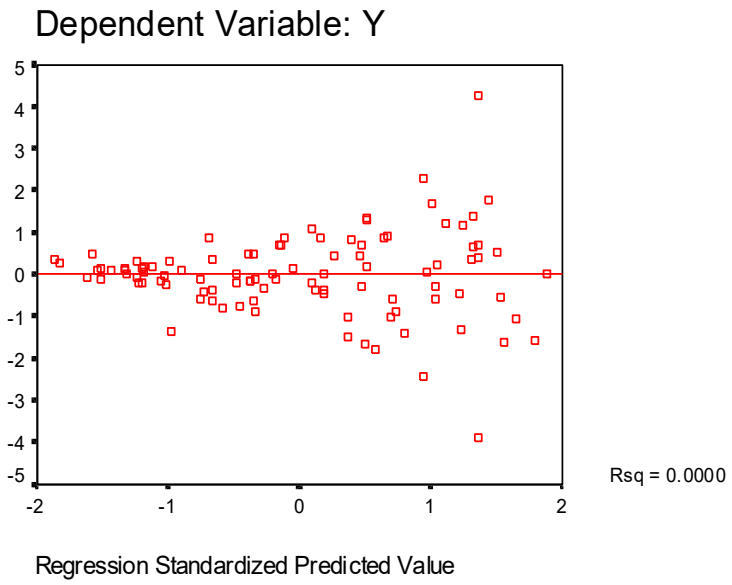
המשוואה המקורית:
$$Y_t = \alpha + \beta X_t + u_t$$
$$Y_t W_t = \alpha \cdot W_t + \beta\left(X_t W_t\right) + u_t W_t$$

בצורתה המפורשת המשוואה החדשה נראית כך: $\frac{Y_t}{\sqrt{Z_t}} = \alpha \cdot \frac{1}{\sqrt{Z_t}} + \beta \cdot \frac{X_t}{\sqrt{Z_t}} + \frac{u_t}{\sqrt{Z_t}}$.

## שאלות:

### מבחן GQ:

**1)** נאמד הקשר שבין הכנסה לתצרוכת: $Y_t = \alpha + \beta X_t + u_t$.
גרף השאריות של הרגרסיה הנ"ל נתון להלן:




מגרף זה אנו למדים כי השונות איננה אחידה סביב קו הרגרסיה אלא תלויה ברמת ההכנסה – זהו מצב של הטרוסקדסטיות.
בכדי לבצע מבחן GQ:

- התצפיות של משתנה ההכנסה סודרו מהגדול לקטן והמדגם חולק לשלוש קבוצות שוות.
- רגרסיה נפרדת הורצה על השליש הראשון ועל השליש האחרון.

התוצאות של אמידת הקשר בין הכנסה לתצרוכת מוצג בפלטים 1 ו-2 בהתאמה:

**משוואה (1)**

```
The REG Procedure
Model: MODEL1
Dependent Variable: y

Number of Observations Read         16
Number of Observations Used         16

Analysis of Variance

                            Sum of            Mean
Source          DF         Squares          Square    F Value    Pr > F
  Model
Error           14           166452.9
Corrected Total
```

**משוואה (2)**

```
The REG Procedure
Model: MODEL1
Dependent Variable: y

Number of Observations Read         16
Number of Observations Used         16

Analysis of Variance

                            Sum of           Mean
Source          DF          Squares         Square    F Value    Pr > F
Model
Error           14        2934638
Corrected Total
```

האם יש עדות לקיום הטרוסקדסטיות בנתונים? (בצעו את המבחן המתאים: רשמו השערות, חשבו סטטיסטי מבחן, רשמו כלל הכרעה והגיעו למסקנה).

**2)** על מנת לבחון את פונקציית הייצור בענף מסוים נאספו נתונים על 150 פירמות. נסמן:

$Q$ - תפוקה שנתית באלפי שקלים.

$L$ - מספר עובדים.

המודל הנאמד: $\ln(Q)=\alpha+\beta\cdot\ln(L)$.

החוקר חשש שההפרעה המקרית איננה הומוסקדסטית. לשם כך הוא מיין את התצפיות בסדר עולה של מספר העובדים, השמיט $\frac{1}{3}$ מהתצפיות האמצעיות והריץ שתי רגרסיות נפרדות עם מספר שווה של תצפיות:

ברגרסיה הכוללת את הערכים הנמוכים יחסית של תשומת העבודה הוא

קיבל: $R^2 = 0.403$ , $ESS = 279.3$ .

ברגרסיה הכוללת את הערכים הגבוהים יחסית של תשומת העבודה הוא

קיבל: $R^2 = 0.238$ , $ESS = 493.8$ .

האם יש עדות לקיום הטרוסקדסטיות בנתונים? (בצעו את המבחן המתאים: רשמו השערות, חשבו סטטיסטי מבחן, רשמו כלל הכרעה והגיעו למסקנה).

**מבחן WHITE:**

**3)** על אותו הקשר שבין הכנסה לתצרוכת: $Y_t = \alpha + \beta X_t + u_t$ .

שאנו חושדים על פי גרף השאריות כי קיים בו מצב של הטרוסקדסטיות.

בכדי לבצע את מבחן WHITE:

- נחשב את השאריות של הרגרסיה: $\hat{u}_t = Y_t - \hat{Y}_t$ .
- נעלה את השאריות בריבוע: $\hat{u}_t^2$ .
- נאמוד את המשוואה: $\hat{u}_t^2 = \alpha_0 + \alpha_1 X_t + \beta_1 X_t^2 + v_t$ .

תוצאות האמידה מוצגות להלן:

```
                    The REG Procedure
                      Model: MODEL1
              Dependent Variable: RES2
        Number of Observations Read          48
        Number of Observations Used          48

                  Analysis of Variance
                       Sum of          Mean
Source        DF       Squares         Square     F Value     Pr > F
Model
Error
Corrected Total

             Root MSE                 R-Square     0.390763
             Dependent Mean           Adj R-Sq
```

בצעו מבחן White (השערות, סטטיסטי המבחן, כלל הכרעה ומסקנה).

**4)** חוקר מניח כי מכירות של חנות הן פונקציה של שיטחה, דמי שכירות והאפשרות של מכירת עיתונים.

נסמן:

$Y_SALES$ - מכירות חודשיות (₪).

$X1_SQUARES$ - שטח החנות (מ"ר).

$X2_RENT$ - דמי שכירות ($).

$PAPERS$ - משתנה איכותי המקבל 1 אם החנות מוכרת גם עיתונים ו-0 אם לא.

החוקר חשד כי קיימת בעיה של הטרוסקדסטיות בנתונים.

החוקר ביצע מבחן לזיהוי הטרוסקדסטיות שתוצאותיו נתונות להלן:

```
                    Dependent Variable:
              Number of Observations Read          20
              Number of Observations Used          20

             Analysis of Variance

                     Sum of          Mean
Source        DF     Squares         Square     F Value     Pr > F
Model
Error
Corrected Total
              Root MSE                R-Square     0.086942
              Dependent Mean         Adj R-Sq

              Parameter Estimates
                       Parameter      Standard
Variable        DF     Estimate       Error     t Value     Pr > |t|
Intercept
X1_SQUARE
X1_SQUARE^2
X1_SQUARE*X2_RENT
X2_RENT
X2_RENT^2
X2_RENT*PAPERS
 PAPERS
```

הרגרסיה המופיעה בפלט לעיל נועדה לבדיקת: _____.

על ידי מבחן: _____.

המשתנה התלוי הינו: _____.

המשתנים הב"ת: _____.

ההשערות הינן: _____.

גודל הסטטיסטי למבחן הינו (רשמו תוצאה מספרית): _____.

המסקנה המתקבלת היא: _____.

**שיטת WLS:**

**5)** נתון המודל:

1. $Y_t = \alpha + \beta \cdot X_t + U_t$.

ונתון כי: $VAR(U_t) = \frac{\sigma^2}{Z_t^2}$ ($Z_t$ משתנה ידוע).

א. מהי הבעיה שנוצרת באמידת משוואה (1)?

ב. מהן תכונות אומדי הריבועים הפחותים של משוואה (1)?

כדי לפתור את הבעיה שנוצרה, נאמדה המשוואה הבאה:

2. $Y_t \cdot W_t = \alpha \cdot W_t + \beta \cdot (X_t \cdot W_t) + U_t \cdot W_t$.

ג. מהו $W_t$ שבעזרתו ניתן לאמוד את $\alpha$ ו-$\beta$ בצורה יעילה?

ד. מהו האומד היעיל של $\sigma^2$?

ה. האם ניתן להשוות בין המודלים על בסיס $R^2$? אם לא, האם ניתן להחליט בכל זאת איזה מודל טוב יותר?

ו. חוו דעתכם על הטענות הבאות, ונמקו:

i. אם נתון כי: $Z_t = a + b \cdot \bar{X}$, התשובות לסעיפים א' ו-ב' נשארות ללא שינוי.

ii. המשוואה הנורמאלית: $\sum \hat{\varepsilon}_t = 0$ (כאשר: $\varepsilon_t = U_t \cdot W_t$) היא אחת המשוואות הנורמאליות לאמידת משוואה (2).

**6)** ענו על השאלה הקודמת, כאשר נתון כי: $VAR(U_t) = \sigma^2 \cdot X_t^2$.

**7)** נתון המודל: $Y_t = \alpha + \beta X_t + u_t$. וקיים מדגם של 100 תצפיות כאשר נתון כי: $V(u_t) = \sigma_t^2 = \begin{cases} X_t \sigma^2 \Leftrightarrow t \geq 50 \\ X_t^2 \sigma^2 \Leftrightarrow t \leq 50 \end{cases}$. (שאר ההנחות הקלאסיות מתקיימות).

א. במשוואה מס' 1 יש בעיה של: _____.

ב. אמידת משוואה (1) תניב אומדים בלתי מוטים ועקיבים: נכון/ לא נכון/ לא ניתן לדעת

ג. פתרון הבעיה הקיימת במשוואה (1) ייתכן על ידי אמידת המשוואה הבאה: $Y_t \cdot W_t = \alpha \cdot W_t + \beta \cdot (X_t \cdot W_t) + \omega_t$.

כאשר: $W_t =$ _____.

ד. אם נתון כי: $V(u_t) = \sigma_t^2 = \begin{cases} 3\sigma^2 \Leftrightarrow t \geq 50 \\ \sigma^2 \Leftrightarrow t \leq 50 \end{cases}$

האם ישתנו תשובותיכם לסעיפים א' ו-ב': כן/לא/לא ניתן לדעת

## תשובות סופיות:

1) יש עדות לכך, השערות: $H_0:\sigma_1^2=\sigma_2^2$ , $H_1:\sigma_1^2>\sigma_2^2$ , חישוב סטטיסטי: 17.62, כלל הכרעה: 2.48.

2) יש עדות לכך, השערות: $H_0:\sigma_1^2=\sigma_2^2$ , $H_1:\sigma_1^2>\sigma_2^2$ , חישוב סטטיסטי: 1.77, כלל הכרעה: 1.69.

3) יש עדות לכך, השערות: $H_0:\alpha_1=\beta_1=0$ , $H_1:OTHERWISE$ , חישוב סטטיסטי: 18.75,
כלל הכרעה: 5.991.

4) קיום הטרוסקדסטיות בנתונים.
$(LM)WHITE$.
$RES^2$.
$X1_SQUARE$ , $X1_SQUARE^2$ , $X1_SQUARE*X2_RENT$ ,
$PAPERS$ , $X2_RENT*PAPERS$ , $X2_RENT^2$ , $X2_RENT$.
$LM_{stat}=1.73$.
אין עדות לכך.

5) א. הטרוסקדסטיות. ב. ראו סרטון. ג. $W_t=\frac{1}{\sqrt{\frac{1}{Z_t^2}}}=Z_t$.
ד. $\sigma^2=\frac{ESS}{T-K}$. ה. לא, המודל השני. i.ו לא נכון. ii. לא נכון.

6) א. הטרוסקדסטיות. ב. ראו סרטון. ג. $W_t=\frac{1}{X_t}$.
ד. $S^2=\frac{ESS}{T-k-1}$. ה. ראו סרטון. ו. ראו סרטון.

7) א. הטרוסקדסטיות. ב. נכון.
ג. $t\ge 50$ $W_t=\frac{1}{\sqrt{X_t}}$ , $t\le 50$ $W_t=\frac{1}{\sqrt{X_t^2}}$. ד. לא.