אקונומטריקה

פרק 15 - סיכום מתאם סדרתי והטרוקדסטיות

תוכן העניינים

1. כללי 1

סיכום מתאם סדרתי והטרוקדסטיות:

רקע:

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