

אקונומטריקה ב

פרק 13 - סיכום תכונות ארפ

תוכן העניינים

1. כללי..... 1

סיכום תכונות אר"פ:

רקע:

אם המודל שאותו אנו אומדים מנסח נכון את הקשר המתמטי בין המשתנים וכולל את כל המשתנים הרלוונטיים להסבר התופעה ורק אותם ולא קיים קשר חזק או מלא בין המשתנים הבלתי תלויים במודל וכל ההנחות הקלאסיות מתקיימות, אזי האומדים שאותם נקבל הם א.ח.ה, הם BLUE (יעילים) והם עקיבים.

פגיעה בתכונות אר"פ	כל ההנחות הקלאסיות מתקיימות	אין קשר חזק או מלא בין ה"ב"ת	לא כולל משתנים שאינם רלוונטיים	כולל את כל המשתנים הרלוונטיים	הבעיה במודל
אין פגיעה	√	√	√	√	אין בעיה
פגיעה בכל התכונות - מוטים, לא יעילים ולא עקיבים	√	√	√	×	השמטת משתנים רלוונטיים
אין פגיעה	√	√	×	√	הוספת משתנים לא רלוונטיים
אין פגיעה	√	×	√	√	מולטיקוליניאריות חלקית
אר"פ אינם מוגדרים	√	×	√	√	מולטיקוליניאריות מלאה
יעילות	×	√	√	√	הטרוסקדסטיות
יעילות	×	√	√	√	מתאם סדרתי
מוטים היעילות והעקיבות תלויים בקיום מתאם סדרתי	×	√	√	√	מודלים דינמיים
**אומדים מוטים אך עקיבים היעילות תלויה בשיטה.	×	√	√	√	משוואות סימולטניות

*אלא אם אין מתאם בין המשתנה ה"ב"ת שהושמט לאלו המצויים במודל.
**בהנחה שהמשוואות מזוהות.