מבוא לאקונומטריקה

פרק 33 - 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.

הבעיה במודל	כולל את כל המשתנים הרלוונטיים	לא כולל משתנים שאינם רלוונטיים	אין קשר חזק או מלא בין הב"ת	כל ההנחות הקלאסיות מתקיימות	פגיעה בתכונות אר"פ
אין בעיה	√	√	√	√	אין פגיעה
השמטת משתנים רלוונטיים	×	√	√	√	פגיעה בכל התכונות - *מוטים, לא יעילים ולא עקיבים
הוספת משתנים לא רלוונטיים	√	×	√	√	אין פגיעה
מולטיקוליניאריות חלקית	√	√	×	√	אין פגיעה
מולטיקוליניאריות מלאה	√	√	×	√	אר"פ אינם מוגדרים
הטרוסקדסטיות	√	√	√	× $V(u_t)=\sigma_t^2$	יעילות
מתאם סדרתי	√	√	√	× $\text{cov}(u_t,u_s)\neq 0$	יעילות
מודלים דינמיים	√	√	√	× $\text{cov}(x,u)\neq 0$	מוטים היעילות והעקיבות תלויים בקיום מתאם סדרתי
משוואות סימולטניות	√	√	√	× $\text{cov}(x,u)\neq 0$	**אומדים מוטים אך עקיבים. היעילות תלויה בשיטה.

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