

שיטות מחקר במימון

פרק 26 - 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 מבחן White	מבחן DW מבחן LM	זיהוי הבעיה
שיטת WLS	שיטת קוקרן – אורקוט (רגרסיית ההפרשים) הכנסת משתנה מוסבר בפיגור (מודל דינמי)	פתרון הבעיה