

# מבוא לאקונומטריקה 71708

פרק 14 - תיאוריה הפרת ההנחות קלאסיות

תוכן העניינים

1. כללי ..... 1

## הפרת ההנחות הקלאסיות:

### רקע:

ארבעת הנושאים הבאים עוסקים במצב של הפרת אחת ההנחות הקלאסיות הדרושות לאמידת הפרמטרים בשיטת OLS:

- הטרוסקדסטיות (הפרת הנחה מס' 5) – שונות קבועה ויחידה לאורך קו הרגרסיה:  $V(u_t) = \sigma^2$ .
- מתאם סידרתי (הפרת הנחה מס' 6) – אי תלות בין הטעויות:  $\text{cov}(u_t, u_s) = 0$ .
- מודלים דינמיים ו-משוואות סימולטניות (הפרת הנחה מס' 4) – אי תלות בין המשתנים הב"ת לטעויות:  $\text{cov}(x, u) = 0$ .

בכל אחד מן הנושאים נלמד:

- מהן ההשלכות של הפרת ההנחות הללו על אומדי הריבועים הפחותים.
- מהם המבחנים הסטטיסטיים המשמשים לזיהוי קיומה של הפרה.
- כיצד נתקן את משוואת הרגרסיה כך שניתן יהיה לאמוד את הפרמטרים בשיטת OLS.