

Глава 6, итерация 2

6-1-1 Определение автокорреляции

<http://youtu.be/bdTcoQJ0oYA>

0:36 исправить появляющуюся формулу на: (разница в начале формулы):

$$\text{Cov}(\varepsilon_i, \varepsilon_j | X) = E(\varepsilon_i \varepsilon_j | X) = 0 \text{ при } i \neq j$$

6-1-2 Свойства автокорреляции первого порядка [у доски]

<http://youtu.be/X9AEqv7saRo> ок

6-1-3 Последствия автокорреляции

<http://youtu.be/NodAGvgYybA>

0:26 исправить оставшуюся ошибку в формуле (в конце перед u_t по-прежнему нет плюса), должно быть:

$$\varepsilon_t = \phi_1 \varepsilon_{t-1} + \phi_2 \varepsilon_{t-2} + \dots + \phi_p \varepsilon_{t-p} + u_t$$

4:15 зарезана скобка в конце строки под корнем, нижняя строка должна быть такой:

$$\text{В частности, } \widehat{\text{Var}}(\hat{\beta}_j | X) = \frac{\hat{\sigma}^2}{\text{RSS}_j} \text{ и } \text{se}(\hat{\beta}_j) = \sqrt{\widehat{\text{Var}}(\hat{\beta}_j | X)}$$

5:58 — 6:08 слева от формул должны быть «буллеты» (точки)

6:48 убрать «(—)» перед третьей и четвертой формулами (т.е. слева от каждой формулой должен быть буллет, а справа — галка или крест, галки и кресты стоят верно).

7:22 слово «гипотезы» убежало вверх строки, третий пункт должен иметь вид:

* Используя обычные $\text{se}(\hat{\beta}_j)$, нельзя строить доверительные интервалы или проверять гипотезы

6-1-4

<http://youtu.be/Q1VSRkUXKmI>

6-1-5

<http://youtu.be/moI2LeRaXe4>

6-2-1 Работа с датами в R

<http://youtu.be/QZQfP58SdoA> ок

6-2-2 Базовые действия с временными рядами

<http://youtu.be/ocoGYXZkQK0> ок

6-2-3 Загрузка данных из внешних источников

<http://youtu.be/jr0VmfrZ-Qo> ок

6-2-4 Построение робастных доверительных интервалов

<http://youtu.be/cqEg4bZNc-w>

от начала до 0:31 удалить

6-2-5 Тесты на автокорреляцию

<http://youtu.be/i6UMzh3EiTg>

0:07 убираем «кафедра публичной политики»