number of interaction: 100

rho 0.993436

Изображение выглядит как текст

Автоматически созданное описание

p-value < 2.2e-16 – H0 отвергается, автокорреляция есть

DW = 0.058253, стремится к 0 => автокорреляция довольно значимая

1. Используя взвешенные МНК (гетероскедастичность), используя обобщенные МНК (гетероскедастичность и автокорреляция)
2. Расчет робастных (устойчивых) ковариационных матриц: HC – устойчивая к гетероскедастичности Изображение выглядит как текст

   Автоматически созданное описание

Изображение выглядит как текст

Автоматически созданное описание

vcovHAC(m)

vcovHC(m)

Если хотя бы 1 тест говорит, что проблема есть => значит проблема есть.

**АВТОКОРРЕЛЯЦИЯ**

Dw – p-value = 0.1102, H0 принимается т.к. p-value > alpha => автокорреляция = 0

p-value>alpha

H0 => верна!

Bg – H0 верна, p-value = 0.3072 > alpha, автокорреляции нет

**Гомо- гетероскедастичность:**

Gq: p-value = 0.05764

При alpha 1% and 5% H0 верна, гомоскедастичность

Bp: p-value = 0.3239 > alpha

H0 верна, гомоскедастичность