

Пояснения к коду

16 января 2020 г.

1. `deviations_test_corr.R`:

- (a) Ручной расчёт VIF для FE (two-way).
- (b) Гетероскедастичность - тесты (либо вручную по формулам, либо команды; со ссылками на статьи): тест Бройша-Пагана (команда); модифицированный тест Вальда (вручную).
- (c) Автокорреляция - тесты (все по командам): Вулдриджа, Балтаги-Ли, Дарбина-Уотсона, Бройша-Пагана.
- (d) Пространственная корреляция - тесты (команды): Бройша-Пагана, Песарана.
- (e) Корректировки:
 - i. Робастные ошибки (Уайт, кросс-вал) для г/ск.
 - ii. GLS, учитывающий разные проблемы.

2. `endogeneity.R`:

- (a) Тест Саргана вручную по формулам.
- (b) Тест на релевантность вручную по формулам.
- (c) Раздел «Переоценка всего-всего» — там есть прописанная функция, которая выдаёт f-stat и p-value при подаче UR и R моделей.

3. `invarmodels.R`:

- (a) Оценка моделей с инвариантной по времени переменной Хаусманом-Тейлором, RE и методом FE + BE. Частично вручную, частично командами.

4. `model_test.R`:

- (a) Тут важен первый раздел «FE vs RE», там реализована регрессия Мундлака. Всё остальное стандартно и не очень важно.