

5-1-1 http://youtu.be/qse3g7L_8D4 Гомоскедастичность

1:18 старый заголовок «Условная гомоскедастичность» нужно убрать, т.е. оставить на слайде только четыре надписи с буллетами (условная гомо..., условная гетеро..., безусловная гомо..., безусловная гетеро...) без заголовка.

5-1-2 Условная гетероскедастичность

<http://www.youtube.com/watch?v=E4P57J6Dp8M> ok

5-1-3 Безусловная гетероскедастичность

<http://www.youtube.com/watch?v=znxPMtkEJaI> ok

5-1-4 Последствия гетероскедастичности для малых выборок

<http://youtu.be/QxXqvtoCt7o> ok

5-1-5 Асимптотические последствия условной гетероскедастичности

http://youtu.be/jUCdLWa4_60 ok

5-1-6 Обнаружение гетероскедастичности и стандартные ошибки Уайта

<http://youtu.be/WlXXomMuKAK>

5:23 исправить заголовок слайда на «С практической точки зрения:»

5:49 исправить заголовок слайда на «Когда следует использовать робастные оценки дисперсии?»

10:12 начать новую строку после «Если верна» и *исправить ошибку в формуле в конце слайда (!)*, т.е. должно получиться:

Тест Уайта (заголовок слайда, синим)

* Если верна

H_0 : условная гомоскедастичность,

$$Var(\varepsilon_i|X) = \sigma^2$$

* То асимптотически $LM \sim \chi_{m-1}^2$

m — число коэффициентов

во вспомогательной регрессии:

$$\hat{\varepsilon}_i^2 = \gamma_1 + \gamma_2 z_{i2} + \dots + \gamma_m z_{im} + u_i$$

5 1 7 Пример. Тест Уайта

<http://youtu.be/sNnq00hjU5g> ok

5 1 8 <http://youtu.be/sDQrtXEqhr4>

3:26 немного аккуратнее оформить (добавить новую строку после «Если верна», сделать одинаковое оформление у пунктов про n_1 и n_2) чтобы вышло:

* Если верна

H_0 : условная гомоскедастичность,

$$Var(\varepsilon_i|X) = \sigma^2$$

* То $F = \frac{RSS_1/(n_1-k)}{RSS_2/(n_2-k)} \sim F_{n_1-k, n_2-k}$

n_1 — число наблюдений

в «верхней» части выборки

n_2 — число наблюдений

в «нижней» части выборки

5-1-9

<http://youtu.be/nfsYNHrI3KI> ok

5 1 10 Мораль лекции о гетероскедастичности, <http://youtu.be/E10Jt8YyVcA>

0:16 добавить название лекции (синим по центру) «Гетероскедастичность», добавить название фрагмента (на синей полосе внизу) «Мораль лекции о гетероскедастичности»

0:24 во втором пункте списка пропущено слово «выборке», должно быть:

* Гетероскедастичность в случайной выборке почти всегда есть

5-2-1 Написание функций в R

<http://youtu.be/aqsxmvhiTLU> ok

5-2-2 Написание циклов в R

<http://youtu.be/efsm11jzQ1I> ok

5 2 3 Оценка модели с помощью мнк

<http://youtu.be/S377yzJkQXg> ok

5-2-4 Доверительные интервалы при гетероскедастичности

<http://youtu.be/GTcr3nY05N8> ok

5 2 5 Тесты на гетероскедастичность

<http://youtu.be/vEyRr-VkTPw>

видео меня и звук — верные.

однако наложен скринкаст из отбракованного дубля. Надо наложить тот скринкаст, который соответствует съемке.

Мне трудно указать точное соответствие во времени, но скринкаст момента времени 5:40 примерно должен приходиться примерно на момент времени 2:30. То есть скринкаст (и только скринкаст!) от начала и до 2:40 (примерно, я плохо понимаю, где склейка) надо отрезать и выкинуть.