

Глава 6, итерация 2

6-1-1 Определение автокорреляции

<http://youtu.be/bdTcoQJ0oYA>

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

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

6-1-3 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 Робастные стандартные ошибки и тест Дарбина-Уотсона

<http://youtu.be/Q1VSRkUXKmI>

1:37 старый заголовок «Робастная (устойчивая)...» удалить, заголовком должно стать «Суть корректировки:»

1:39 убрать лишнюю крышку над бетой в последних двух пунктах. Слайд целиком должен выглядеть так:

Суть корректировки: (!!!монтажёр: это заголовок слайда)

Мы меняем $\text{se}(\hat{\beta}_j)$ на $\text{se}_{\text{HAC}}(\hat{\beta}_j)$

Какие проблемы решены?

$$* \frac{\hat{\beta}_j - \beta_j}{\text{se}_{\text{HAC}}(\hat{\beta}_j)} \rightarrow N(0, 1)$$

* можем проверять гипотезы о β_j

* можем строить доверительные интервалы для β_j

2:18 старый заголовок «Робастная (устойчивая)...» удалить, заголовком должно стать «Какие проблемы не решены?»

2:19 справа от пункта «* оценки $\hat{\beta}$ эффективны» должен появляться красный крест

2:39 старый заголовок «Робастная (устойчивая)...» удалить, заголовком должно стать «На практике в R:»

3:06 исправить опечатку в заголовке слайда в слове «стандартные», заголовок должен быть «Когда на практике использовать робастные стандартные ошибки?»

8:07 ошибка в последнем (третьем) пункте, исправить слово «больше» на «меньше», должно быть:

* Если P -значение меньше уровня значимости α , то H_0 об отсутствии автокорреляции отвергается

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»

6-1-2, 6-1-5, 6-2-1, 6-2-2, 6-2-3 ok