

# א ק ו נ מ ט ר י ק ה

## תוכן העניינים

מבוא עמוד 1

עמוד 3 **רגרסיה ליניארית פשוטה במדגם**

קשר ליניארי בין שני משתנים

מקדם המתאם

קו הרגרסיה בין שני משתנים

פירוק השונות

מקדם המתאם והשונות המשותפת שבין ציוני התקן

רגרסיה הפוכה

רגרסיה ללא חותך

רגרסיה ללא מסביר

רגרסיה ללא חותך וללא מסביר

טרנספורמציות ליניאריות

ריכוז הנוסחאות לחישוב קו הרגרסיה

עמוד 21 **מודל הרגרסיה הליניארית הפשוטה באוכלוסייה**

ניסוח המודל

ההנחות הקלאסיות על ההפרעה המקרית

הנחות נוספות שאינן נמנות על ההנחות הקלאסיות

עמוד 25 **תכונות של אומדים**

המשמעות של אומד

תכונות של אומד ממדגם בגודל סופי

תכונות אסימפטוטיות של אומד

התכונות של אומדי הריבועים הפחותים עמוד 30

מודלים ליניאריים ומודלים לא ליניאריים עמוד 35

מודלים מקובלים בכלכלה עמוד 37

מודל LIN-LIN

מודל LIN-LIN ללא חותך

מודל LIN-LOG

מודל LOG-LIN

מודל LOG-LOG

המודל הריבועי

המודל ההופכי

מודל S

מבחני השערה ורווחי סמך על מקדמי הרגרסיה הפשוטה עמוד 45

ניבויים ותחזיות עמוד 54

רגרסיה מרובה עמוד 57

מבחני השערה ורווחי סמך ברגרסיה המרובה עמוד 61

מבחני השערה בעזרת התפלגות  $t$

מבחן השערה על מקדם בודד

מבחן השערה על קשר ליניארי בין המקדמים

מבחני השערה בעזרת התפלגות  $F$

מבחני השערה על הצהרה אחת או יותר

מבחן  $F$  למובהקות תת קבוצה של מקדמים

מבחן  $F$  למובהקות הרגרסיה

מבחני השערה בעזרת התפלגות  $\chi^2$

מבחן LM למובהקות תת קבוצה של מקדמים

מבחן LM למובהקות הרגרסיה

מבחני השערה ברגרסיה ללא חותך

רווחי סמך למקדמי הרגרסיה, לתוחלת המותנית של  $Y$  ולערכו המותנה של  $Y$

מקדם ההסבר המתוקנן עמוד 73

מולטיקוליניאריות עמוד 76

משתני דמי עמוד 85

הגדרת משתני דמי

הכללת משתני הדמי במודל

מבחן CHOW

piecewise regression

spline regression

מלכודת משתני הדמי

הטרוסקדסטיסיות עמוד 107

המשמעות של הטרוסקדסטיסיות

תכונות האומדים כאשר מתעלמים ממצב של הטרוסקדסטיסיות

מבחנים לזיהוי הטרוסקדסטיסיות:

מבחן גרפי

מבחן WHITE

מבחן GLEJSER

מבחן GQ

מבחן BP

שיטות אמידה לתיקון הטרוסקדסטיסיות:

אמידה בשיטת WLS

אמידה בשיטת WHITE

## מתאם סדרתי עמוד 120

מתאם סדרתי מסדר ראשון

ההשלכות של התעלמות ממתאם סדרתי

מבחנים לזיהוי מתאם סדרתי:  
מבחן גרפי

מבחן DW

מבחן BG

מבחן Durbin h

שיטות לתיקון מתאם סדרתי:

תיקון למודל עם מתאם סדרתי כאשר מקדמי המתאם הסדרתיים ידועים

תיקון למודל עם מתאם סדרתי כאשר מקדמי המתאם הסדרתיים אינם ידועים:

שיטת CORC

שיטת HILU

שיטת BG

מקדם ההסבר המרובה במודל עם מתאם סדרתי

תחזית במצב של מתאם סדרתי

מתאם סדרתי או טעויות ספציפיקציה?

## משתנה מוסבר איכותי עמוד 143

LPM

LOGIT

PROBIT

## משתני עזר (IV) עמוד 156

מתי משתמשים ב-IV

אומדי OLS אינם עקיבים - הוכחה

אמידה בשיטת IV

תכונות אומדי IV

מבחן Hausman-Wu

## **משוואות סימולטניות** עמוד 161

ניסוח של מודל סימולטני

משתנה מסביר אנדוגני המתואם עם ההפרעה המקרית

"תנאי הסדר" לזיהוי משוואות מבנה הניתנות לאמידה

המחשורת גרפיות

אמידה של מודל סימולטני:

שיטת ILS

שיטת IV

שיטת TSLS

הסבר אינטואיטיבי והמחשה גרפית

מודל רקורסיבי

## **נוסחאות** עמוד 179

## **התפלגויות** עמוד 186