

Heterocedasticidad y minimos cuadrados generalizados

Tests de lectura

1. Por que bajo heterocedasticidad el estimador de MCO sigue siendo insesgado?
2. V o F: bajo heterocedasticidad $S(X'X)^{-1}$ es un estimador sesgado.
3. V o F: bajo la hipotesis nula del test de Breusch/Pagan no hay heterocedasticidad.
4. V o F: bajo la hipotesis nula del test de White no hay heterocedasticidad
5. Si el modelo es $Y = \beta_0 + \beta_1x_1 + \beta_2X_2 + \beta_3X_3 + u$, cual es la lista de regresores a utilizar en el paso 2 del test de White?
6. Cual es la diferencia entre el test de White y el de Breusch/Pagan?
7. Por que el termino de error del modelo transformado dividiendo por el desvio estandar del error es homocedastico?
8. En el modelo en donde $V(u_i) = \sigma^2X_i^2$, porque dividir las observaciones por X_i 'resuelve' el problema de heterocedasticidad?
9. V o F: en el caso anterior, la pendiente del modelo transformado es la ordenada al origen del modelo original.
10. Verificar los detalles del caso $V(u_i) = \sigma^2X_i$.
11. En que sentido la estrategia de recurrir al estimador de White es mejor o peor que usar minimos cuadrados ponderados?
12. Si Ω fuese un escalar que vale 9, cuanto vale C ?
13. V o F: el estimador de minimos cuadrados generalizados es igual al de minimos cuadrados ordinarios.
14. V o F: el estimador de MCO es un caso particular del estimador de MCF.
15. V o F: si el estimador de MCG es insesgado tambien lo es el de MCGF.