

ГЕТЕРОСКЕДАСТИЧНОСТЬ И ЕЕ ПОСЛЕДСТВИЯ

Обнаружение гетероскедастичности.
Устранение гетероскедастичности.

Презентация лекции по курсу “Эконометрика”
доцента кафедры математической статистики
СГЭУ,
к.ф.-м.н., Ширяевой Людмилы Константиновны
E-mail: Shiryeva_LK@mail.ru

План

- Гетероскедастичность и ее последствия
- Методы обнаружения гетероскедастичности.
- Методы устранения гетероскедастичности.
Обобщенный метод наименьших квадратов

Гетероскедастичность и ее последствия

- Свойства эмпирических коэффициентов регрессии напрямую зависят от свойств случайной компоненты ε .
- Для получения статистически надежных эмпирических коэффициентов регрессии необходимо следить за выполнимостью условий Гаусса-Маркова.
- При нарушении условий Гаусса-Маркова МНК может давать эмпирические коэффициенты регрессии с плохими статистическими свойствами.

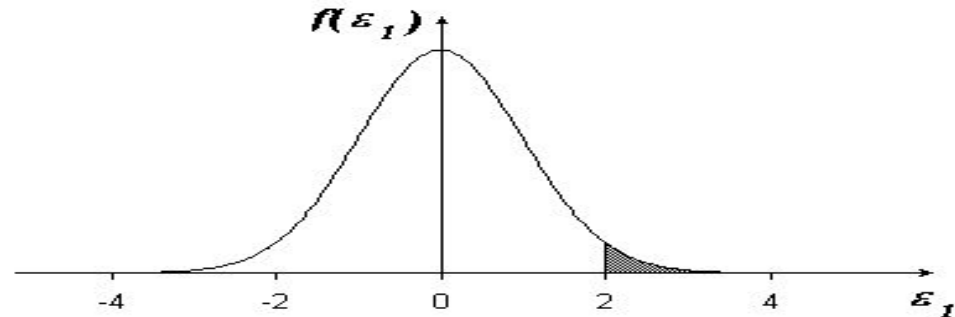
Гетероскедастичность и ее последствия

- Согласно второму условию Гаусса-Маркова, дисперсия случайного фактора должна быть одинаковой для всех наблюдений, т.е. $D(\varepsilon_i) = D(\varepsilon_j)$.
- Выполнение этого условия называется гомоскедастичностью, а его нарушение - гетероскедастичностью.

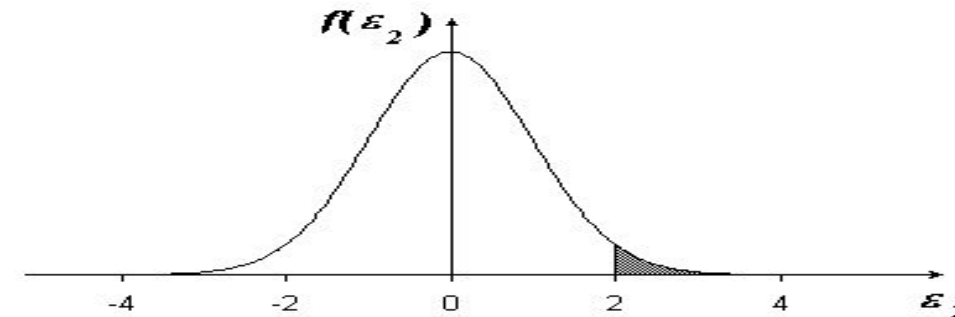
Иллюстрация гомоскедастичности

Вероятность того, что случайная ошибка примет какое-либо значение одинакова для всех наблюдений

Наблюдение 1



Наблюдение 2



Наблюдение n

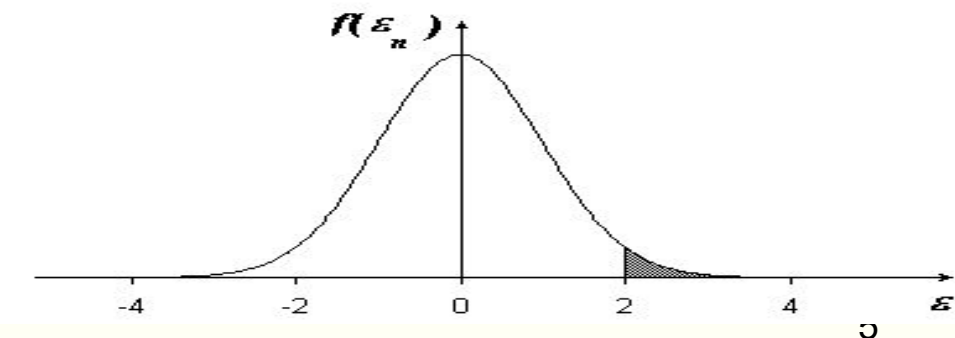
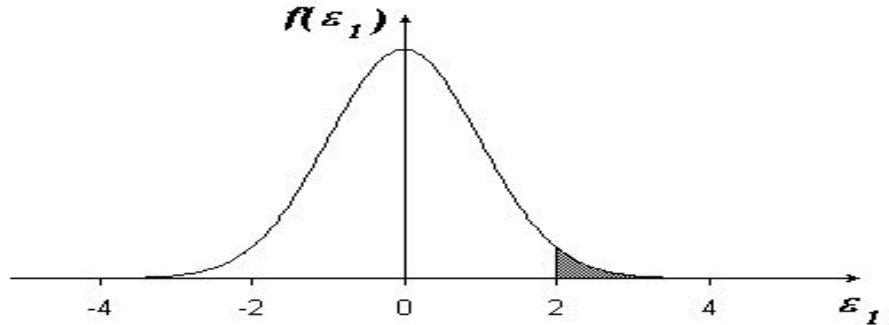


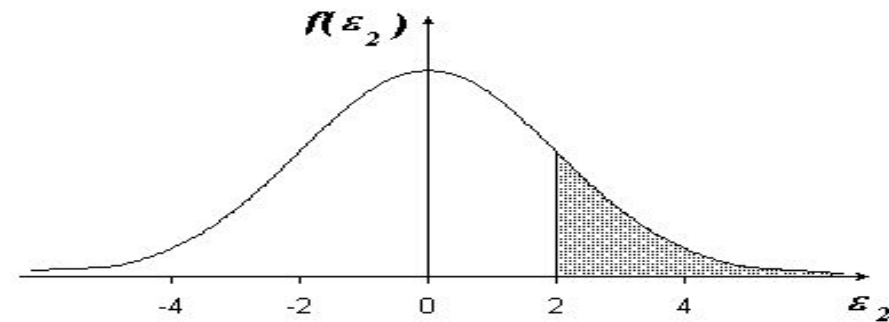
Иллюстрация гетероскедастичности

Вероятность того, что случайная ошибка примет какое-либо значение неодинакова для всех наблюдений

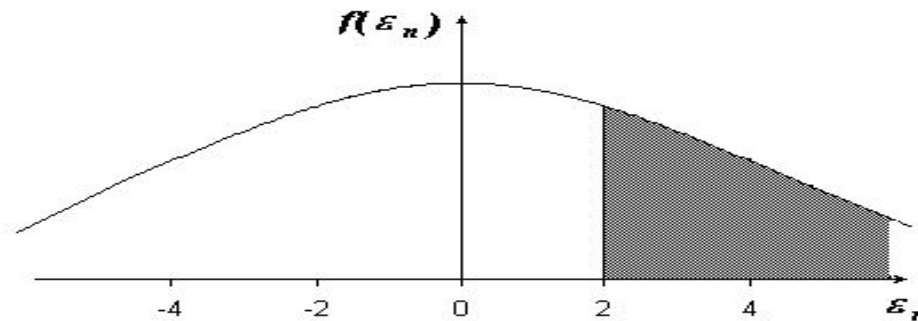
Наблюдение 1



Наблюдение 2



Наблюдение n



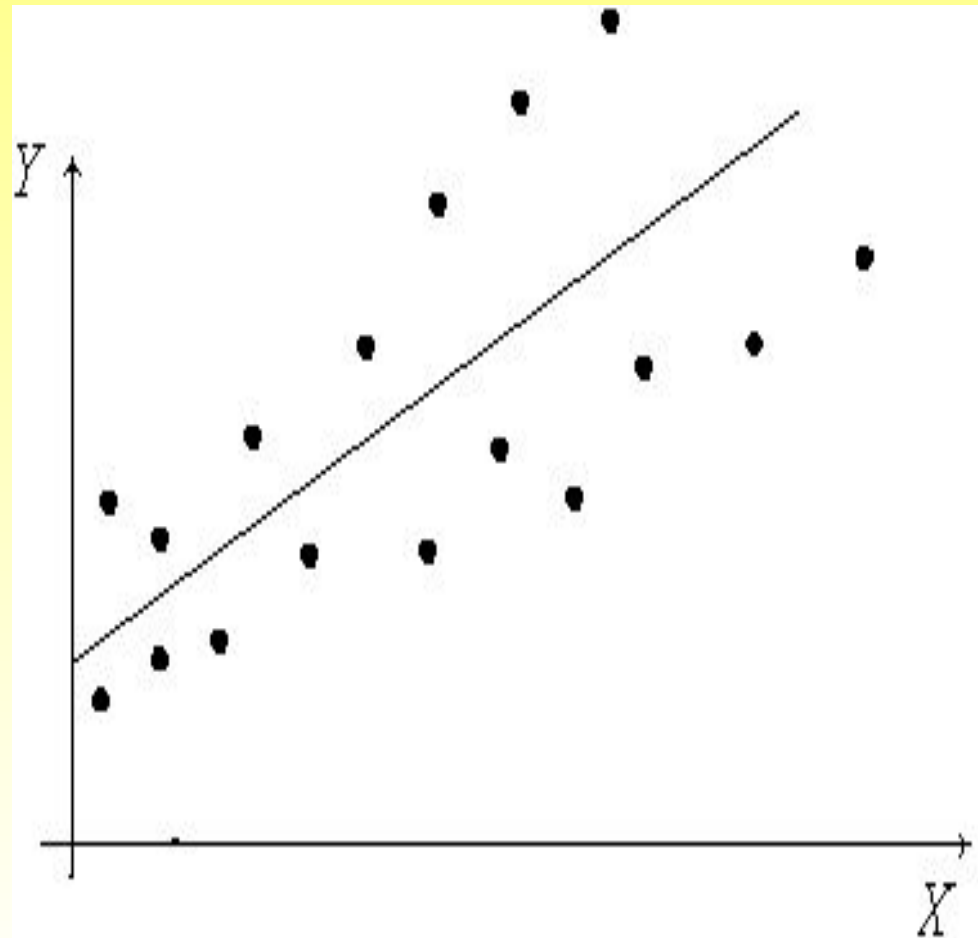
Гомоскедастичность означает “одинаковый разброс”.

❖ Типичный вид
облака точек в
модели с
гомоскедастичным
и остатками



Гетероскедастичность означает “неодинаковый разброс”.

❖ Типичный вид облака точек в модели с гетероскедастичными остатками



Последствия применения МНК в случае гетероскедастичности

- МНК-оценки не будут являться эффективными;
- формулы для вычисления стандартных ошибок коэффициентов регрессии становятся некорректными;
- дисперсия остатков регрессии становится смещенной оценкой для дисперсии случайной компоненты;
- все выводы, получаемые на основе F – и t -статистик, а также интервальные оценки становятся ненадежными.

Проверка остатков модели на гетероскедастичность

- **Первичная проверка на наличие гетероскедастичности осуществляется с помощью визуального анализа поведения остатков регрессии.**
- **Дальнейшая проверка на наличие гетероскедастичности осуществляется уже с помощью статистических тестов.**

Методы обнаружения гетероскедастичности

Тесты на гетероскедастичность

графический тест

статистические тесты

графический анализ остатков

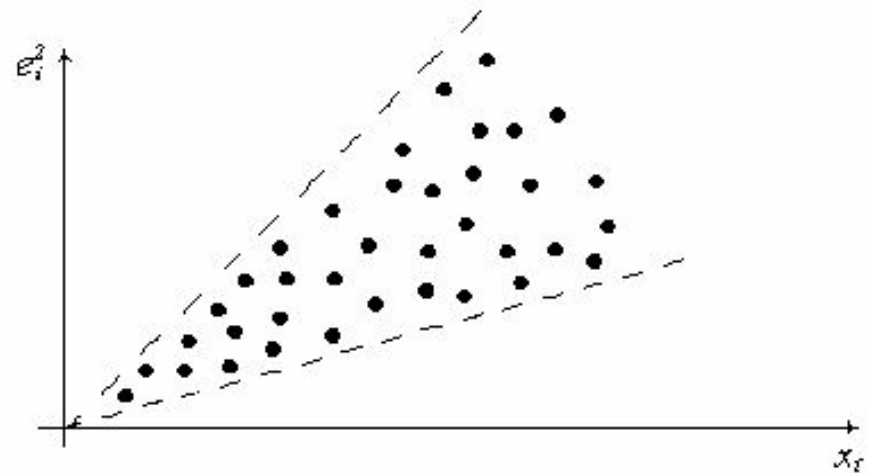
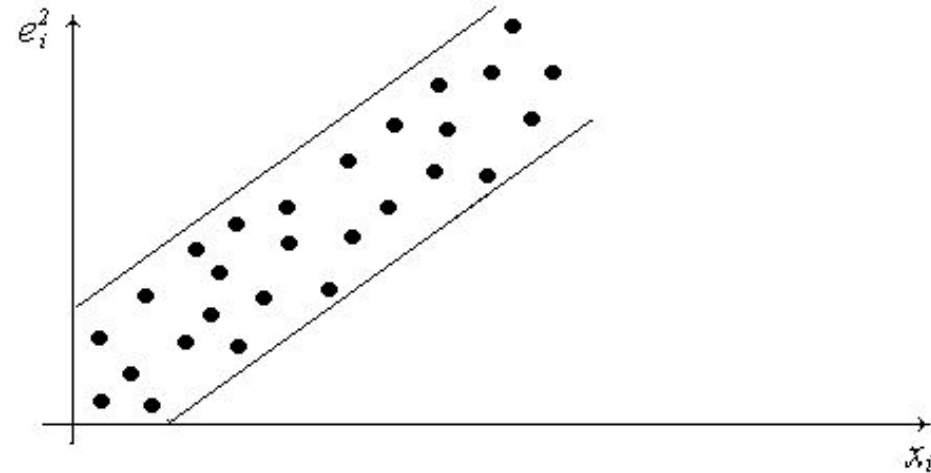
тест
Спирмена

тест
Квандта

тест
Глейзера

Графический анализ остатков. Гетероскедастичность.

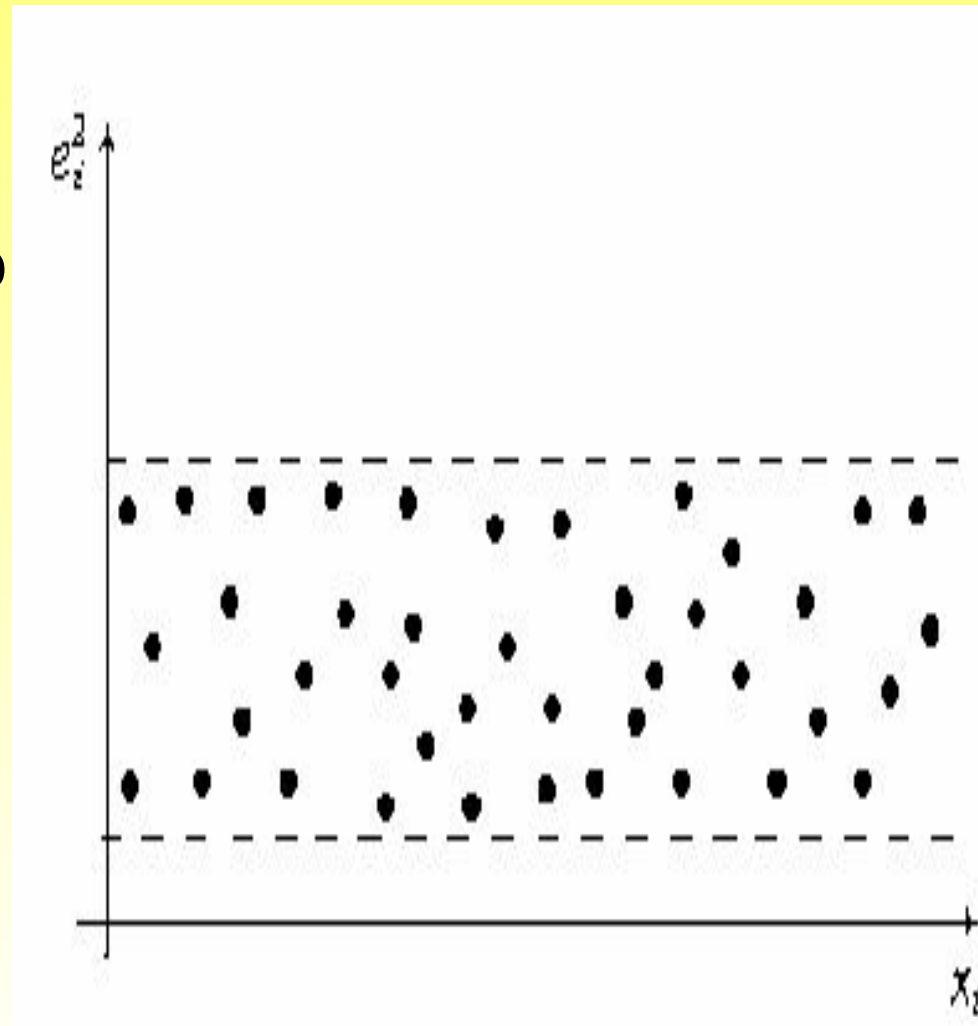
❖ Если все отклонения расположены внутри расширяющейся или наклонной полосы, то это свидетельствует в пользу гетероскедастичности



Графический анализ остатков.

Гомоскедастичность.

- Если все отклонения равномерно заполняют некоторую полосу постоянной ширины, то это свидетельствует в пользу гомоскедастичности.



Сравнительный анализ статистических тестов

Наименование	Основная идея теста	Статистика
Тест Спирмена	Проверка коррелированности остатков регрессии e и значений X	t - статистика
Тест Квандта	Проверка значимости отличий ESS для верхней и нижней третей упорядоченной выборки	F - статистика
Тест Глейзера	Подбор формы связи между остатками регрессии e и значениями X	t - статистика и F - статистика

Общая схема проведения любого статистического теста

 \hat{E} K $K_{\text{крит}}$ H_0

Тест ранговой корреляции Спирмена

- ✓ Тест Спирмена проверяет **коррелированность** модулей остатков регрессии со значениями объясняющей переменной.
- ✓ При использовании этого теста предполагается, что дисперсия случайной ошибки либо уменьшается, либо увеличивается по мере увеличения X .
- ✓ При этом точки (x_i, e_i) могут располагаться внутри либо расширяющейся, либо – наклонной полосы ([см. слайд 12](#)).
- ✓ Теснота взаимосвязи между модулями остатков регрессии $|e_i|$ и значениями x_i оценивается с помощью *выборочного рангового коэффициента корреляции* r_{xe} .
- ✓ Если связь между абсолютными величинами остатков регрессии и значениями может быть признана статистически значимой, то принимается гипотеза о наличии гетероскедастичности.

Порядок выполнения теста Спирмена

- 1) выполняется регрессия переменной Y на переменную X ,
- 2) для каждого i -ого наблюдения вычисляют модуль остатков регрессии $|e_i|$;
- 3) значения x_i и модули $|e_i|$ ранжируются, т. е. упорядочиваются по возрастанию;
- 4) вычисляются ранги – порядковые номера значений в ранжированном ряде из значений x_i , и ранги $|e_i|$ – порядковые номера значений в ранжированном ряде, составленном из модулей остатков;
- 5) для каждого i -ого наблюдения вычисляется значение d_i как разность между рангами x_i и $|e_i|$ (пусть, например, наблюдаемое значение объясняющей переменной x_{11} является 33-им по величине, т.е. ранг x_{11} равен 33, а $|e_{11}|$ является 5-ым по величине, т.е. ранг $|e_{11}|$ равен 5, тогда $d_{11}=33-5=28$);
- 6) вычисляется выборочный коэффициент ранговой корреляции по следующей формуле:

$$r_{xe} = 1 - \frac{6 \sum_{i=1}^n d_i^2}{n(n^2 - 1)}$$

Порядок выполнения теста Спирмена (окончание)

- 7) выдвигаются нулевая и альтернативная гипотезы:
 - H_0 : (ранговый коэффициент корреляции для генеральной совокупности $\rho_{xe} = 0$, или гетероскедастичность отсутствует);
 - H_1 : (ранговый коэффициент корреляции для генеральной совокупности ρ_{xe} отличен от 0, или гетероскедастичность имеет место);
- 8) статистика для проверки H_0 имеет вид:

$$t = \frac{r_{xe} \sqrt{n-2}}{\sqrt{1-r_{xe}^2}} \sim t(n-2)$$

- 9) строится двусторонняя критическая область $|t| > t_{кр.дв}(\alpha, n-2)$;
- 10) если наблюдаемое значение t-статистики попадает в критическую область, то принимается гипотеза о наличии гетероскедастичности; если же наблюдаемое значение t-статистики попадает в область принятия гипотезы, то принимается гипотеза о наличии гомоскедастичности.
- Замечание.** Если в модели более одной объясняющей переменной, то с помощью t-статистики проверка гипотезы может выполняться для каждой из переменных отдельно..

Тест Голдфелда-Квандта

- Тест Голдфелда-Квандта предполагает, что с ростом x_i
- дисперсия $D(\varepsilon_i)$ либо растёт, т.е.

$$\sigma(\varepsilon_i) \approx \lambda x_i$$

- либо падает, т.е.

$$\sigma(\varepsilon_i) \approx \frac{\lambda}{x_i}$$

Порядок выполнения теста Голдфелда-Квандта

- 1) все наблюдений упорядочиваются по величине объясняющей переменной;
- 2) упорядоченная выборка разбивается на три подвыборки объемом $[n/3]$;
- 3) средняя треть наблюдений отбрасывается и оцениваются отдельные регрессии для верхней и нижней подвыборок;
- 4) вычисляются дисперсии остатков регрессии для верхней (s_1^2) и нижней (s_2^2) подвыборок;
- 5) выдвигают основную гипотезу
 H_0 : модель является гомоскедастичной;
против альтернативной
 H_1 : модель является гетероскедастичной;

Порядок выполнения теста Голдфелда-Квандта (окончание)

- гипотеза H_0 : проверяется с помощью статистики:

$$F = \frac{S_2^2}{S_1^2} \sim F([\mathbf{n}/3]-m-1; [\mathbf{n}/3]-m-1)$$

- при выбранном уровне значимости α строится правосторонняя критическая область, описываемая неравенством: $F > F_{\text{кр}}(\alpha, k_1, k_1)$;
- вычисляется наблюдаемое значение F-критерия;
- далее следует выполнить проверку гипотезы H_0 по стандартной схеме.

Тест Глейзера

- Тест Глейзера позволяет обнаружить гетероскедастичность в случае, когда стандартное отклонение случайной компоненты связано со значением X нелинейной зависимостью:

$$\sigma(\varepsilon_i) \approx \alpha + \beta x_i^\gamma$$

Порядок выполнения теста Глейзера

1) по МНК оценивается линейная регрессия $\hat{y} = \hat{b}_0 + \hat{b}_1 x$;

1) оценки $\hat{\sigma}(\varepsilon_i)$ стандартных отклонений случайной компоненты в каждом наблюдении вычисляются как:

$$\hat{\sigma}(\varepsilon_i) \equiv |e_i| = |y_i - \hat{y}_i|$$

1) выбирается набор значений показателя степени γ , например, такой:

$$\gamma = -1; -0,75; -0,5; -0,25; 0,25; 0,5; 0,75; 1; 1,25; 1,5; 1,75; 2$$

1) для каждого γ строится по МНК регрессионная модель вида: $|\hat{e}_i| = \hat{\alpha} + \hat{\beta} x_i^\gamma$

Порядок выполнения теста Глейзера (окончание)

- 5) с помощью t -статистики проверяется статистическая значимость каждого коэффициента $\hat{\beta}$;
- 6) если оценка $\hat{\beta}$ окажется статистически значима, то имеет место гетероскедастичность.

Замечание. Если для нескольких значений параметра γ получены статистически значимые оценки $\hat{\beta}$, то следует выбрать наилучшую из них (т. е. ту, для которой t -статистика максимальна).

Методы устранения гетероскедастичности.

- Основной метод устранения гетероскедастичности – обобщенный метод наименьших квадратов (ОМНК).

Суть ОМНК – минимизация суммы квадратов отклонений, в которой каждое наблюдение присутствует с учетом его “веса”.

- Последствия ОМНК – получение эффективных оценок для коэффициентов регрессии.

Применение ОМНК

• Пусть в исходной модели: $y_i = b_0 + b_1 x_i + \varepsilon_i \quad (i = \overline{1, n})$
имеет место гетероскедастичность, т. е.

$$\sigma^2(\varepsilon_i) \neq \sigma^2(\varepsilon_j), \quad i \neq j$$

Предположим, что дисперсия случайной компоненты в каждом наблюдении известна.

Разделим каждое наблюдение на соответствующее ему значение стандартного отклонения:

$$\frac{y_i}{\sigma(\varepsilon_i)} = \frac{b_0}{\sigma(\varepsilon_i)} + b_1 \frac{x_i}{\sigma(\varepsilon_i)} + \frac{\varepsilon_i}{\sigma(\varepsilon_i)}$$

Положим $y_i^* = \frac{y_i}{\sigma(\varepsilon_i)}$, $z_i^* = \frac{1}{\sigma(\varepsilon_i)}$, $q_i^* = \frac{x_i}{\sigma(\varepsilon_i)}$ и $\xi_i = \frac{\varepsilon_i}{\sigma(\varepsilon_i)}$.

Тогда преобразованная модель примет вид:

$$y_i^* = b_0 z_i^* + b_1 q_i^* + \xi_i$$

Применение ОМНК (продолжение)

- Легко убедиться, что случайная компонента

$$\xi_i = \frac{\varepsilon_i}{\sigma(\varepsilon_i)}$$

- в полученной модели имеет нулевое математическое ожидание и единичную дисперсию для всех наблюдений. Действительно,

$$M(\xi_i) = M\left(\frac{\varepsilon_i}{\sigma(\varepsilon_i)}\right) = \frac{1}{\sigma(\varepsilon_i)} M(\varepsilon_i) = \frac{0}{\sigma(\varepsilon_i)} = 0$$

$$\text{и } D(\xi_i) = D\left(\frac{\varepsilon_i}{\sigma(\varepsilon_i)}\right) = \frac{1}{\sigma^2(\varepsilon_i)} D(\varepsilon_i) = \frac{\sigma^2(\varepsilon_i)}{\sigma^2(\varepsilon_i)} = 1$$

- Следовательно, оценки коэффициентов регрессии можно найти по обычному МНК, минимизируя следующую сумму квадратов отклонений

$$S = \sum_{i=1}^n \left(\frac{y_i}{\sigma(\varepsilon_i)} - \frac{\hat{b}_0}{\sigma(\varepsilon_i)} - \hat{b}_1 \frac{x_i}{\sigma(\varepsilon_i)} \right)^2 = \sum_{i=1}^n \frac{1}{\sigma^2(\varepsilon_i)} (y_i - \hat{b}_0 - \hat{b}_1 x_i)^2 \rightarrow \min$$

Применение ОМНК (окончание)

- **Замечание.** Основная трудность в применении обобщенного (взвешенного) МНК состоит в том, что значения $\sigma(\varepsilon_i)$, как правило, неизвестны. На практике неизвестные значения либо заменяют их оценками, либо подбирают некоторую величину, пропорциональную в каждом наблюдении стандартному отклонению $\sigma(\varepsilon_i)$.

Заключение

- Построение любой эконометрической модели должно включать проверку выполнимости второго условия Гаусса-Маркова.
- Проверка осуществляется с помощью статистических тестов.
- При нарушении второго условия Гаусса-Маркова следует предпринять шаги к устранению гетероскедастичности.

Всякая наука только тогда достигает своего совершенства , когда она породнится с математикой.

И. Кант