

15 січня 2021 року о 14 год 15 хв

У роботі розглядається покращена оцінка найменших квадратів для параметрів векторної лінійної моделі з похибками у змінних для не випадкових регресорів. Встановлено умови консистентності та строгої консистентності для різних припущень щодо поведінки похибок вимірювання регресорів. Також встановлено умови асимптотичної нормальності оцінки та побудовано модифікацію для малих вибірок, яка зберігає асимптотичні властивості. Для випадку, коли регресори можна вважати випадковими, розглянуто векторну лінійну та поліноміальні моделі, для яких запропоновано консистентні оцінки для найкращого середньоквадратичного прогнозу відгуку.

Доповідач: **Іван Сенько**

Дата проведення: 13 січня 2021 року о 14 год 15 хв.
