Economia Applicata M – Lezione 6 (note aggiuntive)

Titolo nota

~~27/11/2017~~ 13/12/18

$$K_t = \beta_1 Y_t + \beta_2 K_{t-1} + U_t$$

$$K_{t-1} = \beta_1 Y_{t-1} + \beta_2 K_{t-2} + U_{t-1}$$

Se U_t fosse autocorrelato, allora K_{t-1} sarebbe correlato con U_t attraverso U_{t-1}

OLS $\hat{\beta}_1, \hat{\beta}_2$ inconsistenti

$$\hat{\lambda} = 1 - \hat{\pi}_2 \longrightarrow \underline{\underline{SE(\hat{\lambda})}} = SE(1 - \hat{\pi}_2) =$$

$$= SE(-\hat{\pi}_2) = \underline{\underline{SE(\hat{\pi}_2)}}$$

$$\hat{\mu} = \hat{\pi}_2 / \hat{\lambda} \longrightarrow SE(\hat{\mu}) = SE(\hat{\pi}_1 / \hat{\lambda}) \neq \frac{SE(\hat{\pi}_1)}{SE(\hat{\lambda})}$$

VA CALCOLATO APPROPRIATAMENTE LO S.E. DI UN RAPPORTO