Таблица 3.

Результаты проведенных предварительных тестов для уточнения спецификации панельных моделей регрессии

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Наименование теста | Значение | Альтернативная гипотеза |
| Критерий Вулдриджа для ненаблюдаемых индивидуальных эффектов. Н0: нет ненаблюдаемых эффектов в остатках. | *z* = 4,864;  p-value <0,00001 | Присутствует ненаблюдаемый индивидуальный эффект в остатках |
| Локально устойчивые тесты Бера-Соса-Эскудеро-Юна | χ2 = 26.878,  *p-value* < 0,00001 | Наличие случайных эффектов и авторегрессии первого порядка (AR(1)) в остатках |
| Односторонний тест Бера-Соса-Эскудеро-Юна | *z* = 42.459,  *p-value* <0,00001 | Наличие авторегрессии первого порядка (AR(1)) в остатках и случайных эффектов |
| Совместный тест Балгати и Ли на случайные эффекты и последовательную корреляцию при нормальности и гомоскедастичности идиосинкразических ошибок | χ2 = 2533.2,  *p-value* < 0,00001 | Наличие последовательной корреляции и/ или случайных эффектов |
| Балтаги и Ли двусторонний тест ЛМ | χ2 = 540.61,  *p-value* < 0,00001 | AR(1)/MA(1) ошибки в модели со случайными эффектами |
| Тест Вулдриджа на последовательную корреляцию в моделях с фиксированными эффектами | *F* = 1414.8,  *df*1 = 1, *df*2 = 745,  *p-value* < 0,00001 | Последовательная корреляция |
| Тест Песарана на кросс-секционную зависимость | z = 37.403,  *p-value* < 0,00001 | Кросс-секционная зависимость |