

VALORES CRÍTICOS AJUSTADOS PARA INFERÊNCIA EM MODELOS LINEARES DE REGRESSÃO SOB HETEROSCEDASTICIDADE DE FORMA DESCONHECIDA

Antonio Carlos Ricardo BRAGA JUNIOR¹
Francisco CRIBARI NETO²
Tatiene Correia de SOUZA³

- RESUMO: Inferência em modelos lineares de regressão na presença de heteroscedasticidade de forma desconhecida é usualmente realizada através do uso do estimador de mínimos quadrados ordinários do vetor de parâmetros de regressão juntamente com um estimador consistente de sua matriz de covariâncias. O estimador mais comumente usado é o HC0, que foi proposto por Halbert White (White, 1980). Algumas formas alternativas deste estimador foram propostas na literatura, dentre as quais destacam-se HC2, HC3 e HC4. Tais estimadores são rotineiramente usados em testes quasi- t , que são realizados com base em valores críticos assintóticos obtidos da distribuição normal padrão. O objetivo do presente artigo é, através do uso de métodos numéricos, obter valores críticos ajustados para esses testes. O uso de tais valores críticos conduz a inferências mais precisas em amostras finitas.
- PALAVRAS-CHAVE: Modelos heteroscedásticos; regressão linear; testes quasi- t .

¹ Universidade Federal da Bahia -- UFBA, Instituto Multidisciplinar em Saúde -- IMS, Núcleo de Tecnologia em Saúde -- NTS, CEP: 45031-000, Vitória da Conquista, BA, Brasil. E-mail: acjr@ufba.br

² Universidade Federal de Pernambuco -- UFPE, Departamento de Estatística, Recife, CEP: 50740-540, PE, Brasil. E-mail: cribari@de.ufpe.br

³ Universidade Federal da Bahia -- UFBA, Departamento de Estatística, Ondina, CEP: 40170-110, BA, Brasil. E-mail: tatiene@ufba.br