

不可识别检验

iid

Anderson's LM: $\text{rank}(\bar{E}[\hat{z}_2 \hat{x}_2']) = K_2 - 1$

\Leftrightarrow 最小特征值 $r_{K_2} = 0$

$$nr_{K_2}^2 \sim \chi^2(L - K + 1)$$

Cragg-Donald (1993) Wald test:

$$\frac{nr_{K_2}^2}{1 - r_{K_2}^2} \sim \chi^2(L - K + 1)$$

"Robust"

Kleibergen & Paap (2006)

☆ 如果只有一个内生的 x_k ,

Anderson, CD, KP 全都等价于第一
阶段回归的 F-test.