

Zestaw przykładowy

Nr albumu Imię i Nazwisko (czytelnie) Grupa

ZESTAW XX 1 6

2009-02-26 09:24 6758

Zadanie 1.

Na podstawie danych:

				$x^T y$
y_t	14		30	48
x_t	3	4	5	
				112
				560

a) oszacować i zinterpretować parametry strukturalne modelu:

$$y_t = \beta_0 + \beta_1 x_t + u_t$$

b) zbadać ich statystyczną istotność.

$$(t_{0,05;1} = 12,706; t_{0,05;2} = 4,303; t_{0,05;3} = 3,182; t_{0,05;4} = 2,776)$$

c) obliczyć i zinterpretować współczynnik zmienności resztowej.

d) obliczyć i zinterpretować współczynnik determinacji.

Zadanie 2.

Wiadomo, że przy trzech potencjalnych zmiennych objaśniających: X_1 , X_2 , X_3 w liniowym jednorównaniowym modelu ekonometrycznym niektóre integralne pojemności informacyjne są równe:

$$H_1 = h_{11} = 0,0072 \quad H_4 = h_{41} + h_{42} = 0,0865$$

$$H_2 = h_{22} = 0,1513 \quad H_5 = h_{51} + h_{53} = 0,1802$$

$$H_3 = h_{33} = 0,3014 \quad H_6 = h_{62} + h_{63} = 0,2417$$

Wykorzystując znajomość metody Hellwiga określić optymalny podzbiór zmiennych objaśniających.

Zestaw przykładowy

Nr albumu Imię i Nazwisko (czytelnie) Grupa

ZESTAW YY 5 3

2009-02-26 09:24 6694

Zadanie 1.

Na podstawie danych:

					$x^T y$
y_t	8		18	28	46
x_t	8	9	10		12
					112
					1212

a) oszacować i zinterpretować parametry strukturalne modelu:

$$y_t = \beta_0 + \beta_1 x_t + u_t$$

b) zbadać ich statystyczną istotność.

$$(t_{0,05;1} = 12,706; t_{0,05;2} = 4,303; t_{0,05;3} = 3,182; t_{0,05;4} = 2,776)$$

c) obliczyć i zinterpretować współczynnik zmienności resztowej.

d) obliczyć i zinterpretować współczynnik determinacji.

Zadanie 2.

Wiadomo, że przy trzech potencjalnych zmiennych objaśniających: X_1 , X_2 , X_3 w liniowym jednorównaniowym modelu ekonometrycznym niektóre integralne pojemności informacyjne są równe:

$$H_1 = h_{11} = 0,0310 \quad H_4 = h_{41} + h_{42} = 0,0313$$

$$H_2 = h_{22} = 0,0262 \quad H_5 = h_{51} + h_{53} = 0,1272$$

$$H_3 = h_{33} = 0,1376 \quad H_6 = h_{62} + h_{63} = 0,1158$$

Wykorzystując znajomość metody Hellwiga określić optymalny podzbiór zmiennych objaśniających.