

Задачник по эконометрике-1

(с шахматами и поэтэссами)

Дмитрий Борзых, Борис Демешев

20 ноября 2012 г.

1 Неклассифицировано

1. Регрессионная модель задана в матричном виде при помощи уравнения $y = X\beta + \varepsilon$, где $\beta = (\beta_1, \beta_2, \beta_3)'$. Известно, что $\mathbb{E}(\varepsilon) = 0$ и $\text{Var}(\varepsilon) = \sigma^2 \cdot I$. Известно также, что

$$y = \begin{pmatrix} 1 \\ 2 \\ 3 \\ 4 \\ 5 \end{pmatrix}, X = \begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 1 & 0 & 0 \\ 1 & 0 & 0 \\ 1 & 1 & 0 \\ 1 & 1 & 1 \end{pmatrix}.$$

Для удобства расчетов приведены матрицы

$$X'X = \begin{pmatrix} 5 & 2 & 1 \\ 2 & 2 & 1 \\ 1 & 1 & 1 \end{pmatrix} \text{ и } (X'X)^{-1} = \frac{1}{3} \begin{pmatrix} 1 & -1 & 0 \\ -1 & 4 & -3 \\ 0 & -3 & 6 \end{pmatrix}.$$

- (a) Укажите число наблюдений.
- (b) Укажите число регрессоров с учетом свободного члена.
- (c) Запишите модель в скалярном виде
- (d) Рассчитайте $TSS = \sum (y_i - \bar{y})^2$, $RSS = \sum (y_i - \hat{y}_i)^2$ и $ESS = \sum (\hat{y}_i - \bar{y})^2$.
- (e) Рассчитайте при помощи метода наименьших квадратов $\hat{\beta}$, оценку для вектора неизвестных коэффициентов.
- (f) Чему равен $\hat{\varepsilon}_5$, МНК-остаток регрессии, соответствующий 5-ому наблюдению?
- (g) Чему равен R^2 в модели? Прокомментируйте полученное значение с точки зрения качества оцененного уравнения регрессии.
- (h) Используя приведенные выше данные, рассчитайте несмещенную оценку для неизвестного параметра σ^2 регрессионной модели.
- (i) Рассчитайте $\widehat{\text{Var}}(\hat{\beta})$, оценку для ковариационной матрицы вектора МНК-коэффициентов $\hat{\beta}$.
- (j) Найдите $\widehat{\text{Var}}(\hat{\beta}_1)$, несмещенную оценку дисперсии МНК-коэффициента $\hat{\beta}_1$.
- (k) Найдите $\widehat{\text{Var}}(\hat{\beta}_2)$, несмещенную оценку дисперсии МНК-коэффициента $\hat{\beta}_2$.
- (l) Найдите $\widehat{\text{Cov}}(\hat{\beta}_1, \hat{\beta}_2)$, несмещенную оценку ковариации МНК-коэффициентов $\hat{\beta}_1$ и $\hat{\beta}_2$.
- (m) Найдите $\widehat{\text{Var}}(\hat{\beta}_1 + \hat{\beta}_2)$, $\widehat{\text{Var}}(\hat{\beta}_1 - \hat{\beta}_2)$, $\widehat{\text{Var}}(\hat{\beta}_1 + \hat{\beta}_2 + \hat{\beta}_3)$, $\widehat{\text{Var}}(\hat{\beta}_1 + \hat{\beta}_2 - 2\hat{\beta}_3)$
- (n) Найдите $\widehat{\text{Corr}}(\hat{\beta}_1, \hat{\beta}_2)$, оценку коэффициента корреляции МНК-коэффициентов $\hat{\beta}_1$ и $\hat{\beta}_2$.
- (o) Найдите $s_{\hat{\beta}_1}$, стандартную ошибку МНК-коэффициента $\hat{\beta}_1$.

- (р) Рассчитайте выборочную ковариацию y и \hat{y} .
- (q) Найдите выборочную дисперсию y , выборочную дисперсию \hat{y} .
2. Априори известно, что парная регрессия должна проходить через точку (x_0, y_0) .
- (а) Выведите формулы МНК оценок;
- (б) В предположениях теоремы Гаусса-Маркова найдите дисперсии и средние оценок
3. Слитки-вариант. Перед нами два золотых слитка и весы, производящие взвешивания с ошибками. Взвесив первый слиток, мы получили результат 300 грамм, взвесив второй слиток — 200 грамм, взвесив оба слитка — 400 грамм. Предположим, что ошибки взвешивания — независимые одинаково распределенные случайные величины с нулевым средним.
- (а) Найдите несмещеную оценку веса первого шара, обладающую наименьшей дисперсией.
- (б) Как можно проинтерпретировать нулевое математическое ожидание ошибки взвешивания?
4. Вася считает, что $s\text{Cov}(y, \hat{y}) = \frac{\sum (y_i - \bar{y})(\hat{y}_i - \bar{y})}{n-1}$ это неплохая оценка для $\text{Cov}(y_i, \hat{y}_i)$. Прав ли он?
5. Сгенерировать набор данных, обладающий следующим свойством. Если попытаться сразу выкинуть регрессоры x и z , то гипотеза о их совместной незначимости отвергается. Если вместо этого попытаться выкинуть отдельно x , или отдельно z , то гипотеза о незначимости не отвергается.
6. Сгенерировать набор данных, обладающий следующим свойством. Если попытаться сразу выкинуть регрессоры x и z , то гипотеза о их совместной незначимости отвергается. Если вместо сначала выкинуть отдельно x , то гипотеза о незначимости не отвергается. Если затем выкинуть z , то гипотезы о незначимости тоже не отвергается.
7. К эконометристу Вовочке в распоряжение попали данные с результатами контрольной работы студентов по эконометрике. В данных есть результаты по каждой задаче, переменные p_1, p_2, p_3, p_4 и p_5 , и суммарный результат за контрольную, переменная kr . Чему будут равны оценки коэффициентов, их стандартные ошибки, t -статистики, P -значения, R^2 , RSS , если
- (а) Вовочка построит регрессию kr на константу, p_1, p_2, p_3, p_4 и p_5
- (б) Вовочка построит регрессию kr на p_1, p_2, p_3, p_4 и p_5 без константы
8. Как построить доверительный интервал для вершины параболы? ...
9. Про R_{adj}^2
- (а) Может ли в модели с константой R_{adj}^2 быть отрицательным?
- (б) Что больше, R^2 или R_{adj}^2 в модели с константой?
- (с) Вася оценил модель A , а затем выкинул из нее регрессор z и оценил получившуюся модель B . В моделях A и B оказались равные R_{adj}^2 . Чему равна t -статистика коэффициента при z в модели A ?
- (d) Есть две модели с одной и той же зависимой переменной, но с разными объясняющими переменными, модель A и модель B . В модели A коэффициент R_{adj}^2 больше, чем в модели B . В какой из моделей больше коэффициент $\hat{\sigma}^2$?
10. В классической линейной регрессионной модели $y_i = \beta_1 + \beta_2 x_i + \varepsilon_i$, дисперсия зависимой переменной не зависит от номера наблюдения, $\text{Var}(y_i) = \sigma^2$. Почему для оценки σ^2 вместо известной из курса математической статистики формулы $\sum (y_i - \bar{y})^2 / (n - 1)$ используют $\sum \hat{\varepsilon}_i^2 / (n - 2)$?
11. Оценка регрессии имеет вид $\hat{y}_i = 3 - 2x_i$. Выборочная дисперсия x равна 9, выборочная дисперсия y равна 40. Найдите R^2 и выборочные корреляции $s\text{Corr}(x, y)$, $s\text{Corr}(y, \hat{y})$.

12. У эконометриста Вовочки есть переменная 1_f , которая равна 1, если i -ый человек в выборке — женщина, и 0, если мужчина. Есть переменная 1_m , которая равна 1, если i -ый человек в выборке — мужчина, и 0, если женщина. Какие \hat{y} получатся, если Вовочка попытается построить регрессии:

- (a) y на константу и 1_f
- (b) y на константу и 1_m
- (c) y на 1_f и 1_m без константы
- (d) y на константу, 1_f и 1_m

13. У эконометриста Вовочки есть три переменных: r_i — доход i -го человека в выборке, m_i — пол (1 — мальчик, 0 — девочка) и f_i — пол (1 — девочка, 0 — мальчик). Вовочка оценил две модели

Модель А $m_i = \beta_1 + \beta_2 r_i + \varepsilon_i$

Модель В $f_i = \gamma_1 + \gamma_2 r_i + u_i$

- (a) Как связаны между собой оценки $\hat{\beta}_1$ и $\hat{\gamma}_1$?
- (b) Как связаны между собой оценки $\hat{\beta}_2$ и $\hat{\gamma}_2$?

14. Эконометрист Вовочка оценил линейную регрессионную модель, где y измерялся в тугриках. Затем он оценил ту же модель, но измерял y в мунгу (1 тугрик = 100 мунгу). Как изменятся оценки коэффициентов?

15. Возможно ли, что при оценке парной регрессии $y = \beta_1 + \beta_2 x + \varepsilon$ оказывается, что $\hat{\beta}_2 > 0$, а при оценке регрессии без константы, $y = \gamma x + \varepsilon$, оказывается, что $\hat{\gamma} < 0$?

16. Эконометрист Вовочка оценил регрессию y только на константу. Какой коэффициент R^2 он получит?

17. Эконометрист Вовочка оценил методом наименьших квадратов модель 1, $y = \beta_1 + \beta_2 x + \beta_3 z + \varepsilon$, а затем модель 2, $y = \beta_1 + \beta_2 x + \beta_3 z + \beta_4 w + \varepsilon$. Сравните полученные ESS , RSS , TSS и R^2 .

18. Случайные величины w_1 и w_2 независимы и нормально распределены, $N(0, 1)$. Из них составлено два вектора, $w = \begin{pmatrix} w_1 \\ w_2 \end{pmatrix}$ и $z = \begin{pmatrix} -w_2 \\ w_1 \end{pmatrix}$

- (a) Являются ли векторы w и z перпендикулярными?
- (b) Найдите $\mathbb{E}(w)$, $\mathbb{E}(z)$
- (c) Найдите $\text{Var}(w)$, $\text{Var}(z)$, $\text{Cov}(w, z)$
- (d) Рассмотрим классическую линейную модель. Являются ли векторы $\hat{\varepsilon}$ и \hat{y} перпендикулярными? Найдите $\text{Cov}(\hat{\varepsilon}, \hat{y})$.

2 МНК без матриц и вероятностей

1. Даны n пар чисел: $(x_1, y_1), \dots, (x_n, y_n)$. Мы прогнозируем y_i по формуле $\hat{y}_i = \hat{\beta} x_i$. Найдите $\hat{\beta}$ методом наименьших квадратов.
2. Даны n чисел: y_1, \dots, y_n . Мы прогнозируем y_i по формуле $\hat{y}_i = \hat{\beta}$. Найдите $\hat{\beta}$ методом наименьших квадратов.
3. Даны n пар чисел: $(x_1, y_1), \dots, (x_n, y_n)$. Мы прогнозируем y_i по формуле $\hat{y}_i = \hat{\beta}_1 + \hat{\beta}_2 x_i$. Найдите $\hat{\beta}_1$ и $\hat{\beta}_2$ методом наименьших квадратов.
4. Даны n пар чисел: $(x_1, y_1), \dots, (x_n, y_n)$. Мы прогнозируем y_i по формуле $\hat{y}_i = 1 + \hat{\beta} x_i$. Найдите $\hat{\beta}$ методом наименьших квадратов.

5. Перед нами два золотых слитка и весы, производящие взвешивания с ошибками. Взвесив первый слиток, мы получили результат 300 грамм, взвесив второй слиток — 200 грамм, взвесив оба слитка — 400 грамм. Оцените вес каждого слитка методом наименьших квадратов.
6. Аня и Настя утверждают, что лектор опоздал на 10 минут. Таня считает, что лектор опоздал на 3 минуты. С помощью мнк оцените на сколько опоздал лектор.
7. Регрессия на дамми-переменную...
8. Функция $f(x)$ дифференцируема на отрезке $[0; 1]$. Найдите аналог МНК-оценок для регрессии без свободного члена в непрерывном случае. Более подробно: найдите минимум по $\hat{\beta}$ для функции

$$Q(\hat{\beta}) = \int_0^1 (f(x) - \hat{\beta}x)^2 dx \quad (1)$$

9. Есть двести наблюдений. Вовочка оценил модель $\hat{y} = \hat{\beta}_1 + \hat{\beta}_2 x$ по первой сотне наблюдений. Петечка оценил модель $\hat{y} = \hat{\gamma}_1 + \hat{\gamma}_2 x$ по второй сотне наблюдений. Машенька оценила модель $\hat{y} = \hat{m}_1 + \hat{m}_2 x$ по всем наблюдениям.
 - (а) Возможно ли, что $\hat{\beta}_2 > 0$, $\hat{\gamma}_2 > 0$, но $\hat{m}_2 < 0$?
 - (б) Возможно ли, что $\hat{\beta}_1 > 0$, $\hat{\gamma}_1 > 0$, но $\hat{m}_1 < 0$?
 - (с) Возможно ли одновременное выполнение всех упомянутых условий?
10. Вася оценил модель $y = \beta_1 + \beta_2 d + \beta_3 x + \varepsilon$. Дамми-переменная d обозначает пол, 1 для мужчин и 0 для женщин. Оказалось, что $\hat{\beta}_2 > 0$. Означает ли это, что для мужчин \bar{y} больше, чем \bar{y} для женщин?
11. Какие из указанные моделей можно представить в линейном виде?
 - (а) $y_i = \beta_1 + \frac{\beta_2}{x_i} + \varepsilon_i$
 - (б) $y_i = \exp(\beta_1 + \beta_2 x_i + \varepsilon_i)$
 - (с) $y_i = 1 + \frac{1}{\exp(\beta_1 + \beta_2 x_i + \varepsilon_i)}$
 - (д) $y_i = \frac{1}{1 + \exp(\beta_1 + \beta_2 x_i + \varepsilon_i)}$
 - (е) $y_i = x_i^{\beta_2} e^{\beta_1 + \varepsilon_i}$

3 Инструментальные переменные

Экзогенность, $\mathbb{E}(\varepsilon | x) = 0$

Предопределённость, $\mathbb{E}(\varepsilon_t | x_t) = 0$ для всех t

1. Табличка 2 на 2. Найдите $\mathbb{E}(\varepsilon)$, $\mathbb{E}(\varepsilon|x)$, $\text{Cov}(\varepsilon, x)$.
2. Приведите примеры дискретных случайных величин ε и x , таких, что
 - (а) $\mathbb{E}(\varepsilon) = 0$, $\mathbb{E}(\varepsilon | x) = 0$, но величины зависимы. Чему в этом случае равно $\text{Cov}(\varepsilon, x)$?
 - (б) $\mathbb{E}(\varepsilon) = 0$, $\text{Cov}(\varepsilon, x) = 0$, но $\mathbb{E}(\varepsilon | x) \neq 0$. Зависимы ли эти случайные величины?
3. Все предпосылки классической линейной модели выполнены, $y = \beta_1 + \beta_2 x + \varepsilon$. Рассмотрим альтернативную оценку коэффициента β_2 ,

$$\hat{\beta}_{2,IV} = \frac{\sum z_i (y_i - \bar{y})}{\sum z_i (x_i - \bar{x})} \quad (2)$$

- (а) Является ли оценка несмещенной?
- (б) Любые ли z_i можно брать?
- (с) Найдите $\text{Var}(\hat{\beta}_{2,IV})$

4.

4 Проекция, Картинка

1. Найдите на Картинке четыре прямоугольных треугольника. Сформулируйте четыре теоремы Пифагора.
2. Покажите на Картинке TSS , ESS , RSS , R^2 , $sCov(\hat{y}, y)$
3. Предложите аналог R^2 для случая, когда константа среди регрессоров отсутствует. Аналог должен быть всегда в диапазоне $[0; 1]$, совпадать с обычным R^2 , когда среди регрессоров есть константа, равняться единице в случае нулевого $\hat{\varepsilon}$.
4. Вася оценил регрессию y на константу, x и z . А затем, делать ему нечего, регрессию y на константу и полученный \hat{y} . Какие оценки коэффициентов у него получатся? Чему будет равна оценка дисперсии коэффициента при \hat{y} ? Почему оценка коэффициента неслучайна, а оценка её дисперсии положительна?
5. При каких условиях $TSS = ESS + RSS$?

5 МЕГАМАТРИЦА

1. В рамках классической линейной модели найдите все математические ожидания и все ковариационные матрицы всех пар случайных векторов: ε , y , \hat{y} , $\hat{\varepsilon}$, $\hat{\beta}$. Т.е. найдите $\mathbb{E}(\varepsilon)$, $\mathbb{E}(y)$, \dots и $Cov(\varepsilon, y)$, $Cov(\varepsilon, \hat{y})$, \dots
2. Найдите $\mathbb{E}(\sum(\varepsilon_i - \bar{\varepsilon})^2)$, $\mathbb{E}(RSS)$
3. Используя матрицы $P = X(X'X)^{-1}X'$ и $\pi = \vec{1}(\vec{1}'\vec{1})^{-1}\vec{1}'$ запишите RSS , TSS и ESS в матричной форме
4. $\mathbb{E}(TSS)$, $\mathbb{E}(ESS)$ — громоздкие
5. Вася строит регрессию y на некий набор объясняющих переменных и константу. А на самом деле $y_i = \beta_1 + \varepsilon_i$. Чему равно $\mathbb{E}(TSS)$, $\mathbb{E}(RSS)$, $\mathbb{E}(ESS)$ в этом случае?

6 Голая линейная алгебра

Здесь будет собран минимум задач по линейной алгебре.

1. Приведите пример таких A и B , что $\det(AB) \neq \det(BA)$.
2. Для матриц-проекторов $\pi = \vec{1}(\vec{1}'\vec{1})^{-1}\vec{1}'$ и $P = X(X'X)^{-1}X'$ найдите $\text{tr}(\pi)$, $\text{tr}(P)$, $\text{tr}(I - \pi)$, $\text{tr}(I - P)$.
3. Выпишите в явном виде матрицы $X'X$, $(X'X)^{-1}$ и $X'y$, если
$$y = \begin{pmatrix} y_1 \\ y_2 \\ \vdots \\ y_n \end{pmatrix} \text{ и } X = \begin{pmatrix} 1 & x_1 \\ 1 & x_2 \\ \vdots & \vdots \\ 1 & x_n \end{pmatrix}$$
4. Выпишите в явном виде матрицы π , πy , $\pi \varepsilon$, $I - \pi$, если $\pi = \vec{1}(\vec{1}'\vec{1})^{-1}\vec{1}'$.

7 Парадигма случайных величин

1. Найдите $E(Y|X)$
2. Про многомерное нормальное распределение
- 3.

8 Гетероскедастичность

1. По наблюдениям $x = (1, 2, 3)'$, $y = (2, -1, 3)'$ оценивается модель $y = \beta_1 + \beta_2 x + \varepsilon$. Ошибки ε гетероскедастичны и известно, что $\text{Var}(\varepsilon_i) = \sigma^2 \cdot x_i^2$.
 - (a) Найдите оценки $\hat{\beta}_{ols}$ с помощью МНК и их ковариационную матрицу
 - (b) Найдите оценки $\hat{\beta}_{gls}$ с помощью обобщенного МНК и их ковариационную матрицу

9 Компьютерные упражнения

Все наборы данных доступны по ссылке <https://github.com/bdemeshev/em301/wiki/Datasets>.

1. Скачайте результаты двух контрольных работ по теории вероятностей, с описанием данных, . Наша задача попытаться предсказать результат второй контрольной работы зная позадачный результат первой контрольной, пол и группу студента.
 - (a) Какая задача из первой контрольной работы наиболее существенно влияет на результат второй контрольной?
 - (b) Влияет ли пол на результат второй контрольной?
 - (c) Влияет ли редкость имени на результат второй контрольной?
 - (d) Что можно сказать про влияние группы, в которой учится студент?
2. Задача Макара-Лиманова. У торговца 55 пустых стаканчиков, разложенных в несколько стопок. Пока нет покупателей он развлекается: берет верхний стаканчик из каждой стопки и формирует из них новую стопку. Потом снова берет верхний стаканчик из каждой стопки и формирует из них новую стопку и т.д.
 - (a) Напишите функцию 'makar_step'. На вход функции подаётся вектор количества стаканчиков в каждой стопке до переукладывания. На выходе функция возвращает количества стаканчиков в каждой стопке после одного переукладывания.
 - (b) Изначально стаканчики были разложены в две стопки, из 25 и 30 стаканчиков. Как разложатся стаканчики если покупателей не будет достаточно долго?
3. Напишите функцию, которая бы оценивала регрессию методом наименьших квадратов. На вход функции должны подаваться вектор зависимых переменных y и матрица регрессоров X . На выходе функция должна выдавать список из $\hat{\beta}$, $\widehat{\text{Var}}(\hat{\beta})$, \hat{y} , $\hat{\varepsilon}$, ESS , RSS и TSS . По возможности функция должна проверять корректность аргументов, например, что в y и X одинаковое число наблюдений и т.д.
4. Сгенерируйте вектор y из 300 независимых нормальных $N(10, 1)$ случайных величин. Сгенерируйте 40 «объясняющих» переменных, по 300 наблюдений в каждой, каждое наблюдение — независимая нормальная $N(5, 1)$ случайная величина. Постройте регрессию y на все 40 регрессоров и константу.
 - (a) Сколько регрессоров оказалось значимо на 5% уровне?
 - (b) Сколько регрессоров в среднем значимо на 5% уровне?
 - (c) Эконометрист Вовочка всегда использует следующий подход: строит регрессию зависимой переменной на все имеющиеся регрессоры, а затем выкидывает из модели те регрессоры, которые оказались незначимы. Прокомментируйте Вовочкин эконометрический подход.
5. (?) Создайте набор данных с тремя переменными y , x и z со следующими свойствами. При оценке модели $\hat{y} = \hat{\beta}_1 + \hat{\beta}_2 x$ получается $\hat{\beta}_2 > 0$. При оценке модели $\hat{y} = \hat{\gamma}_1 + \hat{\gamma}_2 x + \hat{\gamma}_3 z$ получается $\hat{\gamma}_2 < 0$. Объясните принцип, руководствуясь которым легко создать такой набор данных.

6. (?) У меня есть набор данных с выборочным средним \bar{y} и выборочной дисперсией s^2 . Как нужно преобразовать данные, чтобы выборочное среднее равнялось 7, а выборочная дисперсия — 9?
7. Мы попытаемся понять, как введение в регрессию лишнего регрессора влияет на оценки уже имеющихся. В регрессии будет 100 наблюдений. Возьмем $\rho = 0.5$. Сгенерим выборку совместных нормальных x_i и z_i с корреляцией ρ . Настоящий y_i задаётся формулой $y_i = 5 + 6x_i + \varepsilon_i$. Однако мы будем оценивать модель $\hat{y}_i = \hat{\beta}_1 + \hat{\beta}_2 x_i + \hat{\beta}_3 z_i$.
 - (a) Повторите указанный эксперимент 500 раз и постройте оценку для функции плотности $\hat{\beta}_1$.
 - (b) Повторите указанный эксперимент 500 раз для каждого ρ от -1 до 1 с шагом в 0.05 . Каждый раз сохраняйте полученные 500 значений $\hat{\beta}_1$. В осях $(\rho, \hat{\beta}_1)$ постройте 95%-ый предиктивный интервал для $\hat{\beta}_1$. Прокомментируйте.

10 Вопросы теоретического характера

1. Что означают слова автокорреляция, гетероскедастичность, гомоскедастичность?
2. Напишите формулу для оценок коэффициентов в парной регрессии без матриц
3. Напишите формулу для оценок коэффициентов в множественной регрессии
4. Аналогично для дисперсий
5. Сформулируйте теорему Гаусса-Маркова