Задачник по эконометрике-1

(с шахматами и поэтэссами)

Дмитрий Борзых, Борис Демешев

4 декабря 2012 г.

Содержание

Todo list

Опция tidy=FALSE не работает. Почему?

1 Проверка гипотез строго по уставу!

1. Условия применимости теста
2. Формулировка H_0, H_a и уровня значимости α
3. Формула расчета и наблюдаемое значения статистики, S_{obs}
4. Закон распределения S_{obs} при верной H_0
5. Область в которой H_0 не отвергается

6. Точное P-значение
7. Вывод

В качестве вывода допускается только одна из двух фраз:

- Гипотеза H_0 отвергается
- Гипотеза H_0 не отвергается

Остальные фразы считаются неуставными

2 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 $\mathrm{Var}(\varepsilon) = \sigma^2 \cdot I$. 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
$X'X = \begin{pmatrix} 5 & 2 & 1 \\ 2 & 2 & 1 \\ 1 & 1 & 1 \end{pmatrix}$ 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 $\widehat{\mathrm{Var}}(\hat{\beta})$, оценку для ковариационной матрицы вектора МНК-коэффициентов $\hat{\beta}$.
   (j) Найдите $\widehat{\mathrm{Var}}(\hat{\beta}_1)$, несмещенную оценку дисперсии МНК-коэффициента $\hat{\beta}_1$.
   (k) Найдите $\widehat{\mathrm{Var}}(\hat{\beta}_2)$, несмещенную оценку дисперсии МНК-коэффициента $\hat{\beta}_2$.
   (l) Найдите $\widehat{\mathrm{Cov}}(\hat{\beta}_1, \hat{\beta}_2)$, несмещенную оценку ковариации МНК-коэффициентов $\hat{\beta}_1$ и $\hat{\beta}_2$.
   (m) Найдите $\widehat{\mathrm{Var}}(\hat{\beta}_1 + \hat{\beta}_2)$, $\widehat{\mathrm{Var}}(\hat{\beta}_1 - \hat{\beta}_2)$, $\widehat{\mathrm{Var}}(\hat{\beta}_1 + \hat{\beta}_2 + \hat{\beta}_3)$, $\widehat{\mathrm{Var}}(\hat{\beta}_1 + \hat{\beta}_2 - 2\hat{\beta}_3)$
   (n) Найдите $\widehat{\mathrm{Corr}}(\hat{\beta}_1, \hat{\beta}_2)$, оценку коэффициента корреляции МНК-коэффициентов $\hat{\beta}_1$ и $\hat{\beta}_2$.
   (o) Найдите $s_{\hat{\beta}_1}$, стандартную ошибку МНК-коэффициента $\hat{\beta}_1$.
   (p) 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).
   (a) Выведите формулы МНК оценок;

(b) 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.

   (a) Найдите несмещеную оценку веса первого шара, обладающую наименьшей дисперсией.

   (b) Как можно проинтерпретировать нулевое математическое ожидание ошибки взвешивания?

4. Вася считает, что $\mathrm{sCov}(y, \hat{y}) = \frac{\sum (y_i - \bar{y})(\hat{y}_i - \bar{y})}{n-1}$ это неплохая оценка для $\mathrm{Cov}(y_i, \hat{y}_i)$. 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

   (a) Вовочка построит регрессию kr на константу, p_1, p_2, p_3, p_4 и p_5

   (b) 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^2_{adj}

   (a) Может ли в модели с константой R^2_{adj} быть отрицательным?

   (b) Что больше, R^2 или R^2_{adj} в модели с константой?

   (c) Вася оценил модель A, а затем выкинул из нее регрессор z и оценил получившуюся модель B. В моделях A и B оказались равные R^2_{adj}. 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^2_{adj} 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, $\mathrm{Var}(y_i) = \sigma^2$. 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 $\mathrm{sCorr}(x, y)$, $\mathrm{sCorr}(y, \hat{y})$.
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 A $m_i = \beta_1 + \beta_2 r_i + \varepsilon_i$

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

(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 $\mathrm{Var}(w)$, $\mathrm{Var}(z)$, $\mathrm{Cov}(w, z)$

(d) Рассмотрим классическую линейную модель. Являются ли векторы $\hat{\varepsilon}$ и $\hat{y}$ перпендикулярными? Найдите $\mathrm{Cov}(\hat{\varepsilon}, \hat{y})$.

19. Есть случайный вектор $w = (w_1, w_2, \ldots, w_n)'$.

(a) Возможно ли, что $E(w) = 0$ и $\sum w_i = 0$?

(b) Возможно ли, что $E(w) \neq 0$ и $\sum w_i = 0$?

(c) Возможно ли, что $E(w) = 0$ и $\sum w_i \neq 0$?

(d) Возможно ли, что $E(w) =\neq$ и $\sum w_i \neq 0$?

(e) Чему в классической модели регрессии равны: $\mathbb{E}(\varepsilon)$ и $\sum \varepsilon_i$?

(f) Чему в классической модели регрессии равны: $\mathbb{E}(\hat{\varepsilon})$ и $\sum \hat{\varepsilon}_i$?

20. Мы предполагаем, что y_t растёт с линейным трендом, т.е. $y_t = \beta_1 + \beta_2 t + \varepsilon_t$. Все предпосылки теоремы Гаусса-Маркова выполнены. В качестве оценки $\hat{\beta}_2$ предлагается $\hat{\beta}_2 = \frac{Y_T - 1}{T-1}$, где T — общее количество наблюдений.

(a) Найдите $\mathbb{E}(\hat{\beta}_2)$ и $\mathrm{Var}(\hat{\beta}_2)$

(b) Совпадает ли оценка $\hat{\beta}_2$ с классической мнк-оценкой?

(c) У какой оценки дисперсия выше, у $\hat{\beta}_2$ или классической мнк-оценки?

3 МНК без матриц и вероятностей

1. Даны n пар чисел: (x_1, y_1), ..., (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, ..., 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), ..., (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), ..., (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 $f(x)$ дифференциируема 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
$$Q(\hat{\beta}) = \int_0^1 (f(x) - \hat{\beta}x)^2 \, dx \tag{1}$$
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.
   (a) Возможно ли, что $\hat{\beta}_2 > 0$, $\hat{\gamma}_2 > 0$, но $\hat{m}_2 < 0$?
   (b) Возможно ли, что $\hat{\beta}_1 > 0$, $\hat{\gamma}_1 > 0$, но $\hat{m}_1 < 0$?
   (c) 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?
   (a) $y_i = \beta_1 + \frac{\beta_2}{x_i} + \varepsilon_i$
   (b) $y_i = \exp(\beta_1 + \beta_2 x_i + \varepsilon_i)$
   (c) $y_i = 1 + \frac{1}{\exp(\beta_1 + \beta_2 x_i + \varepsilon_i)}$
   (d) $y_i = \frac{1}{1 + \exp(\beta_1 + \beta_2 x_i + \varepsilon_i)}$
   (e) $y_i = x_i^{\beta_2} e^{\beta_1 + \varepsilon_i}$

4 Проверка простых гипотез

1. По 47 наблюдениям оценивается зависимость доли мужчин занятых в сельском хозяйстве от уровня образованности и доли католического населения по Швейцарским кантонам в 1888 году.
$$Agriculture_i = \beta_1 + \beta_2 Examination_i + \beta_3 Catholic_i + \varepsilon_i$$
   (a) Заполните пропуски в таблице

	Оценка	Ст. ошибка	t-статистика
(Intercept)		8.72	9.44
Examination	-1.94		-5.08
Catholic	0.01	0.07	

(b) Укажите коэффициенты, значимые на 10% уровне значимости.

(c) Постройте 99%-ый доверительный интервал для коэффициента при переменной Catholic

Набор данных доступен в пакете R:

```
h <- swiss
```

2. Оценивается зависимость уровня фертильности всё тех же швейцарских кантонов в 1888 году от ряда показателей. В таблице представлены результаты оценивания двух моделей. Модель 1: $Fertility_i = \beta_1 + \beta_2 Agriculture_i + \beta_3 Education_i + \beta_4 Examination_i + \beta_5 Catholic_i + \varepsilon_i$ Модель 2: $Fertility_i = \gamma_1 + \gamma_2(Education_i + Examination_i) + \gamma_3 Catholic_i + u_i$

Таблица 1:

	Model 1	Model 2
(Intercept)	91.06^*	80.52^*
	(6.95)	(3.31)
Agriculture	-0.22^*	
	(0.07)	
Education	-0.96^*	
	(0.19)	
Examination	-0.26	
	(0.27)	
Catholic	0.12^*	0.07^*
	(0.04)	(0.03)
I(Education + Examination)		-0.48^*
		(0.08)
N	47	47
R^2	0.65	0.55
adj. R^2	0.62	0.53
Resid. sd	7.74	8.56

Standard errors in parentheses

* indicates significance at $p < 0.05$

Набор данных доступен в пакете R:

```
h <- swiss
```

5 Инструментальные переменные

Экзогенность, $\mathbb{E}(\varepsilon \mid x) = 0$
Предопределённость, $\mathbb{E}(\varepsilon_t \mid x_t) = 0$ для всех t

1. Табличка 2 на 2. Найдите $\mathbb{E}(\varepsilon)$, $\mathbb{E}(\varepsilon|x)$, $\mathrm{Cov}(\varepsilon, x)$.
2. Приведите примеры дискретных случайных величин ε и x, таких, что

   (a) $\mathbb{E}(\varepsilon) = 0$, $\mathbb{E}(\varepsilon \mid x) = 0$, но величины зависимы. Чему в этом случае равно $\mathrm{Cov}(\varepsilon, x)$?

(b) $\mathbb{E}(\varepsilon) = 0$, $\mathrm{Cov}(\varepsilon, x) = 0$, но $\mathbb{E}(\varepsilon \mid x) \neq 0$. 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,

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

   (a) Является ли оценка несмещенной?

   (b) Любые ли z_i можно брать?

   (c) Найдите $\mathrm{Var}(\hat{\beta}_{2,IV})$

4.

6 Проекция, Картинка

1. Найдите на Картинке все перпендикулярные векторы. Найдите на Картинке все прямоугольные треугольники. Сформулируйте для них теоремы Пифагора.
2. Покажите на Картинке TSS, ESS, RSS, R^2, $\mathrm{sCov}(\hat{y}, y)$
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 коэффицента при $\hat{y}$? Почему оценка коэффициента неслучайна, а оценка её дисперсии положительна?
5. При каких условиях $TSS = ESS + RSS$?

7 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 $\mathbb{E}(\varepsilon)$, $\mathbb{E}(y)$, ... и $\mathrm{Cov}(\varepsilon, y)$, $\mathrm{Cov}(\varepsilon, \hat{y})$, ...
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. Известно, что $\varepsilon \sim N(0, I)$, $\varepsilon = (\varepsilon_1, \varepsilon_2, \varepsilon_3)'$. Матрица $A = \begin{pmatrix} 2/3 & -1/3 & -1/3 \\ -1/3 & 2/3 & -1/3 \\ -1/3 & -1/3 & 2/3 \end{pmatrix}$.

   (a) Найдите $\mathbb{E}(\varepsilon' A \varepsilon)$

   (b) Как распределена случайная величина $\varepsilon' A \varepsilon$?

7. Известно, что $\varepsilon \sim N(0, A)$, $\varepsilon = (\varepsilon_1, \varepsilon_2)'$. Матрица $A = \begin{pmatrix} 4 & 1 \\ 1 & 4 \end{pmatrix}$, матрица $B = \begin{pmatrix} -1 & 3 \\ 2 & 1 \end{pmatrix}$

   (a) Как распределен вектор $h = B\varepsilon$?

   (b) Найдите $A^{-1/2}$

   (c) Как распределен вектор $u = A^{-1/2}\varepsilon$?

8 Метод максимального правдоподобия

1. Выпишите в явном виде функцию максимального правдоподобия для модели $y = \beta_1 + \beta_2 x + \varepsilon$, если $\varepsilon \sim N(0, A)$. Матрица A устроена по принципу: $\mathrm{Cov}(\varepsilon_i, \varepsilon_j) = 0$ при $i \neq j$, и $\mathrm{Var}(\varepsilon_i) = \sigma^2 x_i^2$.
2. Выпишите в явном виде функцию максимального правдоподобия для модели $y = \beta_1 + \beta_2 x + \varepsilon$, если $\varepsilon \sim N(0, A)$. Матрица A устроена по принципу: $\mathrm{Cov}(\varepsilon_i, \varepsilon_j) = 0$ при $i \neq j$, и $\mathrm{Var}(\varepsilon_i) = \sigma^2 |x_i|$.

9 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 $\mathrm{tr}(\pi)$, $\mathrm{tr}(P)$, $\mathrm{tr}(I - \pi)$, $\mathrm{tr}(I - P)$.
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 $\pi = \vec{1}(\vec{1}'\vec{1})^{-1}\vec{1}'$.

10 Парадигма случайных величин

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

11 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 $\mathrm{Var}(\varepsilon_i) = \sigma^2 \cdot x_i^2$.
   (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

12 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 Макар-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 перекладывания. На выходе функция возвращает количества стаканчиков в каждой стопке после одного перекладывания.

   (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 $\hat{\beta}$, $\widehat{\mathrm{Var}}(\hat{\beta})$, $\hat{y}$, $\hat{\varepsilon}$, 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.

8. Цель задачи — оценить модель CAPM несколькими способами.

   (a) Соберите подходящие данные для модели CAPM. Нужно найти три временных ряда: ряд цен любой акции, любой рыночный индекс, безрисковый актив. Переведите цены в доходности.

   (b) Постройте графики

   (c) Оцените модель CAPM без свободного члена по всем наборам данных. Прокомментируйте смысл оцененного коэффициента

(d) Разбейте временной период на два участка и проверьте устойчивость коэффициента бета

(e) Добавьте в классическую модель CAPM свободный член и оцените по всему набору данных. Какие выводы можно сделать?

(f) Методом максимального правдоподобия оцените модель с ошибкой измерения $R^m - R^0$, т.е.

истинная зависимость имеет вид

$$(R^s - R^0) = \beta_1 + \beta_2(R^*_m - R^*_0) + \varepsilon \tag{3}$$

величины R^*_m и R^*_0 не наблюдаемы, но

$$R_m - R_0 = R^*_m - R^*_0 + u \tag{4}$$

13 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