

Raport 2

Aleksander Milach

Podpunkt i

Ilość zmiennych znaczących	Optymalne lambda
20	5.2777778
100	1.0555556
200	0.5277778

Podpunkt ii

	Lambda opt.	Bias	Wariancja	MSE
k=20	5.2777778	-2.522124	0.0253740	151.3274
k=100	1.0555556	-1.540541	0.2366691	462.1622
k=200	0.5277778	-1.036364	0.4284298	621.8182

Podpunkt iii

	Wartości krytyczne	Teoretyczna moc
k=20	0.617755	0.2082441
k=100	1.886657	0.5035336
k=200	2.538411	0.6231233

Podpunkt iii

	Bias OLS	Moc OLS	MSE OLS	Moc RR	Bias RR	MSE RR
k=20	0.0136815	0.073500	971.3985	0.27425	-2.4846021	151.3249
k=100	0.0060507	0.064150	971.3985	0.37755	-1.2958572	473.8301
k=200	0.0010702	0.064175	971.3985	0.36810	-0.7191906	654.4773

	Wariancja OLS	Wariancja RR
k=20	1.069499	0.0312590
k=100	1.023606	0.3241584
k=200	1.024786	0.5803897

Otrzymane wartości są bliskie wartościom teoretycznym obliczonym w punkcie ii. Dla k=20 wartości estymowane są najbliższe prawdziwym, najbardziej od wartości teoretycznych różnią się estymatory mocy testu kontrolującego FWER na poziomie 0.1.