

# Teste08

Guilherme Pazian

31 de maio de 2017

modelo

wage - Ganho médio por hora da esposa em dólares em 1975. educ - Formação educacional da esposa, em anos. siblings - Número de irmãos da esposa.

wage(salario) ~ educ(mulher) + siblings (irmãos) “instrumento”

Modelo 9: MQ2E, usando as observações 1–428

Variável dependente: l\_wage

Instrumentado: educ

Instrumentos: const siblings fathereduc mothereduc exper hours kidsl6  
largacity

Erros padrão robustos e heteroscedasticidade, variante HC1

	Coefficiente	Erro Padrão	razão-t	p-valor
const	0,255083	0,440924	0,5785	0,5632
educ	0,0581777	0,0345822	1,682	0,0932
exper	0,0167067	0,00437971	3,815	0,0002
hours	-5,78318e-005	6,66148e-005	-0,8682	0,3858
kidsl6	-0,0344118	0,103694	-0,3319	0,7402
largacity	0,0952688	0,0684986	1,391	0,1650
Módulo var. dependente	1,190173	D.P. var. dependente	0,723198	
Soma resíduo. quadrados	194,3264	E.P. da regressão	0,678594	
$R^2$	0,140161	$R^2$ ajustado	0,129973	
$F(5, 422)$	4,557122	P-valor( $F$ )	0,000465	

Teste de Hausman –

Hipótese nula: as estimativas por MQO são consistentes

Estatística de teste assintótica:  $\chi^2(1) = 3,02292$

com p-valor = 0,0820958

Teste de Sargan para a sobre-identificação –

Hipótese nula: todos os instrumentos são válidos

Estatística de teste: LM = 0,584092

com p-valor =  $P(\chi^2(2) > 0,584092) = 0,746734$

Teste de instrumento fraco –

First-stage  $F(3, 420) = 30,4599$

Modelo 10: MQ2E, usando as observações 1–428  
 Variável dependente: l\_wage  
 Instrumentado: educ  
 Instrumentos: const siblings fathereduc mothereduc exper  
 Erros padrão robustos à heteroscedasticidade, variante HC1

	Coeficiente	Erro Padrão	razão-t	p-valor
const	0,171469	0,423132	0,4052	0,6855
educ	0,0645310	0,0330625	1,952	0,0516
exper	0,0154796	0,00414108	3,738	0,0002
Média var. dependente	1,190173	D.P. var. dependente	0,723198	
Soma res² d. quadrados	194,7016	E.P. da regressão	0,676847	
$R^2$	0,140122	$R^2$ ajustado	0,136075	
$F(2, 425)$	8,586489	P-valor( $F$ )	0,000221	

Teste de Hausman –

Hipótese nula: as estimativas por MQO são consistentes

Estatística de teste assintótica:  $\chi^2(1) = 2,74038$

com p-valor = 0,0978414

Teste de Sargan para a sobre-identificação –

Hipótese nula: todos os instrumentos são válidos

Estatística de teste: LM = 0,828443

com p-valor =  $P(\chi^2(2) > 0,828443) = 0,660854$

Teste de instrumento fraco –

First-stage  $F(3, 423) = 33,8202$