

Praca 3. Regresja liniowa dla log-zwrotów

Dla log-zwrotów dwóch spółek, za okres 2020-2021, wykonaj następujące analizy.

A. Przedziały ufności dla wartości oczekiwanej

Wyznacz przedziały ufności, dla wartości oczekiwanych log-zwrotów obu spółek. W zależności od tego, czy spełnione są założenia, wykorzystaj Model 1 lub Model 2 (wybór uzasadnij).

B. Regresja liniowa

1. Dla log-zwrotów (R_1, R_2) analizowanych spółek, wyznacz prostą regresji $R_2 = b_0 + b_1 \cdot R_1$, przeanalizuj reszty. Omów precyzyjnie wyniki modelu.
2. Wykonaj predykcję wielkości log-zwrotów spółki S_2 , gdy log-zwroty spółki S_1 będą na poziomie średniej z posiadanej próby. Podaj przedziały ufności dla tej predykcji.

- Przeprowadzona analiza stanowi trzeci rozdział *Projektu egzaminacyjnego*. Cały *Projekt egzaminacyjny* (trzy części) ładnie redagujemy, uzupełniamy o *Wstęp*, *Podsumowanie* i *Spis treści*.
- Podobnie porządkujemy kod w R – jeden skrypt zawiera kod do trzech części projektu.
- *Projekt egzaminacyjny* zamieszczamy na PE do 29.01.2023 (trzy pliki, bez kompresji: Nazwisko_Nazwisko.pdf, Nazwisko_Nazwisko.tex, Nazwisko_Nazwisko.R).