Quiz 2

Diga se as afirmativas abaixo são verdadeiras ou falsas. Procure não tentar adivinhar porque duas respostas dadas incorretamente anulam uma dada corretamente. Não tem punição para questões não respondidas.

1. No modelo de regressão múltipla o nunca será maior do que o V
2. Sob multicolinearidade imperfeita o estimador de MQO é viesado mesmo em amostras com n>100 F
3. Quando existem variáveis omitidas na regressão, que são determinantes da variável dependente, o estimador de MQO é viesado se a variável omitida é correlacionada com a variável incluída na regressão V
4. No modelo de regressão múltipla estimamos o efeito sobre da mudança em uma unidade de , enquanto mantemos as demais variáveis explicativas constantes. Isso corresponde a tirar uma derivada parcial em matemática. V
5. Num modelo de regressão com duas variáveis independentes, se excluímos uma das variáveis relevantes então não é mais razoável assumir que os erros são homocedásticos F
6. Os resíduos de MQO no modelo de regressão múltipla podem ser calculados subtraindo-se os valores ajustados dos valores efetivos V
7. Viés de variável omitida irá sempre estar presente quando F
8. No modelo de regressão múltipla o desvio-padrão do erro é dado por F
9. A razão para incluir variáveis de controle em regressões múltiplas é aumentar o da regressão F
10. De acordo com a seguinte regressão:

= 323,70 - 169,78mulher + 5,15idade

= 0,135

à medida que os indivíduos se tornam um ano mais velhos eles ganham $5,15 a mais V

1. De acordo com a seguinte regressão:

= 323,70-169,78mulher + 5,15idade

= 0,135

idade explica 13,5% da variação em salário F

1. Seja = 42,026 -19,863 -0,1611

-19,863 -10,184 -0,05402

-0,1611 -0,0540 0,02787

A é 0,02787 e a = -19,863 ANULADA

1. Não é possível incluir termos quadráticos ou cúbicos como variáveis independentes em uma regressão múltipla, pois isso viola a hipótese de Gauss-Markov de linearidade dos parâmetros F
2. No modelo:

,

o efeito parcial de *educ* sobre o salário é igual a , e o efeito parcial de *idade* é igual a F

1. De acordo com a seguinte regressão:

um aumento de 1% nas vendas está associado a um aumento de 0,257% no salário V

1. Suponha o seguinte modelo populacional para o salário:

, em que e *educ* e *habilidade* são positivamente correlacionados. Caso seja estimada a regressão , o valor estimado para será maior do que o valor verdadeiro. V

1. O modelo respeita as hipóteses de Gauss-Markov. F
2. Uma vantagem do é impor uma penalidade por adicionar variáveis independentes ao modelo. V
3. A inclusão de uma variável irrelevante no modelo causa viés no estimador e aumenta a variância. F
4. A presença de heterocedasticidade faz com que o estimador de MQO seja viesado.

F