

Análisis Estadístico Multivariado | UTDT

Problem Set 6

Alejandra Clemente

Fiona Franco Churruarín

Segundo Trimestre 2023

Ejercicio 1

Estime el modelo factorial para la base de datos *eurosec.dta*, de acuerdo con el número de factores resultantes del proceso de selección de modelos introducido por Schwarz (1978). Obtenga, luego, la matriz ortogonal $C_{m \times m}$ verificando que las cargas asociadas a cada factor presenten la máxima varianza posible. Finalmente, estime el vector de factores correspondiente al ajuste efectuado.

Ejercicio 2

Aplice el contraste empleado en el primer ejercicio a los datos correspondientes al Problem Set anterior. Explique brevemente el resultado obtenido. ¿Cuáles son sus conclusiones al respecto?

Ejercicio 3

Estime un modelo factorial empleando la base *sachs.dta*, extracto de Gallup, Sachs & Mellinger (1999).

Ejercicio 4

En base a los datos empleados por la Fundación Heritage para construir el *Freedom Index 2010*, contenidos en la base *heritage.dta*, ajustar un modelo factorial y comentar brevemente los resultados obtenidos.