

Esercitazione ripasso1 DM

Il file dati.mat contiene i valori di chiusura giornaliera dei seguenti titoli:

- a) apple
- b) microsoft
- c) intel
- d) nike

La lunghezza del campione è di 731 dati (biennio 2009-2010).

- 1) Identificare un modello di regressione multipla (con costante di depolarizzazione) che leghi i titoli apple, microsoft e nike (variabili indipendenti) al titolo intel (variabile dipendente)
- 2) Calcolare gli intervalli di confidenza dei parametri stimati.
- 3) Calcolare correlazione e mse del modello stimato
- 4) Applicare (comando stepwisefit) la feature selection (partendo dal modello vuoto) utilizzando penter=0.01 e premove=0.1, stimandone i parametri e calcolandone correlazione e mse
- 5) Quale è il titolo che ha maggiore influenza per il calcolo del valore del titolo intel? Perché?
- 6) Stimare i parametri del modello avente come unico input quello della risposta 5 e calcolarne correlazione e MSE