

Econometria 1

Pedro Henrique Rocha Mendes *

Prova 2

```
# bibliotecas utilizadas

library(tidyverse)
library(knitr)
library(janitor)
library(kableExtra)

# removendo notação científica
options(scipen = 999)
```

- ☒ 1
- ☒ 2
- ☒ 3
- ☒ 4
- ☐ 5

1)

Um pesquisador estimou a FRP que se encontra na tabela 1. Trata-se de uma equação minceriana em que o salário horário é a variável dependente e as variáveis independentes correspondem a características dos(as) trabalhadores(as). Foi utilizada uma subamostra aleatória da PNAD anual de 2015.

1) a.

Os resultados podem ser visualizados na tabela 1. Preencha as três últimas colunas, inserindo, para cada variável independente, (i) o valor observado da estatística t de Student, (ii) o p-valor correspondente para o teste bilateral de significância individual e (iii) o símbolo de significância adequado. A última informação deve ser incorporada de acordo com a seguinte simbologia: (a)

*RA: 11201811516, Turno: Noite

*+, para significativo a um nível de significância de 10% mas não para níveis de significância de 5% ou 1%, (b) *, para significativo a 5% mas não para nível de significância de 1%, e (c) **, para significativo a nível de significância igual ou menor do que 1% (OBS: o erro padrão é a raiz do estimador não-viesado para a variância do estimador de mínimos quadrados ordinários para o coeficiente). Em caso de significância a nível superior a 10%, deixar a célula em branco.*

```
tabelal <- readr::read_delim("provas/p2/tabelas/tabelal.csv",
                             delim = ";") |>
  janitor::clean_names()

k <- nrow(tabelal)

n <- 1000

tabelal |>
  dplyr::mutate(estat_t = estimativa_pontual/erro_padrao) |>
  dplyr::mutate(p_valor = purrr::map_dbl(
    estat_t,
    ~ round(2 * pt(.x/2, df = n-k-1, lower.tail = F), 4)
  )) |>
  dplyr::mutate(signific = dplyr::case_when(
    p_valor < 0.01 ~ "**",
    p_valor < 0.05 & p_valor != "**" ~ "*",
    p_valor < 0.1 & (p_valor != "**" | p_valor != "*") ~ "+",
    p_valor > 0.1 ~ " "
  )) |>
  dplyr::mutate(
    dplyr::across(
      2:5,
      ~ round(.x, 4)
    )
  ) |>
  knitr::kable(
    caption = "Resultados da estimação da FRP",
    booktabs = T,
    linesep = "",
    format.args = list(big.mark = ".", decimal.mark = ','),
    col.names = c("Variável",
                  "Estimativa pontual",
                  "Erro padrão",
                  "Estatística t",
                  "p-valor",
                  "Significância")) |>
  kableExtra::kable_styling(font_size = 9,
                             latex_options = "HOLD_position")
```

Tabela 1: Resultados da estimação da FRP

Variável	Estimativa pontual	Erro padrão	Estatística t	p-valor	Significância
Intercepto	0,5705	1,4192	0,4020	0,8407	
Etnia preta ou parda	-0,7696	0,4036	-1,9067	1,6593	
Educação (anos de estudo)	0,6733	0,0582	11,5752	0,0000	**
Experiencia no mercado de trabalho	0,2660	0,0545	4,8771	0,0149	*
Experiência no mercado de trabalho ao quadrado	-0,0045	0,0011	-4,0035	1,9544	
Experiência no emprego atual	0,1705	0,0309	5,5132	0,0059	**
Atividade agropecuária (binária)	0,1489	1,2283	0,1212	0,9517	
Atividade industrial (binária)	0,3496	0,7398	0,4726	0,8133	
Atividade construção civil (binária)	0,9667	0,9529	1,0145	0,6121	
Atividade serviços sociais (binária)	0,8554	0,7203	1,1875	0,5528	
Atividade outros serviços (binária)	-0,8838	0,6300	-1,4028	1,5168	
Atividade administração pública (binária)	3,6075	0,9053	3,9850	0,0466	*
Pessoa de referência na família (binária)	0,8102	0,3961	2,0452	0,3068	
Realiza afazeres domésticos (binária)	-0,8771	0,4064	-2,1580	1,7191	
Região Norte (binária)	-2,3885	0,7543	-3,1665	1,8863	
Região Nordeste (binária)	-2,3135	0,6708	-3,4489	1,9151	
Região Sudeste (binária)	-0,7238	0,6420	-1,1273	1,4269	
Região Sul (binária)	-0,7514	0,7116	-1,0560	1,4024	
Área urbana (binária)	1,5331	0,7833	1,9574	0,3280	

1) b.

O R^2 ordinário foi de 0,2951, com tamanho (sub)amostral equivalente a 1.000. Com base nisso e na tabela acima, aplique o teste de significância global a 5%, informando (e justificando):

- *O valor observado da estatística;*
- *O p-valor;*
- *Se é correto ou não rejeitar a hipótese nula.*

```
r2 <- 0.2951

f <- round((r2/k) / ((1-r2) / (n-k-1)), 4)

pvalor <- round(pf(f, df1 = k, df2 = n-k-1, lower.tail = F), 4)

tibble::tibble(parametro = c("$R^2$", "F", "p-valor"),
               valores = c(r2, f, pvalor)) |>
  knitr::kable(
    booktabs = T,
    escape = F,
    col.names = c(),
    format.args = list(decimal.mark = ",") |>
    kableExtra::kable_styling(font_size = 9,
                              latex_options = "HOLD_position") |>
    kableExtra::footnote(general = "Conclusão: Rejeita-se $H_0$",
                        general_title = "",
                        escape = F)
```

R^2	0,2951
F	21,5931
p-valor	0,0000
Conclusão: Rejeita-se H_0	

2)

A tabela 2 apresenta parte dos resultados da estimação de duas equações que explicam a extensão de terra ocupada com culturas agrícolas exceto por soja, milho ou cana-de-açúcar (“outras culturas”), em microrregiões brasileiras.

2) a.

Informe, para o teste de significância individual bicaudal, a região crítica para os seguintes níveis de significância, arredondando após a segunda casa decimal:

```
tabela2 <- readr::read_csv("provas/p2/tabelas/tabela2.csv") |>
  janitor::clean_names()

k <- 17

n <- 558

f <- 31.85

t <- tibble::tibble(alfa = c(0.1, 0.05, 0.01)) |>
  dplyr::mutate(limite_inferior = purrr::map_dbl(
    alfa,
    ~ round(qt(.x/2, df = n-k-1, lower.tail = T), 2)
  ),
  limite_superior = abs(limite_inferior))

t |>
  dplyr::mutate(
    dplyr::across(
      2:3,
      as.character
    ),
    a = "$(-\\infty;",
    b = "]",
    c = "[",
    d = ";\\infty)$") |>
  tidyr::unite(a, limite_inferior, b,
    col = "limite_inferior",
    sep = "",
    remove = T) |>
  tidyr::unite(c, limite_superior, d,
    col = "limite_superior",
    sep = "",
    remove = T) |>
  tidyr::unite(limite_inferior, limite_superior,
    col = "rc",
```

```

      sep = "\\cup",
      remove = T) |>
dplyr::mutate(
  rc = purrr::map_chr(
    rc,
    ~ stringr::str_replace_all(
      string = .x,
      pattern = "\\.",
      replacement = "{,}")
  )
) |>
knitr::kable(
  format.args = list(big.mark = ".", decimal.mark = ','),
  booktabs = T,
  linesep = "",
  col.names = c("$\\alpha$", "Região crítica"),
  escape = F) |>
kableExtra::kable_styling(font_size = 11,
                           latex_options = "HOLD_position")

```

α	Região crítica
0,10	$(-\infty; -1,65] \cup [1,65; \infty)$
0,05	$(-\infty; -1,96] \cup [1,96; \infty)$
0,01	$(-\infty; -2,58] \cup [2,58; \infty)$

2) b.

Informe, para o teste de significância global bicaudal¹, a região crítica para os seguintes níveis de significância, arredondando após a segunda casa decimal:

```

f <- tibble::tibble(alfa = c(0.1, 0.05, 0.01)) |>
dplyr::mutate(f = purrr::map_dbl(
  alfa,
  ~ round(qf(.x, df1 = k, df2 = n-k-1, lower.tail = F), 2)
))

f |>
dplyr::mutate(
  dplyr::across(
    2,
    as.character
  ),
  a = "$[",
  b = ";\infty)$") |>
tidyr::unite(a, f, b,
             col = "rc",
             sep = "") |>
knitr::kable(
  format.args = list(big.mark = ".", decimal.mark = ','),
  col.names = c("$\\alpha$", "Região crítica"),
  booktabs = T,

```

¹Imagino que o correto seja o teste F unicaudal, já que a distribuição F é assimétrica e sempre positiva.

```

linesep = "",
escape = F) |>
kableExtra::kable_styling(font_size = 11,
                           latex_options = "HOLD_position")

```

α	Região crítica
0,10	$[1.47; \infty)$
0,05	$[1.64; \infty)$
0,01	$[2; \infty)$

2) c.

Considerando (i) testes de significância individual bicaudais e (ii) o teste de significância global com base na estatística F bicaudal, preencha a quarta coluna da tabela 2 (“Simbologia”) com a seguinte simbologia:

- Explicativa significativa a 1% ou menos: escrever o número “1”;
- Explicativa significativa a 5% mas não significativa a 1%: escrever o número “5”;
- Explicativa significativa a 10% mas não significativa a 5% e nem a 1%: escrever o número “10”;
- Explicativa não significativa a 10% ou a 5% ou a 1%: escrever a letra “N”;

```

tabela2 |>
  dplyr::mutate(simbologia = dplyr::case_when(
    !dplyr::between(estatistica_t,
                    t$limite_inferior[3],
                    t$limite_superior[3]) ~ "1",
    !dplyr::between(estatistica_t,
                    t$limite_inferior[2],
                    t$limite_superior[2]) & estatistica_t != "10" ~ "5",
    !dplyr::between(estatistica_t,
                    t$limite_inferior[1],
                    t$limite_superior[1]) & (estatistica_t != "10" & estatistica_t != "5") ~ "10",
    (estatistica_t != "1" | estatistica_t != "5" & estatistica_t != "10") ~ "N")) |>
  knitr::kable(
    caption = "Regressão explicando a área de outras culturas,
microrregiões brasileiras",
    format.args = list(big.mark = ".", decimal.mark = ','),
    booktabs = T,
    linesep = "",
    col.names = c("Variável", "$\\beta$", "Estatística t", "Simbologia"),
    escape = F) |>
  kableExtra::kable_styling(font_size = 9,
                             latex_options = "HOLD_position")

```

Tabela 2: Regressão explicando a área de outras culturas, microrregiões brasileiras

Variável	β	Estatística t	Simbologia
Preço de soja	9.894,47	0,68	N
Preço de milho	-16.909,80	-0,85	N
Preço de cana-de-açúcar	40.212,66	2,19	5
Preço de outras culturas	-0,19	-0,51	N
Preço de produtos florestais	-33.198,00	-2,09	5
Preço da terra	-268,26	-0,24	N
Preço do trabalho	-1.020,26	-3,31	1
Temperatura Dez-Jan-Fev	-31.752,74	-3,80	1
Temperatura Mar-Abr-Mai	35.987,36	3,59	1
Temperatura Jun-Jul-Ago	-14.920,47	-1,99	5
Temperatura Set-Out-Nov	4.685,87	0,69	N
Precipitação Dez-Jan-Fev	-133,71	-1,12	N
Precipitação Mar-Abr-Mai	176,81	1,44	N
Precipitação Jun-Jul-Ago	-81,37	-0,69	N
Precipitação Set-Out-Nov	64,61	0,51	N
Área total	0,00	1,53	N
Valor médio da variável dependente na vizinhança	0,05	1,70	10
Constante	171.399,00	2,34	5

3)

Com dados da PNAD 2015 foram rodadas regressões de Mincer separadamente para as cinco regiões brasileiras. A hipótese de que a etnia tem influência sobre a remuneração foi submetida à refutação a partir de um teste de significância conjunta para variáveis binárias indicando autodeclarados brancos (d_bca), negros (d_negro) e pardos (d_pardo). Formalmente, trata-se do teste abaixo:

$$H_0 : \beta_{d_bca} = \beta_{d_negro} = \beta_{d_pardo} = 0 \text{ vs. } H_1 : \beta_{d_bca} \neq 0 \text{ ou } \beta_{d_negro} \neq 0 \text{ ou } \beta_{d_pardo} \neq 0$$

Os valores da estatística F para o teste unicaudal e respectivos graus de liberdade constam na tabela 3. Preencha as duas últimas linhas da tabela 3 conforme indicado. Considere para isso um nível de significância de 5%. Arredonde os valores críticos a partir da quinta casa decimal. Na última linha da tabela 3, marque “S” caso o valor da estatística F seja desfavorável, a um nível de significância de 5%, à hipótese nula, e marque “N” se o valor da estatística F for favorável à hipótese nula.

```
tabela3 <- readr::read_csv("provas/p2/tabelas/tabela3.csv") |>
  janitor::clean_names()

#' s = número de restrições impostas ao modelo restrito, e
#' como são cinco regressões, cada uma com três variáveis
```

```

#' e não tem informações sobre o número total de coeficientes
#' no enunciado, s é igual ao número de coeficientes listados
#' na hipótese nula e o modelo se torna de significância global

s <- 3

tabela3 |>
  dplyr::mutate(
    valor_critico = purrr::map_dbl(
      gl_do_denominador_de_f,
      ~ round(qf(0.05, df1 = s, df2 = .x, lower.tail = F), 4)
    ),
    signific = dplyr::case_when(
      estatistica_f > valor_critico ~ "S",
      TRUE ~ "N"
    )
  ) |>
  knitr::kable(
    caption = "Resultados dos testes de significância conjunta
para as três medidas de etnia, cinco regiões brasileiras",
    booktabs = T,
    linesep = "",
    format.args = list(big.mark = ".", decimal.mark = ','),
    col.names = c("Estado",
                  "Estatística F",
                  "G. L. do denominador de F",
                  "Valor crítico",
                  "Rejeita $H_0$?"),
    escape = F) |>
  kableExtra::kable_styling(font_size = 9,
                             latex_options = "HOLD_position")

```

Tabela 3: Resultados dos testes de significância conjunta para as três medidas de etnia, cinco regiões brasileiras

Estado	Estatística F	G. L. do denominador de F	Valor crítico	Rejeita H_0 ?
Norte	17,5949	12.294	2,6056	S
Nordeste	23,7029	21.734	2,6053	S
Sudeste	104,4111	30.219	2,6052	S
Sul	20,9448	16.125	2,6055	S
Centro-Oeste	17,5349	10.886	2,6057	S

4)

Em cada um dos cinco itens a seguir há afirmações sobre propriedades assintóticas do estimador de MQO para o vetor de parâmetros da FRP, $\hat{\beta}_{MQO}$, e também para procedimentos de inferência relacionados. Em cada item, selecione a única afirmação correta e justifique sua escolha.

4) a.

Quanto às diferenças entre as propriedades de ausência de viés e consistência, referentes à $\hat{\beta}_{MQO}$, é correto afirmar que:

- ☐ Apesar das duas propriedades serem assintóticas, ou seja, válidas apenas para amostra de tamanho infinito, elas diferem por dizerem respeito à estatísticas distintas. Ausência de viés diz respeito à expectativa do estimador, enquanto consistência diz respeito ao limite em probabilidade (“plim”) do estimador;
- ☒ Apenas a propriedade de consistência é assintótica, ou seja, válida apenas para amostra de tamanho infinito, e não há diferença entre as duas propriedades em termos das estatísticas a que se referem, pois ambas dizem respeito, exclusivamente, à expectativa do estimador;
- ☐ Apenas a propriedade de consistência é assintótica, ou seja, válida apenas para amostra de tamanho infinito e, além disso, as duas propriedades diferem por dizerem respeito à estatísticas distintas. Ausência de viés diz respeito à expectativa do estimador, enquanto consistência diz respeito ao limite em probabilidade (“plim”) estimador.

4) b.

Examine em detalhe a demonstração para a consistência do estimador de MQO exibida a seguir e responda, posteriormente, as perguntas quanto às passagens lógicas numeradas.

$$\begin{aligned}\text{plim} \left(\hat{\beta}_{MQO} \right) &= \beta + \text{plim} \left[\left(\sum_{i=1}^N x_i x_i^\top \right)^{-1} \sum_{i=1}^N x_i u_i \right] \\ &= \beta + \text{plim} \left[\left(\sum_{i=1}^N x_i x_i^\top \right)^{-1} \right] \text{plim} \left(\sum_{i=1}^N x_i u_i \right) = \{1\} \\ &= \beta + E \left(x_i x_i^\top \right)^{-1} E \left(x_i u_i \right)\end{aligned}$$

$$\text{plim} \left(\hat{\beta}_{MQO} \right) = \beta + E \left(x_i x_i^\top \right)^{-1} E \left(x_i u_i \right) \quad (A)$$

$$\begin{aligned}E \left(x_i u_i \right) &= \{2\} = E \left[E \left(x_i u_i \mid x_i \right) \right] = \{3\} = E \left[x_i E \left(u_i \mid x_i \right) \right] = \{4\} = E \left(x_i 0 \right) = 0 \\ &\rightarrow E \left(x_i u_i \right) = 0 \quad (B)\end{aligned}$$

Combinando (A) e (B), tem-se: $\text{plim} \left(\hat{\beta}_{MQO} \right) = \beta$.

A passagem {1} faz uso do seguinte fato (assinalar apenas uma alternativa):

- ☒ O “plim” da média amostral é equivalente à expectativa;
- ☐ A fórmula do estimador de mínimos quadrados ordinários é $\hat{\beta}_{MQO} = \beta + \left(\sum_{i=1}^N x_i x_i^\top \right)^{-1} \sum_{i=1}^N x_i u_i$.

As passagens {2} e {3} consistem em:

- ☐ Aplicação da lei das expectativas iteradas e consideração de que as variáveis explicativas, e, portanto, o vetor x_i são não-aleatórios, sendo, pois, constantes para a expectativa;
- ☐ Aplicação da expectativa a uma constante nula e consideração de que as variáveis explicativas e, portanto, o vetor x_i , deixam de ser aleatórios ao condicionar-se a expectativa em um valor específico (e, pois, constante) para tal vetor (e, consequentemente, em valores constantes para todas as explicativas);
- ☒ Aplicação da lei das expectativas iteradas e consideração de que as variáveis explicativas e, portanto, o vetor x_i , deixam de ser aleatórios ao condicionar-se a expectativa em um valor específico (e, pois, constante) para tal vetor (e, consequentemente, em valores constantes para todas as explicativas);

A passagem {4} consiste em:

- ☒ Hipótese de exogeneidade do modelo clássico de regressão linear;
- ☐ Hipótese de homocedasticidade do modelo clássico de regressão linear;
- ☐ Fato de que a expectativa do termo de perturbação é sempre nula, ou seja, $E(u_i) = 0, i = 1, \dots, N$;

4) c.

Conhecer a função de distribuição de probabilidade do estimador de MQO referente à situação em que o tamanho amostral é infinito é necessário pois:

- ☐ Mesmo sendo plenamente conhecida a função de distribuição de probabilidade do estimador de MQO para um tamanho amostral finito, é necessário, de maneira a ter conhecimento completo de tal função, também estudar a situação de tamanho amostral infinito;
- ☒ A função de distribuição de probabilidade do estimador de MQO para um tamanho amostral finito é desconhecida, a menos que seja assumida a hipótese de Gauss-Markov segundo a qual o termo de perturbação tem distribuição normal. É exatamente por conta da necessidade de conhecer a função em questão, no caso geral em que a hipótese de Gauss-Markov não necessariamente se aplica, que o estudo da situação com amostra infinita é necessário;

4) d.

Tenha-se em vista o teste em que se procura determinar se algumas das variáveis independentes, referidas doravante como “variáveis-alvo” são conjuntamente significativas. Seja denominada por regressão irrestrita aquela com o conjunto completo de variáveis explicativas e por regressão restrita aquela em que são excluídas as variáveis-alvo. Nesse sentido:

- ☐ O teste com base na estatística F compara as somas dos quadrados dos resíduos das regressões restrita e irrestrita. Neste caso, para calcular o valor crítico, é necessário saber apenas o número de variáveis-alvo. Já o teste do multiplicador de Lagrange consiste em calcular o R^2 dos resíduos da regressão restrita contra o conjunto completo de explicativas. Este último teste também toma por base a função de distribuição de probabilidades F de Snecedor e, para calcular o valor crítico, é preciso saber apenas o número de variáveis alvo.
- ☒ O teste com base na estatística F compara as somas dos quadrados dos resíduos das regressões restrita e irrestrita. Neste caso, para calcular o valor crítico, é necessário saber tanto o número de variáveis-alvo como o número de graus de liberdade calculado como subtração do tamanho amostral pelo número de parâmetros do modelo irrestrito. Já o teste do multiplicador de Lagrange consiste em calcular o R^2 dos resíduos da regressão restrita contra o conjunto completo de explicativas. Este último teste toma por base a função de distribuição de probabilidades qui-quadrado e, para calcular o valor crítico, é preciso saber apenas o número de variáveis-alvo.
- ☐ O teste com base na estatística F consiste em calcular o R^2 dos resíduos da regressão restrita contra o conjunto completo de explicativas. Neste caso, para calcular o valor crítico, é necessário saber tanto o número de variáveis-alvo como o número de graus de liberdade calculado como subtração do tamanho amostral pelo número de parâmetros do modelo irrestrito. Já o teste do multiplicador de Lagrange compara as somas dos quadrados dos resíduos das regressões restrita e irrestrita. Este último teste toma por base a função de distribuição de probabilidades qui-quadrado e, para calcular o valor crítico, é preciso saber apenas o número de variáveis-alvo.

5)

Utilize o teorema de Frisch-Waugh para demonstrar que, para um modelo de regressão múltipla com K variáveis explicativas, a fórmula do estimador do coeficiente da k -ésima explicativa é:

$$\hat{\beta}_{MQO_k} = \frac{\sum_{i=1}^N \tilde{x}_{ik} y_i}{(1 - R_k^2) \sum_{i=1}^N (x_{ik} - \bar{x}_k)^2}$$

Sendo \tilde{x}_{ik} o i -ésimo resíduo da regressão em que a k -ésima explicativa é a variável dependente e as variáveis independentes são as demais explicativas e R_k^2 é o coeficiente de determinação (não-ajustado) dessa regressão. Desconsidere, ao aplicar o teorema, o estágio em que y é regredida contra todas as explicativas exceto pela k -ésima.