

### Семинар 6.

1. Рассмотрим модель бинарного выбора  $P(y_t = 1) = F(\alpha + \beta d_t)$ , где  $d$  – фиктивная переменная (принимая значения 0 и 1). Ниже представлены результаты 100 наблюдений:

	$y = 0$	$y = 1$
$d = 0$	20	32
$d = 1$	36	12

- (a) Оцените параметры  $\alpha$ ,  $\beta$ , используя logit-модель.  
(b) Проверьте гипотезу  $H_0 : \beta = 0$  с помощью LM, LR и W.

### Список используемой литературы.

Магнус Я.Р., Катышев П.К., Пересецкий А.А. (2007). Эконометрика. Начальный курс : учебник для вузов.