

Семинар 24.

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

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

- (a) Оцените параметры α , β , используя logit-модель.
- (b) Проверьте гипотезу $H_0 : \beta = 0$ с помощью LR теста.
2. Методом максимального правдоподобия оценили логит-модель

$$\hat{y}_i^* = 2 + 3x_i - 5z_i.$$

- (a) Оцените вероятность того, что $y = 1$ для $x = 15$, $z = 9$.
- (b) Оцените предельный эффект увеличения x на единицу на вероятность того, что $y = 1$ для $x = 15$, $z = 9$.
- (c) Рассчитайте отношение шансов для переменной x .
- (d) При каком значении x предельный эффект увеличения x на единицу в точке $z = 9$ будет максимальным?