

Семинар 13.

Выбор функциональной зависимости.

1. Пусть X — цена мороженого, а Y — дневная выручка от продаж мороженого. Оценивание регрессии вида

$$Y_i = \beta_0 + \beta_1 X_i + \beta_2 X_i^2 + \varepsilon_i$$

дало следующий результат:

Dependent Variable: Y				
Method: Least Squares				
Sample: 1 50				
Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	100.2079	1.967171	50.94010	0.0000
X	10.03677	0.903745	11.10576	0.0000
X2	-0.817382	0.084591	-9.662803	0.0000
R-squared	0.765563	Mean dependent var	123.4150	
Adjusted R-squared	0.755587	S.D. dependent var	8.089480	
S.E. of regression	3.999287	Akaike info criterion	5.668234	
Sum squared resid	751.7320	Schwarz criterion	5.782955	
Log likelihood	-138.7058	Hannan-Quinn criter.	5.711920	
F-statistic	76.74024	Durbin-Watson stat	1.738403	
Prob(F-statistic)	0.000000			

Coefficients covariance matrix			
	C	X	X2
C	3.869764	-1.598561	0.134292
X	-1.598561	0.816755	-0.074654
X2	0.134292	-0.074654	0.007156

Найдите 95%-ый доверительный интервал для значения цены $X = X_0$, при котором выручка максимальна.

2. Для 400 голландских магазинов модной одежды с помощью трёх моделей оценили зависимость продаж в расчете на квадратный метр в гульденах, $Sales$, от:

- общей площади магазина, $Size$, в m^2 ;
- количества сотрудников, работающих целый день, $Nfull$;
- количества временных рабочих, $Ntemp$;
- дамми-переменной $Owner$, равной единице, если собственник один, и нулю иначе.

$$\widehat{Sales}_i = 6083 - 15.25Size_i + 1452.8Nfull_i + 420.15Ntemp_i - 1464.1Owner_i$$

(718) (1.59) (171) (423) (361)

$$\ln \widehat{Sales}_i = 8.59 - 0.0024Size_i + 0.183Nfull_i + 0.102Ntemp_i - 0.209Owner_i$$

(0.11) (0.00024) (0.026) (0.066) (0.056)

$$\ln \widehat{Sales}_i = 10.08 - 0.31 \ln Size_i + 0.22 \ln Nfull_i + 0.066 \ln Ntemp_i - 0.19 \ln Owner_i$$

(0.21) (0.043) (0.061) (0.118) (0.059)

В скобках приведены стандартные ошибки.

- (а) Дайте интерпретацию коэффициента при переменной *Size* в каждой из трёх моделей;
- (б) Подробно опишите, как выбрать наилучшую из этих моделей.
3. По данным для 23 демократических стран оценили зависимость индекса Джини от ВВП на душу населения с учетом ППС (паритета покупательной способности). Затем провели тест Рамсея.
- (а) Сформулируйте нулевую и альтернативную гипотезу теста Рамсея.
- (б) Опишите пошагово, как проводится тест Рамсея.
- (в) Прокомментируйте результаты теста Рамсея.

```
. reg gini gdp if democ==1
```

Source	SS	df	MS
Model	506.853501	1	506.853501
Residual	815.572523	21	38.8367868
Total	1322.42602	22	60.1102738

Number of obs = 23
 F(1, 21) = 13.05
 Prob > F = 0.0016
 R-squared = 0.3833
 Adj R-squared = 0.3539
 Root MSE = 6.2319

	gini	Coef.	Std. Err.	t	P> t	[95% Conf. Interval]
gdp		-.0006307	.0001746	-3.61	0.002	-.0009937 -.0002676
_cons		44.30983	3.572733	12.40	0.000	36.87993 51.73974

```
. ovtest
```

Ramsey RESET test using powers of the fitted values of gini
 Ho: model has no omitted variables
 F(3, 18) = 5.16
 Prob > F = 0.0095

4. С помощью теста Бокса-Кокса оценили зависимость веса индивида (в килограммах) от его роста (в сантиметрах):

Log likelihood = -2659.5656

Number of obs = 540
 LR chi2(2) = 230.68
 Prob > chi2 = 0.000

W	Coef.	Std. Err.	z	P> z	[95% Conf. Interval]
/lambda	1.055498	1.892654	0.56	0.577	-2.654035 4.76503
/theta	-.0263371	.1471576	-0.18	0.858	-.3147607 .2620865

Estimates of scale-variant parameters

	Coef.
Notrans _cons	2.936809
Trans H	.0237224
/sigma	.1660251

Test H0:	Restricted log likelihood	chi2	Prob > chi2
theta=lambda = -1	-2680.8693	42.61	0.000
theta=lambda = 0	-2659.7618	0.39	0.531
theta=lambda = 1	-2685.5201	51.91	0.000

Какую спецификацию модели (линейную, линейную в логарифмах, полулогарифмическую) следует предпочесть и почему?

5. Для выбора между линейной и полулогарифмической моделями (где *EARNINGS* — почасовая заработная плата в \$, *S* — длительность обучения, *ASVABC* — результаты тестов, характеризующие успеваемость) был проведен тест Дэвидсона, Уайта и МакКиннона и получены следующие результаты:

	Зависимая: Y	Зависимая: $\ln Y$
(Intercept)	-26.148 (4.17)	-1.941 (3.2499)
S	2.008 (0.276)	0.087 (0.035)
ASVABC	0.393 (0.079)	0.017 (0.007)
lin_add	-15.373 (5.984)	
semilog_add		-0.029 (0.065)
R^2	0.2071	0.2212
F	46.59	50.74
Adj. R^2	0.2027	0.2168
Num. obs.	540	540
RSS	90975.57	148.1
$\hat{\sigma}$	13.04	0.5256

Здесь $\text{lin_add} = \ln Y - \ln Y$, $\text{semilog_add} = Y - \exp(\ln Y)$ и в скобках указаны стандартные ошибки. С помощью PE-теста на уровне значимости 5% сделайте выбор между двумя оцененными моделями.