

Семинар 9.

Мультиколлинеарность: диагностика и последствия.

1. Известно, что выборочная корреляция между переменными X и Z равна 0.9.
 - (a) Найдите коэффициенты VIF для X и Z в регрессии $Y_i = \beta_1 + \beta_2 X_i + \beta_3 Z_i + \varepsilon_i$.
 - (b) В каких пределах могут лежать коэффициенты VIF для X и Z в регрессии $Y_i = \beta_1 + \beta_2 X_i + \beta_3 Z_i + \beta_4 W_i + \varepsilon_i$?
2. Покажите, что при наличии высокой корреляции между показателями наблюдается высокая дисперсия оценки параметров.