



KURS EKONOMETRIA

LEKCJA 7

Badanie rozkładu odchyłeń losowych

Odpowiedzi do zadania domowego



Część 1: TEST

- 1) d
- 2) a
- 3) b
- 4) d
- 5) c
- 6) b
- 7) b
- 8) a
- 9) c
- 10) c

ODPOWIEDZI DO ZADAŃ

Wyniki w zadaniach mogą różnić się zaokrągleniem.

Zad. 1

- a) liniowość – tak
rozkład normalny – nie
homoskedastyczność składnika losowego – tak
autokorelacja składnika losowego – brak
- b) liniowość – tak
rozkład normalny – tak
homoskedastyczność składnika losowego – tak
autokorelacja składnika losowego – brak
- c) liniowość – nie
rozkład normalny – tak
homoskedastyczność składnika losowego – nie
autokorelacja składnika losowego – występuje
- d) liniowość – tak
rozkład normalny – tak
homoskedastyczność składnika losowego – tak
autokorelacja składnika losowego – obszar nierozstrzygalności
- e) liniowość – tak
rozkład normalny – nie
homoskedastyczność składnika losowego – nie
autokorelacja składnika losowego – występuje



- f) liniowość – tak
rozkład normalny – tak
homoskedastyczność składnika losowego – obszar nierozstrzygalności
autokorelacja składnika losowego – brak

Zad. 2

$$\hat{\rho} = -0,68445 ; d = 3,282 , d > 4-dL$$

Odrzucamy H_0 na korzyść H_1 , więc występuje autokorelacja ujemna rzędu pierwszego.

Zad. 3

$$b = 0,4388 , b_L = 0,046007 , b_U = 0,349293 , b > b_U$$

Nie ma podstaw by odrzucić hipotezę H_0 . Składnik losowy jest homoskedastyczny.

Zad. 4

$$r = 14, n_1 = 16, n_2 = 16 , r > r^*$$

Nie ma podstaw by odrzucić hipotezę H_0 . Występuje liniowa zależność w modelu.

Zad. 5

Rozkład jest normalny.

Zad. 6

Brak autokorelacji I rzędu składnika losowego.

Zad. 7

$$\hat{\rho} = -0,32056 ; d = 1,8222 , d < 4-d_U$$

Nie ma podstaw by odrzucić hipotezę H_0 , więc jest brak autokorelacji I rzędu składnika losowego.

KONIEC