

CVIČENIA Z EKONOMETRIE 2004/2005

DOMÁCA ÚLOHA 3

TERMÍN ODOVZDANIA: 7.3.2005

1. (20 bodov) Zo stránky s úlohami ¹ si stiahnite súbory `x.txt` a `y.txt`, resp. `x.xls` a `y.xls`. Prvý riadok v každom súbore obsahuje názov premennej v danom stĺpci. Vektory, ktoré budete používať sú

- x_1, x_2, x_3, x_4 - stĺpce X1, X2, X3, X4 zo súboru `x.txt`, resp. `x.xls`
- y - stĺpec Yi zo súboru `y.txt`, resp. `y.xls`, kde i je Vaše číslo v zozname s hodnotením².

Na základe týchto dát spravte odhady koeficientov modelu

$$y = \beta_0 + \beta_1 x_1 + \beta_2 x_2 + \beta_3 x_3 + \beta_4 x_4 + \varepsilon_i.$$

V úlohe uveďte

- odhady koeficientov
- hodnotu R^2
- hodnoty upraveného R^2 (adjusted R^2), Akaikeho kritéria a Schwartzovho kritéria
- použitý softvér

¹<http://pc2.iam.fmph.uniba.sk/institute/stehlikova/em.html>

²<http://pc2.iam.fmph.uniba.sk/institute/stehlikova/bodyEM.html>