

CVIČENIA Z EKONOMETRIE 2005/2006

DOMÁCA ÚLOHA 11  
TERMÍN ODOVZDANIA: 9.5.2006

1. (15 bodov)

- (a) Použite na váš model z projektu Goldfeld-Quandtov alebo Breusch-Paganov test. Uvedte:
- i. Ktorý test ste si vybrali a interpretáciu výberu premennej/premenných do tohto testu. Prečo si myslíte, že práve tieto premenné môžu mať vplyv na varianciu  $\varepsilon_i$ ?
  - ii. Nulovú hypotézu testu a postup pri testovaní, priebežné výsledky (výsledky regresí použitých v teste).
  - iii. Vzorec na výpočet testovacej štatistiky, jej pravdepodobnostné rozdelenie za platnosti nulovej hypotézy.
  - iv. Číselnú hodnotu štatistiky, jej porovnanie s kritickou hodnotou alebo dosiahnutú P hodnotu. Záver - či nulovú hypotézu zamietame alebo nezamietame, čo z toho vyplýva pre prítomnosť heteroskedasticity.
- (b) Ak ste v niektorom prípade zamietli homoskedasticitu (Whitov test v predchádzajúcej DÚ, GF/BP test v tomto príklade), testujte signifikanciu parametrov a signifikanciu regresie tak, že zoberiete do úvahy heteroskedasticitu. Uvedte aj postup.

**Poznámka:**

Kritická hodnota pre štandardizované normálne rozdelenie  $N(0,1)$  je 1,96.