

# אקונומטריקה א

פרק 8 - מבחן 1

תוכן העניינים

1. כללי ..... 1

## מבחן 1:

## שאלות:

- (1) חוקר רצה לבדוק את השפעת התל"ג על ההשקעה במשק לפי המודל הבא:  $\ln I_t = \alpha + \beta \ln Y_t + u_t$ , כאשר:  $I_t$  היא ההשקעה באלפי שקלים,  $Y_t$  הוא התוצר באלפי שקלים, וההרעה האקראית,  $u_t$ , מקיימת את כל ההנחות הקלאסיות. באמידה התקבל הפלט הבא:

## Analysis of Variance

| Source  | DF  | Sum of Squares | Mean Square | F Value | Prob>F |
|---------|-----|----------------|-------------|---------|--------|
| Model   | 1   | 0.38523        | 0.38523     | 72.14   | <.0001 |
| Error   | 199 | 1.06266        | 0.00534     |         |        |
| C Total | 200 | 1.44789        |             |         |        |

|          |          |          |          |
|----------|----------|----------|----------|
| Root MSE | 0.073075 | R-square | 0.733936 |
| Dep Mean | 10.01722 | Adj R-sq | 0.732104 |
| C.V.     | 0.729494 |          |          |

## Parameter Estimates

| Variable  | DF | Parameter Estimate | Standard Error | T for H0: Parameter=0 | Prob> T | 95% conf. lim. |
|-----------|----|--------------------|----------------|-----------------------|---------|----------------|
| INTERCEPT | 1  | 3.472013           | 0.85463        | 4.06259               | 0.0002  | 1.79 – 5.15    |
| lnY       | 1  | 0.570042           | 0.06452        | 8.493526              | 0.0000  | ---- - ----    |

- מהו Pvalue לבדיקת מובהקות המודל ע"י מבחן F?
  - אם נגדיל את התוצר ב-1% בכמה תגדל ההשקעה?
  - מהו רווח הסמך ל- $\alpha$ ? מהו רווח הסמך ל- $\beta$ ?
  - הועלתה הטענה כי הגמישות שווה ל-0.4. מהן ההשערות לבדיקת הטענה?
  - מהי הרגרסיה המוגבלת למבחן WALD תחת  $H_0$ ?
  - מהו הסטטיסטי של WALD למבחן זה (אם ניתן לחישוב)?
  - אם ההשקעה נמדדת בשקלים במקום באלפי שקלים:
- המקדם של  $\ln Y$  לא ישתנה. נכון / לא נכון / לא ניתן לדעת
  - החותך לא ישתנה. נכון / לא נכון / לא ניתן לדעת

- iii. הסטטיסטי  $t$  לבדיקת המובהקות של  $\beta$   
לא ישתנה.  
נכון / לא נכון / לא ניתן לדעת
- iv. הסטטיסטי  $F$  לבדיקת מובהקות המודל  
לא ישתנה.  
נכון / לא נכון / לא ניתן לדעת
- v.  $R^2$  לא ישתנה.  
נכון / לא נכון / לא ניתן לדעת

החוקר טען כי גם גודל האוכלוסייה,  $P$ , משפיע על ההשקעה לפי המודל  
הבא:  $\ln I_t = \alpha + \beta_1 \ln Y_t + \beta_2 \ln P_t + u_t$ .  
ח. מהי השערת האפס לבדיקת הטענה?

התקבל הפלט הבא:

### Parameter Estimates

| Variable  | DF | Parameter | Standard | T for H0:   |         |
|-----------|----|-----------|----------|-------------|---------|
|           |    | Estimate  | Error    | Parameter=0 | Prob> T |
| INTERCEPT | 1  | 1.131853  | 1.43547  | 0.788489    | 0.4435  |
| lnY       | 1  | 1.035467  | 0.25756  | 4.020294    | 0.0004  |
| lnP       | 1  | -1.77456  | 0.94657  | -1.874727   | 0.0736  |

- ט. באיזו רמת מובהקות נקבל את טענת החוקר?  
י.  $R^2$  של המשוואה החדשה קטן מזה של  
המשוואה המקורית.  
נכון / לא נכון / לא ניתן לדעת

- במשוואה החדשה הועלתה הטענה כי סכום הגמישויות שווה ל-0.  
יא. מהי השערת האפס לבדיקת הטענה?  
יב. מהו הסטטיסטי  $t$  לבדיקת ההשערה? (נתון כי:  $\text{cov}(\hat{\beta}_1, \hat{\beta}_2) = -0.25$ ).  
יג. האם ניתן לדחות את השערת האפס?

(2) ענה על הסעיפים הבאים:

- א. ברגרסיה מרובה, כמו ברגרסיה חד משתנית,  
מבחן  $F$  למובהקות המודל שווה לריבוע של  
מבחן  $t$  למובהקות של  $\beta$ .  
נכון / לא נכון / לא ניתן לדעת
- ב. אם הערך 0 נמצא בתוך רווח הסמך ל- $\beta$ ,  
אזי  $\beta$  מובהקת.  
נכון / לא נכון / לא ניתן לדעת
- ג. בהוספת משתנה לא רלוונטי למודל האומד  
המתוקן לפרופורציית השונות המוסברת  
ירד בהכרח.  
נכון / לא נכון / לא ניתן לדעת

- ד. אומדי הריבועים הפחותים אינם חסרי הטיה אם ידוע שהשונות של  $u_t$  אינה קבועה (הפרה של הנחה קלאסית).  
 נכון / לא נכון / לא ניתן לדעת
- ה. אם דוחים  $H_0$  ברמת מובהקות מסוימת, אזי דוחים  $H_0$  בכל רמות המובהקות הקטנות יותר.  
 נכון / לא נכון / לא ניתן לדעת
- ו. אומד חסר הטיה הוא אינו בהכרח אומד עקיב.  
 נכון / לא נכון / לא ניתן לדעת

$$(3) \quad \tilde{\beta} = \frac{\sum_{t=1}^T X_t Y_t}{S_{XX}} \quad \text{נתון מודל ללא חותך: } Y_t = \beta X_t + u_t, \text{ ונתון האומד:}$$

- א. האומד  $\tilde{\beta}$  הוא אר"פ.  
 נכון / לא נכון / לא ניתן לדעת
- ב. האומד  $\tilde{\beta}$  הוא אומד חסר הטיה.  
 נכון / לא נכון / לא ניתן לדעת
- ג. האומד  $\tilde{\beta}$  הוא אומד לינארי.  
 נכון / לא נכון / לא ניתן לדעת
- ד. אר"פ יעיל יותר מ- $\tilde{\beta}$ .  
 נכון / לא נכון / לא ניתן לדעת
- ה. מהי השונות של  $\tilde{\beta}$  ?

$$(4) \quad \hat{\beta} = \frac{\sum_{t=1}^T X_t Y_t}{\sum_{t=1}^T X_t^2} \quad \text{נתון מודל ללא חותך: } Y_t = \beta X_t + u_t, \text{ ונתון האומד:}$$

- א. האומד  $\hat{\beta}$  הוא אר"פ.  
 נכון / לא נכון / לא ניתן לדעת
- ב. האומד  $\hat{\beta}$  הוא אומד חסר הטיה.  
 נכון / לא נכון / לא ניתן לדעת
- ג. האומד  $\hat{\beta}$  הוא אומד לינארי.  
 נכון / לא נכון / לא ניתן לדעת
- ד. מהי השונות של  $\hat{\beta}$  ?
- ה. האומד  $\hat{\beta}$  הוא אומד עקיב.  
 נכון / לא נכון / לא ניתן לדעת

## תשובות סופיות:

$$(1) \quad \text{א. } PF = 0.0001 \quad \text{ב. } 0.57\% \quad \text{ג. } p(1.79 \leq \alpha \leq 5.15) = 0.95$$

$$\begin{aligned} & \text{ד. } \begin{aligned} H_0: \beta &= 0.4 \\ H_1: \beta &\neq 0.4 \end{aligned} \quad \text{ה. } p(0.026 \leq \beta \leq 1.11) = 0.95 \end{aligned}$$

$$\text{ו. } WALD_{stat} = 7.054 \quad \text{ז. } \ln I_t - 0.4 \ln Y_t = \alpha + u_t$$

$$\text{ח. i. לא נכון. ii. לא נכון. iii. נכון. iv. נכון. v. נכון.}$$

$$\text{ט. } Pt_{\hat{\beta}} = 0.0736 \quad \text{י. לא נכון. יא. } H_0: \beta_2 = 0$$

$$\text{יב. } t = -1.089 \quad \text{יג. אין סיבה מספקת. יד. לא נכון. יה. לא נכון.}$$

$$(2) \quad \text{א. לא נכון. ב. לא נכון. ג. לא נכון. ד. לא נכון. ה. לא נכון. ו. נכון.}$$

$$(3) \quad \text{א. לא נכון. ב. לא נכון. ג. נכון. ד. לא ניתן לדעת.}$$

$$\text{ה. } V(\tilde{\beta}) = \frac{\sum X_t^2 \sigma^2}{S_{xx}^2}$$

$$(4) \quad \text{א. נכון. ב. נכון. ג. נכון. ד. } V(\tilde{\beta}) = \frac{\sigma_u^2}{\sum X_t^2} \quad \text{ה. נכון.}$$