

CVIČENIA Z EKONOMETRIE 2005/2006

DOMÁCA ÚLOHA 9

TERMÍN ODOVZDANIA: 25.4.2006

Model z prvého príkladu si uložte tak, aby ste s ním mohli pokračovať v DÚ10.

1. (5 bodov) Odhadnite model pre detskú úmrtnosť, ktorý ste navrhli v DÚ4 a DÚ6.
 - (a) Je regresia signifikantná?
 - (b) Zhodujú sa znamienka odhadov s očakávanými znamienkami? Pre každú použitú vysvetľujúcu premennú uveďte
 - odhad parametra pri tejto premennej,
 - či je signifikantný,
 - či sa jeho znamienko zhoduje s očakávaným znamienkom.

Dáta sú na stránke

<http://www.unicef.org/sowc05/english/statistics.html>

Ak ste niektoré štáty vynechali kvôli nedostupným dátam, napíšte ktoré.

2. (10 bodov) **Príprava na projekt**

Zvoľte si model a nájdite potrebné dáta na projekt. Informácie o projekte sú na stránke v časti *Projekt*. Spravte úvodnú analýzu. Odovzdajte:

 - (a) Formuláciu modelu, zdôvodnenie závislosti vysvetľovanej premennej od vysvetľujúcich premenných, očakávané znamienka parametrov.
 - (b) Odhad parametrov. Testovanie signifikancie regresie. Signifikantnosť regresie nevyhnutná k tomu, aby ste regresný model mohli požiť v projekte.
 - (c) Testovanie normálneho rozdelenia reziduí. Pri veľkom počte dát sa dajú použiť asymptotické výsledky¹, ale aj tak sa odporúča pokúsiť sa preformulovať model tak, aby ste predpoklad normality nezamietli. Pri malom počte dát (napríklad model pre štáty EÚ) je normálne rozdelenie nevyhnutné. Uveďte použitý test, jeho nulovú hypotézu a výsledok.

Dáta pošlite v textovom formáte na adresu bs.projekty@gmail.com.

Projekt môžete robiť samostatne alebo v dvojici. Ak robíte projekt v dvojici, stačí ak odovzdáte tento príklad v jednej kópii, s obidvoma menami. (Obaja potom dostanete rovnaký počet bodov, max. 10.)

¹pozri napríklad výsledky pre t a F štatistiky v *Greene, W. H.: Econometric Analysis. Prentice Hall, Upper Saddle River, 2000, kapitola 7.2.6*