

QUIZ 4 EAE 324 2017
(VERSÃO CORRIGIDA)

A. Dada as regressões:

1. $y = \beta_0 + \beta_1 x_1 + \beta_2 x_2 + u$

2. $y = \beta_0 + \beta_1 x_1 + u$

Sob quais condições o estimador MQO de β_1 será o mesmo quando aplicado às duas regressões?

B. Mostre que na regressão de y contra $x_1 \dots x_k$
 $[\text{corr}(\hat{y}, y)]^2 = R^2$, da regressão.