

QUIZ 6 EAE-324 2017-04-25

1. Defina \bar{R}^2 da regressão linear múltipla e explique qual a relação dele com o R^2 da mesma regressão.

2. Suponha que a sua verdadeira relação entre y com x_1 e x_2 .e dado por:

$y = \beta_0 + \beta_1 x_1 + \beta_2 x_2 + u$ mas o pesquisador, equivocadamente, estima:

$$y = \beta_0 + \beta_1 x_1 + \beta_2 x_2 + u \quad (\text{a})$$

$$y = \beta_0 + \beta_1 x_1 + u \quad (\text{b})$$

i. Deduza o viés de $\hat{\beta}_1$ quando (b) é estimada.

ii. Se (a) fosse estimada o que ocorreria com o estimador de $\hat{\beta}_1$?