Trabalho de Estatística II – Parte 2

Inclua em suas regressões dummies de anos (em nível e em log). Apresente os resultados (considere a regressão em que a variável dependente é a que vc acredita ser a mais adequada).

Discuta os valores R2 e R2 ajustado antes e depois da inclusão das dummies de anos.

Qual a diferença teórica entre estes dois conceitos? Quais valores você obteve nas suas regressões.

**Responder as questões a partir desse ponto somente para modelo de variáveis em logaritmos (observações: i) variáveis que ficam entre 0 e 1 não devem ser alteradas; ii) para variáveis com dados negativos, devem ser somados uma constante positiva grande o suficiente em todas as observações da variável para eliminar os valores negativos e daí então aplicar o log; iii) se a variável contiver somente valores positivos e zeros usar lvar=ln(var+1), que mantem os zeros originais)**

Quais os valores da soma dos quadrados total (SQT), da soma dos quadrados regressão (SQR) e da soma dos quadrados dos erros (SQE) da regressão em log?

Quais os valores da média dos quadrados total (MQT), da média dos quadrados regressão (MQR) e da média dos quadrados dos erros (MQE) da regressão em log?

Qual o valor da estatística de teste F? Como ela pode ser obtida a partir da média dos quadrados total (MQT), da média dos quadrados regressão (MQR) e da média dos quadrados dos erros (MQE) da regressão em log? Discuta o significado do teste F.

Estimar a matriz de correlação entre as variáveis excluindo as dummies de ano. Avalie o potencial problema de multicolinearidade em seu modelo.

Plote os resíduos de seu modelo e avalie potencial problema de heterocedasticidade.

Faça um teste ANOVA unidirecional para a variável dependente em log usando como regressor o ano (os grupos serão os anos) (não incluir as demais variáveis independentes). Suponha normalidade nas populações.