Quiz #5

Grupo 1

Regresión Múltiple

Econometría 06216

Nombre: _____

Profesor: Julio César Alonso

INSTRUCCIONES:

- Escoja la opción más adecuada.
- Usted cuenta con 5 minutos para resolver este quiz

1. Para comparar la bondad de ajuste entre dos modelos con la misma variable dependiente pero con número diferente de variables explicativas, no confiamos en el R cuadrado porque:
    a. No es valido..
    b. Se espera que sea más grande si mas variables son incluidas en el modelo, entonces el modelo menos parsimonioso será el elegido.
    c. No aplica a regresión múltiple, solo a la regresión simple.
    d. Ninguna de las anteriores.

Respuesta b).

2. Si deseamos probar una restricción en un subconjunto de parámetros de una regresión, en general se puede calcular un modelo con las restricciones impuestas y otro con las restricciones no impuestas, y nos concentramos en:
    a. En el estadístico de la prueba t del modelo sin restricción.
    b. En el estadístico de la prueba F para el modelo no restringido.
    c. En el análisis de los SSE de ambos modelos.
    d. Ninguna de las anteriores.

Respuesta c).

3. El test de Chow tiene como objetivo:
    a. Probar la significancia conjunta de los coeficientes.
    b. Probar la significancia individual de un coeficiente.
    c. Probar el cumplimiento de los supuestos del modelo
    d. Ninguna de las anteriores.

Respuesta d).

4. Si consideramos un conjunto de resultados provenientes de pruebas de significancia individual, entonces:
    a. Al agregar los resultados de las pruebas aumenta la probabilidad de cometer error tipo I
    b. Al agregar los resultados de las pruebas aumenta la probabilidad de cometer error tipo II
    c. a. y b. son ciertas
    d. Ninguna de las anteriores.

Respuesta a). Pero el texto parece no ser muy claro en que tipo de error se incurre. Por tanto otra respuesta aceptable únicamente en este quiz será la c

5. Suponga la hipótesis nula de que $\beta_1 = 0$ se rechaza versus la hipótesis alterna de que $\beta_1 \neq 0$ con un nivel de significancia del 1%. Entonces:
   a. La hipótesis nula de que $\beta_1 \leq 0$ se debe rechazar contra la hipótesis alterna de que $\beta_1 > 0$.
   b. La hipótesis nula de que $\beta_1 \geq 0$ se debe rechazar contra la hipótesis alterna de que $\beta_1 < 0$.
   c. Son ciertas a y b.
   d. Ninguna de las anteriores.

Respuesta d).