

Dipartimento di Economia
Metodi Statistici per la Finanza

Esercitazione n.4

I risultati devono essere inviati via e-mail a
francesco.bartolucci@unipg.it

entro il 18 Novembre

- Reperire dei dati reali e stimare un modello di regressione lineare multipla in cui si considera almeno una variabile qualitativa con più di due categorie. Come si interpretano i risultati? Cosa cambia quando la variabile qualitativa viene considerata come quantitativa?
- Reperire dei dati reali (con almeno 5 covariate di cui almeno una qualitativa) e selezionare il miglior modello di regressione lineare multipla tramite le procedure forward stepwise e backward stepwise.
- Si illustri l'analisi dei residui per il modello selezionato con la procedura forward stepwise, evidenziando se le assunzioni di base del modello sono soddisfatte.
- Si illustri se e perchè è presente multicollinearità tra i regressori.
- Si illustri il calcolo della previsione per una nuova unità statistica e del relativo intervallo di confidenza e intervallo predittivo.
- Reperire dei dati reali e stimare un modello di regressione multivariata in cui si considera almeno una variabile qualitativa con più di due categorie. Come si interpretano i risultati?