

Guía del Seminario del 16 de Abril de 2012

Econometría de Grado (3º B de ADE)

- (1) Descargar de Gretl el fichero de datos de Wooldridge llamado *hprice1*. Contiene datos del precio de 88 viviendas (en miles de dólares) junto con algunas características de las mismas (su valor de tasación, nº de dormitorios, tamaño de la casa, si es de estilo colonial o no, etc.). Además, contiene la transformación logarítmica de todas las variables continuas.
- (2) Estimar un modelo lineal en el que se relacione el precio de la vivienda en función de una constante y del valor de tasación. Contrastar la hipótesis de que el coeficiente asociado a la tasación es uno e interpretar el resultado.
- (3) Estimar un modelo lineal en el que se incorpora además de la tasación, todas las variables de tamaño de la vivienda. Contraste la significación individual de las pendientes del modelo y la significación conjunta de las mismas. ¿Es coherente el resultado de ambos tipos de contraste? ¿Es coherente el signo de la constante estimada?
- (4) Detecte multicolinealidad de grado en el modelo estimado en el apartado (3). Calcule la correlación lineal simple entre todos los pares posibles de variables explicativas.
- (5) Decida qué variables explicativas elimina del modelo estimado en el apartado (3).
- (6) Incluya en el modelo estimado en el apartado (5) la distinción de si la vivienda es de tipo colonial o no e interprete el coeficiente asociado.
- (7) ¿Cambian los resultados y conclusiones obtenidos en los apartados (2), (3), (4), (5) y (6) si utiliza el logaritmo de todas las variables continuas del fichero, en lugar de sus valores en nivel?

