باسمه تعالی

اقتصادسنجی کاربردی

مدت زمان 100 دقیقه **دیماه 93**

سوال اول: محققی برای بررسی اثر حداقل دستمزد(x) بر بیکاری(y) رگرسیون زیر را استفاده کرده است

$$y = \alpha + \beta x + u$$

الف- تفسیر ضرایب(10نمره) ب- ضریب شیب منفی بدست آمده است؟ چرا؟(10نمره)

سوال دوم: تفاوت عبارتهای زیر چیست؟(15 نمره)

$$E(xu) = 0 \text{ و } E(x|u) = 0$$

سوال سوم: محققی برای بررسی اثر سطح آموزش(*EDUC*) و تجربه کاری(*EXPER*) بر دستمزد(*WAGE*) رگرسیونهای زیر را استفاده کرده است

Dependent Variable: WAGE
Method: Least Squares
Sample: 1 526
Included observations: 526

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
EXPER	0.070095	0.010978	6.385291	0.0000
EDUC	0.644272	0.053806	11.97397	0.0000
C	-3.390540	0.766566	-4.423023	0.0000

R-squared	0.225162	Mean dependent var	5.896103
Adjusted R-squared	الف	S.D. dependent var	د
S.E. of regression	ب	Akaike info criterion	5.205204
Sum squared resid	5548.160	Schwarz criterion	5.229531
F-statistic	ج	Durbin-Watson stat	1.820274

Dependent Variable: log(WAGE)
Method: Least Squares
Sample: 1 526
Included observations: 526

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
EXPER	0.010347	0.001555	6.653393	0.0000
EDUC	0.097936	0.007622	12.84839	0.0000
C	0.216854	0.108595	1.996909	0.0464

R-squared	0.249343	Mean dependent var	1.623268

الف- تفسیر ضرایب دو مدل (10نمره) ب- کامل کردن جاهای خالی(8نمره) ج- احتمال واریانس ناهمسانی در کدام مدل بیشتر است؟ چرا؟(8 نمره) د- کدام مدل مناسب تر است؟ چرا؟(4نمره)

سوال چهارم: در یک مدل چهار متغیره، ضرب کردن متغیر وابسته در یک مقدار ثابت، چه تاثیری بر واریانس ضرایب شیب و آماره t محاسباتی دارد؟ چرا؟(20 نمره، نوشتن فرمول مربوطه ضروری است)

سوال پنجم: استفاده از متغیر مجازی برای ارزیابی یک سیاست را توضیح دهید؟(15 نمره)

"ومن ا... التوفیق"