

Teoria da Regressão

4ª Lista de Exercícios

Mostre que $H_0 : \alpha_1 = \alpha_2$ é testável.

1. Considere o modelo de regressão com p termos especificado corretamente, incluindo o intercepto. Utilizando as suposições usuais sob ϵ , mostre que

a) $Var(\hat{\mathbf{y}}) = \sigma^2 \mathbf{H}$;

b) $\sum_{i=1}^n Var(\hat{y}_i) = p\sigma^2$

c)

3. Responda as questões selecionadas abaixo do livro Modelos de Regressão com apoio computacional (referência n.7 da ementa) - Capítulo 1 seção 1.11 questões 8, 11, 12, 18 e 19.

4. Mostre que $s_{(i)}^2 = \frac{(n-p)s^2}{n-p-1} - \frac{r_i^2/(1-h_{ii})}{n-p-1}$

5. Faça uma análise diagnóstica completa dos exercícios

a) lista 2 n.5

b) lista 3 n.6

c) prova 1 n.5