

10. Übungsblatt zum Wiederholungskurs
Schließende Statistik SS 2016

Aufgabe 39

Eine amerikanische Fluggesellschaft nimmt an, dass zwischen den jährlichen Kosten für Treibstoff x_i und den übrigen operativen Kosten y_i (jeweils in 100 Mio USD) ein Zusammenhang in Form des einfachen linearen Regressionsmodells

$$y_i = \beta_1 + \beta_2 \cdot x_i + u_i \quad \text{mit} \quad u_i \stackrel{\text{iid}}{\sim} N(0, \sigma^2), \quad i \in \{1, \dots, n\}$$

besteht.

Die Fluggesellschaft hat über $n = 8$ Jahre die Kosten für Treibstoff x_i sowie die übrigen operativen Kosten y_i erhoben und daraus für die Durchführung einer einfachen linearen Regressionsanalyse bereits die folgenden Zwischenwerte errechnet:

$$\begin{aligned} \sum_{i=1}^8 y_i &= 115.24; & \sum_{i=1}^8 y_i^2 &= 1736.703; & \sum_{i=1}^8 x_i &= 14.916; \\ \sum_{i=1}^8 x_i^2 &= 32.937; & \sum_{i=1}^8 x_i \cdot y_i &= 233.495; & \sum_{i=1}^8 \hat{y}_i^2 &= 1727.748; \end{aligned}$$

- Schätzen Sie β_1 und β_2 mit Hilfe der Kleinst-Quadrate-Methode.
- Berechnen Sie das Bestimmtheitsmaß R^2 .
- Geben Sie mit Hilfe der bekannten erwartungstreuen Schätzfunktion für σ^2 den realisierten Schätzwert für σ^2 an.
- Berechnen Sie $\widehat{\sigma^2_{\hat{\beta}_1}}$ und $\widehat{\sigma^2_{\hat{\beta}_2}}$.
- Überprüfen Sie zum Signifikanzniveau $\alpha = 0.01$ (!), ob β_1 signifikant positiv ist. Fassen Sie das Ergebnis auch in einem Antwortsatz zusammen.
- Überprüfen Sie zum Signifikanzniveau $\alpha = 0.05$, ob β_2 sich signifikant von Null unterscheidet. Fassen Sie das Ergebnis auch in einem Antwortsatz zusammen.
- Geben Sie ein symmetrisches Konfidenzintervall zur Vertrauenswahrscheinlichkeit $1 - \alpha = 0.99$ für β_1 an.
- Geben Sie ein Prognoseintervall zur Vertrauenswahrscheinlichkeit $1 - \alpha = 0.95$ für die restlichen operativen Kosten y_0 in einem Jahr mit Treibstoffkosten von $x_0 = 0.5$ an.
- Geben Sie ein Prognoseintervall zur Vertrauenswahrscheinlichkeit $1 - \alpha = 0.95$ für den Erwartungswert der restlichen operativen Kosten $E(y_0)$ in einem Jahr mit Treibstoffkosten von $x_0 = 0.5$ an.

Aufgabe 40

Zur Erklärung der stetigen Wochenrenditen der BMW-Aktie y_i durch die stetigen Wochenrenditen des DAX x_i unterstellt man die Gültigkeit eines Zusammenhangs im Sinne des folgenden linearen Modells:

$$y_i = \beta_1 + \beta_2 x_i + u_i \quad \text{mit} \quad u_i \stackrel{\text{iid}}{\sim} N(0, \sigma^2), \quad i \in \{1, \dots, n\}$$

Aus den stetigen Wochenrenditen der zweiten Jahreshälfte des Jahres 2010 wurde das lineare Modell mit der Statistik-Software R wie folgt geschätzt:

Call:

```
lm(formula = y ~ x)
```

Residuals:

Min	1Q	Median	3Q	Max
-0.058359	-0.020671	-0.001171	0.019764	0.069304

Coefficients:

	Estimate	Std. Error	t value	Pr(> t)
(Intercept)	0.009336	0.006724	1.388	0.1777
x	1.164781	0.388177	3.001	0.0062 **

Signif. codes: 0 '***' 0.001 '**' 0.01 '*' 0.05 '.' 0.1 ' ' 1

Residual standard error: 0.03175 on 24 degrees of freedom

Multiple R-squared: 0.2728, Adjusted R-squared: 0.2425

F-statistic: 9.004 on 1 and 24 DF, p-value: 0.006196

- Wie viele Wochenrenditen gingen in die Schätzung ein?
- Geben Sie die realisierten Kleinst-Quadrate-Schätzwerte für β_1 und β_2 an.
- Geben Sie den realisierten Schätzwert für σ^2 an.
- Welcher Anteil der Gesamtvarianz der stetigen Wochenrenditen der BMW-Aktie wird durch das lineare Modell erklärt?
- Entscheiden Sie mit Hilfe des zugehörigen p -Werts zum Signifikanzniveau $\alpha = 0.05$, ob β_1 signifikant von Null verschieden ist.
- Entscheiden Sie mit Hilfe des zugehörigen p -Werts zum Signifikanzniveau $\alpha = 0.01$, ob β_2 signifikant positiv ist.
- Geben Sie ein Konfidenzintervall zur Vertrauenswahrscheinlichkeit $1 - \alpha = 0.95$ für β_1 an.
- Welche Wochenrendite der BMW-Aktie prognostiziert das Modell in einer Woche mit einer (wöchentlichen) DAX-Rendite von 0.01?