

Χρηματοοικονομική Μοντελοποίηση φυλλάδιο αρ. 3

1. Να δημιουργήσετε ένα δείγμα 35 παρατηρήσεων της τυποποιημένης κανονικής κατανομής $C1$.
2. Στη $C2$ να καταχωρηθούν 35 τιμές μίας μεταβλητής και στη $C3$, 35 τιμές μίας ακόμη μεταβλητής. Στη $C4$ να καταχωρηθούν οι 35 τιμές που προκύπτουν από τη σχέση $C4=3+ 2C2 +C1$.
3. Να επιβεβαιωθεί η καλή προσαρμογή του απλού γραμμικού μοντέλου $C4=3+2C2$.
4. Αν θεωρήσουμε τις τιμές της $C4$ ως προβλέψεις και τις τιμές της $C3$ ως ληφθείσες τιμές, να αξιολογηθεί η ικανότητα πρόβλεψης των τιμών της $C3$ χρησιμοποιώντας την ευθεία παλινδρόμησης $C4=3+2C2 +C1$. Συγκεκριμένα τι δείχνουν οι τιμές των tests: Sign test, Wilcoxon και Runs test.
5. Τι είναι το φαινόμενο της υπερπροσαρμογής;