

BAYESIÁNSKÁ ANALÝZA – CVIČENÍ 4

Toto cvičení je založeno na znalosti druhé části čtvrté kapitoly na páté kapitoly z učebnice Koop (2003): *Bayesian econometrics*, případně na odpovídajících kapitolách podkladového učebního textu *Bayesiánská analýza*.

Co bude náplní cvičení?

- 📎 Osvojení si metody importance sampling.
- 📎 Odhad a posteriorní analýza normálního nelineárního regresního modelu.
- 📎 Osvojení si techniky Metropolis-Hastings algoritmu (v jeho základních variantách).
- 📎 Odhad a posteriorní analýza na příkladech s využitím reálných dat.

Zadání příkladů

1. *Importance sampling* Cílem tohoto úkolu je osvojení techniky importance sampling a pochopení vlastností tohoto postupu. Předpokládejme zcela jednoduchý model s jediným parametrem θ , jehož posteriorní hustota odpovídá $N(0, 1)$.
 - (a) Vytvořte program počítající posteriorní střední hodnotu a směrodatnou odchylku parametru θ pomocí Monte Carlo integrace.
 - (b) Vytvořte program počítající posteriorní střední hodnotu a směrodatnou odchylku parametru θ za použití techniky importance sampling a spočítejte rovněž střední hodnotu a směrodatnou odchylku použitých vah. Jako importance function použijte funkci hustoty pravděpodobnosti $t(0, 1, \nu)$.
 - i. Metoda importance sampling využívá generování vzorků ze známé kandidátské hustoty (importance function) a zahrnuje počítání vah jakožto podílů jader posteriorní hustoty a kandidátské hustoty vyhodnocené ve vygenerovaném kandidátovi. Výpočet středních hodnot funkcí parametrů, které nás zajímají pak vyžaduje provedení Monte Carlo integrace, kde místo aritmetických průměrů využíváme vážené průměry s vypočtenými vahami z „importance sampleru“.
 - (c) Proveďte Monte Carlo integraci a importance sampling pro různé hodnoty ν , např. $\nu = 2, 5$ a 100 pro daný počet replikací (např. $R = 10$). Porovnejte přesnost odhadů pro oba algoritmy a různou volbu ν . Všimněte se co se děje s váhami při zvyšujícím se ν .
 - (d) Zopakujte část (c) při využití $t(3, 1, \nu)$ jakožto importance function. Diskutujte faktory ovlivňující přesnost importance sampling ve světle skutečnosti, že importance function jen slabě aproximuje posteriorní hustotu.
 - (e) Vyzkoušejte i jiné importance function, např. $U(a, b)$, měňte i počet replikací R .
 - (f) Vypočítat požadované momenty posteriorní hustoty s využitím importance samplingu je vcelku jednoduchá záležitost. Existuje ale způsob, jak získat pomocí importance samplingu a s využitím umění generovat vzorky z importance funkce i přímo vzorky odpovídající posteriornímu rozdělení?
 - i. Myšlenka, jak na to není zas tak obtížná. Co máme k dispozici jsou jednak výběry z importance funkce, ale i velmi důležité váhy. Kdyby tedy existovala metoda, která by pro nějaký vzorek dat dokázala vybírat náhodné výběry, a to navíc i tak, že bychom mohli definovat s ajkou pravděpodobností se ten který prvek původního výběru může vybrat, tak máme vyhráno.
 - ii. Touto metodou je metoda bootstrapu. V základním principu se nejedná o nic jiného, než o metodu, která vygeneruje z nějakého empirického rozdělení náhodný výběr (o požadované délce) tak, že pravděpodobnost výběru z každého vzorku je stejná. Máme-li tedy výběr o velikosti 100 , každý z těchto prvků se bude vybírat s pravděpodobností 1% , přičemž si sami můžeme zvolit, jestli se bude jednat o výběr s nahrazováním (to znamená, že po výběru nějakého prvku z empirického rozdělení tento prvek

zůstává a v dalším kole může být vybrán znovu) prvku nebo bez nahrazování (když nějaký prvek vybereme, už jej v druhém kole vybrat nemůžeme). V našem případě využijeme samozřejmě variantu s nahrazováním, což je právě princip bootstrapu (druhý případ by odpovídal situaci, kdybychom potřebovali vybrat náhodnou podmnožinu výběru). Takovýto bootstrapový generátor si zvládneme vytvořit sami: stačí umět generovat čísla z uniformního rozdělení (pro 100 pozorování např. na intervalu 0 až 100, funkce `rand` transformovaná do požadovaného intervalu), která zaokrouhlíme na celá čísla (funkce `ceil`) a získáme tak index prvku, který z našeho vektoru `dat` máme vybrat. To opakuje tolikrát, kolik budeme chtít výběrů (počet výběrů nemusí odpovídat počtu prvků původního vektoru).

- iii. V našem případě ale nechceme vybírat prvky z kandidátské hustoty se stejnou pravděpodobností. Chtěli bychom předchozí proceduru modifikovat tak, aby pravděpodobnosti, s jakými budeme vybírat jednotlivé prvky vektoru byly proporcionální vahám získaným z importance samplingu. I zde bychom si příslušnou funkci mohli naprogramovat sami, např. tak, že si jednak nanormujeme váhy na jedničkový součet, vyhodíme prvky s nulovými vahami a vytvoříme nový umělý vzorek, ve kterém počet každého z prvků zvýšíme proporcionálně jeho váze (pravděpodobnosti). Následně pak na takto rozšířený vzorek aplikujeme metodu bootstrapu popsanou výše (i když každý prvek má stejnou pravděpodobnost výběru, jeho početní zastoupení zajistí požadovanou pravděpodobnost danou původními vahami).
- iv. Abychom si ale ulehčili práci, můžeme využít funkci `bootstrp` Statistického toolboxu. Tato funkce má různé podoby volání, ale my budeme potřebovat podobu:

```
[bootstat, bootsam] = bootstrp(1, [], theta_IS, weights, weight_IS);
```

kde `bootstat` by za normálních okolností obsahovalo bootstrapované statistiky či funkce původního vzorku, `bootsam` obsahuje bootstrapované indexy ze vzorku proměnných (v našem případě vektoru `theta_IS` (tyto indexy pak použijeme pro výběr z vektoru `theta_IS`), `[]` je prázdný argument, kde by za jiných okolností byla funkce nebo vektor funkcí aplikovaný na náš bootstrapovaný vzorek (např. bootstrapované střední hodnoty, směrodatné odchylky apod.), `theta_IS` je vektor parametrů z kandidátské hustoty a `weight_IS` je vektor odpovídajících vah z importance samplingu. `weights` je dodatečná volba funkce `bootstrp`, umožňující zavést požadované váhy. Jednička ve funkci pak říká, že chceme jeden jediný bootstrapový vzorek (o stejné velikosti jako vektor `theta_IS`). Kdybychom dali např. hodnotu 2, potom by se vytvořily dva vzorky a `bootsam` by byla matice indexů (o dvou sloupcích).

- 2. *M-H algoritmus* Cílem tohoto úkolu je osvojení si technik Metropolis-Hastings algoritmu a analýza jejich vlastností. Předpokládejme, že nás zajímá bayesiánská analýza parametru θ , jehož posteriorní hustota je dána jako

$$p(\theta|y) \propto \exp\left(-\frac{1}{2}|\theta|\right)$$

pro $-\infty < \theta < \infty$. Jedná se o speciální případ Laplaceova rozdělení. Pro naše účely ovšem nepotřebujeme znát integrační konstantu. Toto Laplaceovo rozdělení má střední hodnotu 0 a rozptyl 8. Předpokládejme, že nedokážeme přímým způsobem získat vzorky z $p(\theta|y)$ a chceme tedy využít M-H algoritmus.

- (a) Odvod'te a vytvořte program pro independence chain M-H algoritmus s využitím $N(0, d^2)$ jakožto kandidátní generující hustoty (pro různé hodnoty d).
- (b) Odvod'te a vytvořte program pro random walk chain M-H algoritmus s využitím normálně rozdělené přírůstkové veličiny s rozptylem, c^2 (pro různé hodnoty c).
- (c) Porovnejte výkonnost předchozích dvou algoritmu.

3. Soubor `mexico.m` obsahuje makroekonomická data pro Mexiko z let 1955–1974. Máme k dispozici tři specifikace produkčních funkcí této ekonomiky, Cobb-Douglasovu funkci

$$Y_i = \alpha_1 X_{2i}^{\alpha_2} X_{3i}^{\alpha_3} + \epsilon_i,$$

CES produkční funkci (obvyklý je požadavek $\beta_2 + \beta_3 = 1$, což můžete provést v rámci rozšíření modelu)

$$Y_i = \beta_1 \left[\beta_2 X_{2i}^{\beta_4} + \beta_3 X_{3i}^{\beta_4} \right]^{\frac{1}{\beta_4}} + \epsilon_i.$$

a lineární produkční funkci

$$Y_i = \gamma_1 + \gamma_2 X_{2i} + \gamma_3 X_{3i} + \epsilon_i.$$

Proměnná Y_i odpovídá HDP dané ekonomiky, kdy výrobními faktory jsou práce, X_{2i} a kapitál X_{3i} . V rámci odhadu budeme pracovat s proměnnými vyjádřenými jako odchylky od svých průměrných hodnot (tedy s pomocí indexů, kde průměr dané veličiny je roven jedné). Výraz $1/(1 - \beta_4)$ v CES produkční funkci pak odpovídá elasticitě substituce.

- (a) Odhadněte produkční funkce mexické ekonomiky s využitím Random Walk Metropolis-Hastings algoritmu. Uvažujeme apriorní hustotu pro parametry odpovídající normálnímu rozdělení a pro přesnost chyby odpovídající gama rozdělení. Náhodná složka pochází z normálního rozdělení (s předpokladem nezávislosti pozorování).
- (b) Která ze specifikací lépe odpovídá datům? (využijte pro konstrukci bayesova faktoru metodu Gelfanda a Deye a pokuste se rovněž simulovat na základě modelů vybrané momenty v pozorovaných datech, tedy střední hodnotu a rozptyl resp. směrodatnou odchylku)