

Übung 4

Aufgabe 5

- b) Für die Kreditwürdigkeit der 10 potenziellen Kreditnehmer erhält man die folgenden geschätzten Wahrscheinlichkeiten:

i	Logit-Modell			Probit-Modell		
	$\hat{\eta}_i$	$\hat{\mathbb{E}}[y]$	$\hat{y}_i$	$\hat{\eta}_i$	$\hat{\mathbb{E}}[y]$	$\hat{y}_i$
1	3,5560	0,9722	1	2,0136	0,9780	1
2	1,7640	0,8537	1	1,0218	0,8466	1
3	0,9517	0,7215	1	0,5751	0,7174	1
4	3,3719	0,9668	1	1,9236	0,9728	1
5	2,6362	0,9332	1	1,4729	0,9296	1
6	-0,2294	0,4429	0	-0,0710	0,4717	0
7	2,1682	0,8974	1	1,2115	0,8871	1
8	-2,8108	0,0567	0	-1,5213	0,0641	0
9	-0,0197	0,4951	0	-0,0057	0,4977	0
10	0,1776	0,5443	1	0,1109	0,5441	1

Damit erhält man für das Logit- und Probit- Modell:

i	Logit-Modell			Probit-Modell		
	$\hat{\eta}_i$	$\hat{\mathbb{E}}[y]$	$\hat{y}_i$	$\hat{\eta}_i$	$\hat{\mathbb{E}}[y]$	$\hat{y}_i$
1	3,5560	0,9722	1	2,0136	0,9780	1
2	1,7640	0,8537	0	1,0218	0,8466	0
3	0,9517	0,7215	0	0,5751	0,7174	0
4	3,3719	0,9668	1	1,9236	0,9728	1
5	2,6362	0,9332	1	1,4729	0,9296	1
6	-0,2294	0,4429	0	-0,0710	0,4717	0
7	2,1682	0,8974	1	1,2115	0,8871	1
8	-2,8108	0,0567	0	-1,5213	0,0641	0
9	-0,0197	0,4951	0	-0,0057	0,4977	0
10	0,1776	0,5443	0	0,1109	0,5441	0