

Taller #3
Econometría 06169
Grupo 5

Profesor: Julio César Alonso

Nota: Recuerden que únicamente dos preguntas seleccionadas al azar serán calificadas.
Además recuerden que en todas las preguntas ustedes deben mostrar todo su trabajo.

1. En el taller pasado estimamos por MCO el siguiente modelo $y_i = \beta_1 + \beta_2 X_{2i} + \beta_3 X_{3i} + \varepsilon_i$ usando las siguientes observaciones recogidas por un investigador.

$$y := \begin{pmatrix} 3 \\ 2 \\ 8 \\ 3 \\ 5 \end{pmatrix} \quad X := \begin{pmatrix} 1 & 3 & 5 \\ 1 & 1 & 4 \\ 1 & 5 & 6 \\ 1 & 2 & 4 \\ 1 & 4 & 6 \end{pmatrix}$$

Ahora, (no necesitan hallar de nuevo los estimadores, pueden usar los resultados encontrados anteriormente)

- a) Contraste la hipótesis nula $H_0: \beta_2 + \beta_3 = 1$. Explique las implicaciones de su decisión
- b) Construya la Tabla ANOVA para el modelo estimado.

2. Usando la misma información de la pregunta 1,

- a) Calcule el R^2 del modelo estimado. Explique en sus propias palabras el significado de su respuesta numérica.
- b) Contraste la hipótesis nula $H_0: \beta_2 = \beta_3 = 0$. Explique las implicaciones de su decisión.

3. El jefe de la división de planeación del departamento de mercadeo de una cadena de almacenes espera que las ventas diarias en millones de pesos, Y_t , tengan un comportamiento descrito por el siguiente modelo estadístico: $Y_t = \beta_1 X_{1t} + \beta_2 X_{2t} + \beta_3 X_{3t} + \varepsilon_t$, donde X_{1t} representa el número de reclamos en el día t , X_{2t} representa el número de ofertas en el día t y X_{3t} representa el número de anuncios en el periodico en el día t . ε_t representa una variable estocástica que está normalmente e independientemente distribuida con media cero y varianza constante.

Los economistas de la división de planeación ya han recogido 400 observaciones y han efectuado los siguientes cálculos:

$$Y^T Y = 47797 \quad Y^T X = (5200 \quad 13600 \quad 22800) \quad X^T X = \begin{pmatrix} 800 & 1600 & 2400 \\ 1600 & 4000 & 6400 \\ 2400 & 6400 & 11200 \end{pmatrix}$$

a) Calcule los mejores estimadores lineales insesgados del vector $\beta = (\beta_1 \ \beta_2 \ \beta_3)^T$.

b) Estime σ^2 y la matriz de varianzas y covarianzas de los estimadores de β .

c) ¿Es β_1 significativo? Explique las implicaciones de su respuesta.

4. Usando la misma información de la pregunta 3, considere las siguientes preguntas:

a) En la última reunión del departamento de planeación uno de los asesores afirmaba: "Si logramos que en un día no existan reclamos, hacemos 3 promociones y publicamos un anuncio de prensa, entonces nuestros ingresos diarios serán de 8 millones". Pruebe la hipótesis de dicho asesor y explique sus conclusiones.

b) El departamento de finanzas de esta cadena de almacenes desea conocer un rango para el valor promedio de las ventas diarias para poder efectuar la programación financiera del próximo trimestre. Si sabemos que existirán 5 ofertas diarias, 40 anuncios de prensa diarios y 30 reclamo, calcule el rango requerido por el departamento de finanzas (con un 95% de confianza).

Respuestas Sugeridas
Taller #3
Econometría 06169
Grupo 5

Profesor: Julio César Alonso

Nota: Recuerden que únicamente dos preguntas seleccionadas al azar serán calificadas.
 Además recuerden que en todas las preguntas ustedes deben mostrar todo su trabajo.

1. En el taller pasado estimamos por MCO el siguiente modelo $y_i = \beta_1 + \beta_2 X_{2i} + \beta_3 X_{3i} + \varepsilon_i$ usando las siguientes observaciones recogidas por un investigador.

$$y := \begin{pmatrix} 3 \\ 2 \\ 8 \\ 3 \\ 5 \end{pmatrix} \quad X := \begin{pmatrix} 1 & 3 & 5 \\ 1 & 1 & 4 \\ 1 & 5 & 6 \\ 1 & 2 & 4 \\ 1 & 4 & 6 \end{pmatrix}$$

Ahora, (no necesitan hallar de nuevo los estimadores, pueden usar los resultados encontrados anteriormente)

a) Contraste la hipótesis nula $H_0: \beta_2 + \beta_3 = 1$. Explique las implicaciones de su decisión

Esta hipótesis nula puede ser escrita en la forma $R \cdot \beta = C$. Como sólo existen una restricción y tenemos tres parámetros estimados, entonces la matriz R tendrá dimensiones 1×3 . En este caso $R = (0 \ 1 \ 1)$ y $C = 1$. Así, el F calculado está dado por

$$F_{\text{calculado}} = \frac{((C - R \cdot \hat{\beta}))^T \cdot [R \cdot (X^T \cdot X)^{-1} \cdot R^T]^{-1} \cdot (C - R \cdot \hat{\beta})}{\frac{r}{s^2}}$$

Del taller anterior sabemos que:

$$\hat{\beta} = \begin{bmatrix} \hat{\beta}_1 \\ \hat{\beta}_2 \\ \hat{\beta}_3 \end{bmatrix} = \begin{pmatrix} \frac{16}{5} \\ 2 \\ -1 \end{pmatrix} \quad (X^T X)^{-1} = \begin{pmatrix} \frac{267}{10} & \frac{9}{2} & -8 \\ \frac{9}{2} & 1 & -\frac{3}{2} \\ -8 & -\frac{3}{2} & \frac{5}{2} \end{pmatrix} \quad s^2 = \frac{7}{5}$$

Entonces tenemos que

$$F_{\text{calculado}} = \frac{\left[1 - \left[(0 \ 1 \ 1) \cdot \begin{pmatrix} \frac{16}{5} \\ 2 \\ -1 \end{pmatrix} \right] \right]^T \cdot \left[(0 \ 1 \ 1) \cdot \begin{pmatrix} \frac{267}{10} & \frac{9}{2} & -8 \\ \frac{9}{2} & 1 & -\frac{3}{2} \\ -8 & -\frac{3}{2} & \frac{5}{2} \end{pmatrix} \cdot \begin{pmatrix} 0 \\ 1 \\ 1 \end{pmatrix} \right]^{-1} \cdot \left[1 - \left[(0 \ 1 \ 1) \cdot \begin{pmatrix} \frac{16}{5} \\ 2 \\ -1 \end{pmatrix} \right] \right]}{\frac{1}{\frac{7}{5}}}$$

$$F_{\text{calculado}} = \frac{(1-1)^T \cdot \left[(0 \ 1 \ 1) \cdot \begin{pmatrix} \frac{267}{10} & \frac{9}{2} & -8 \\ \frac{9}{2} & 1 & -\frac{3}{2} \\ -8 & -\frac{3}{2} & \frac{5}{2} \end{pmatrix} \cdot \begin{pmatrix} 0 \\ 1 \\ 1 \end{pmatrix} \right]^{-1} \cdot (1-1)}{\frac{1}{\frac{7}{5}}} = \frac{0}{\frac{7}{5}} = 0$$

Este $F_{\text{calculado}}$ lo tenemos que comparar con el $F_{0.05, (1, 2)} = 18.513$. Claramente el $F_{\text{calculado}}$ es menor que el F de la tabla v por tanto no hay suficiente evidencia para rechazar la hipótesis nula que $\beta_2 + \beta_3 = 1$. Noten que este resulta implica que $\beta_2 = 1 - \beta_3$, así nuestra conclusión implica que la pendiente asociada con X_{2i} es igual a uno menos la pendiente asociada a X_{3i} .

b) Construya la Tabla ANOVA para el modelo estimado.

Sabemos que la tabla ANOVA viene dada por:

Tabla ANOVA

Fuente de variación	SS	G de L	MS
Regresión	$SSR = \hat{\beta}^T X^T y - n\bar{Y}^2$	$k - 1$	$\frac{SSR}{k - 1}$
Error (Residuos)	$SSE = y^T y - \hat{\beta}^T X^T y$	$n - k$	$\frac{SSE}{n - k}$
Total	$y^T y - n\bar{Y}^2$	$n - 1$	

En este caso tenemos que $k := 3$, $n := 5$, $y^T y = (111)$, $\hat{\beta} \cdot X^T y = \frac{541}{5}$ y $\bar{Y} = \frac{21}{5}$. Así, la tabla Anova es

Tabla ANOVA

Fuente de variación	SS	G de L	MS
Regresión	$\frac{541}{5} - \left[5 \cdot \left(\frac{21}{5} \right)^2 \right] = 20$	$3 - 1 = 2$	$\frac{20}{2} = 10$
Error (Residuos)	$111 - \frac{541}{5} = \frac{14}{5} = 2.8$	$5 - 3 = 2$	$\frac{\frac{14}{5}}{2} = \frac{7}{5}$
Total	$20 + \frac{14}{5} = \frac{114}{5} = 22.8$	4	

2. Usando la misma información de la pregunta 1,

a) Calcule el R^2 del modelo estimado. Explique en sus propias palabras el significado de su respuesta numérica.

Sabemos que $R^2 = \frac{SSR}{SST}$. Entonces, en este caso tenemos que $R^2 = \frac{20}{\frac{114}{5}} = \frac{50}{57} = 0.877$. Esto

implica que el 87.7% de la variación de Y es explicada por nuestro modelo.

b) Contraste la hipótesis nula $H_0: \beta_2 = \beta_3 = 0$. Explique las implicaciones de su decisión.

Existen varias formas de hacer esta pregunta. Una de las formas es usando la información de la tabla ANOVA. Sabemos que el F calculado para probar dicha H_0 está dado por

$$F_{\text{calculado}} = \frac{\text{MSR}}{\text{MSE}} = \frac{10}{\frac{7}{5}} = \frac{50}{7} = 7.143$$

El F de la tabla para este caso es $F_{0.05, (2, 2)} = 19$. Como el $F_{\text{calculado}} < F_{0.05, (2, 2)}$, entonces no hay suficiente evidencia para rechazar la H_0 . Así podemos decir que un modelo con sólo un intercepto explicaría mejor la variabilidad de la variable Y.

3. El jefe de la división de planeación del departamento de mercadeo de una cadena de almacenes espera que las ventas diarias en millones de pesos, Y_t , tengan un comportamiento descrito por el siguiente modelo estadístico: $Y_t = \beta_1 X_{1t} + \beta_2 X_{2t} + \beta_3 X_{3t} + \varepsilon_t$ donde X_{1t} representa el número de reclamos en el día t, X_{2t} representa el número de ofertas en el día t y X_{3t} representa el número de anuncios en el periódico en el día t. ε_t representa una variable estocástica que está normalmente e independientemente distribuida con media cero y varianza constante.

Los economistas de la división de planeación ya han recogido 400 observaciones y han efectuado los siguientes cálculos:

$$Y^T Y = 47797 \quad Y^T X = (5200 \quad 13600 \quad 22800) \quad X^T X = \begin{pmatrix} 800 & 1600 & 2400 \\ 1600 & 4000 & 6400 \\ 2400 & 6400 & 11200 \end{pmatrix}$$

a) Calcule los mejores estimadores lineales insesgados del vector $\beta = (\beta_1 \quad \beta_2 \quad \beta_3)^T$.

Sabemos que $\hat{\beta} = (X^T X)^{-1} X^T Y$ es MELI si se cumplen los 3 supuestos del teorema de Gauss-Markov. Así, necesitamos encontrar $(X^T X)^{-1}$. Noten que

$$X^T X = \begin{pmatrix} 800 & 1600 & 2400 \\ 1600 & 4000 & 6400 \\ 2400 & 6400 & 11200 \end{pmatrix} = 800 \cdot \begin{pmatrix} 1 & 2 & 3 \\ 2 & 5 & 8 \\ 3 & 8 & 14 \end{pmatrix}$$

Entonces,

$$|X^T X| = 800^3 \cdot \begin{vmatrix} 1 & 2 & 3 \\ 2 & 5 & 8 \\ 3 & 8 & 14 \end{vmatrix}$$

Recuerden: $|a \cdot Z| = a^k \cdot |Z|$, donde a es un escalar y Z es una matriz cuadrada de $k \times k$.

Como $\begin{vmatrix} 1 & 2 & 3 \\ 2 & 5 & 8 \\ 3 & 8 & 14 \end{vmatrix} = 1$, entonces $|X^T X| = 800^3 = 2^9 \cdot 10^6$

La matriz de cofactores esta dada por

$$800^2 \cdot \begin{bmatrix} 5 \cdot 14 - 8 \cdot 8 & (2 \cdot 14 - 8 \cdot 3) \cdot (-1)^{2+1} & (2 \cdot 8 - 5 \cdot 3) \cdot (-1)^{1+3} \\ (2 \cdot 14 - 3 \cdot 8) \cdot (-1)^{2+1} & (1 \cdot 14 - 3 \cdot 3) \cdot (-1)^{2+2} & (1 \cdot 8 - 2 \cdot 3) \cdot (-1)^{3+2} \\ (2 \cdot 8 - 5 \cdot 3) \cdot (-1)^{1+3} & (1 \cdot 8 - 2 \cdot 3) \cdot (-1)^{3+2} & (1 \cdot 5 - 2 \cdot 2) \cdot (-1)^{3+3} \end{bmatrix} = 800^2 \cdot \begin{pmatrix} 6 & -4 & 1 \\ -4 & 5 & -2 \\ 1 & -2 & 1 \end{pmatrix}$$

Entonces

$$(X^T X)^{-1} = \frac{1}{800^3} \cdot \begin{bmatrix} 6 & -4 & 1 \\ -4 & 5 & -2 \\ 1 & -2 & 1 \end{bmatrix} = \frac{1}{800} \cdot \begin{pmatrix} 6 & -4 & 1 \\ -4 & 5 & -2 \\ 1 & -2 & 1 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} \frac{3}{400} & \frac{-1}{200} & \frac{1}{800} \\ \frac{-1}{200} & \frac{1}{160} & \frac{-1}{400} \\ \frac{1}{800} & \frac{-1}{400} & \frac{1}{800} \end{pmatrix}$$

Ahora sí podemos encontrar los estimadores para $\beta = (\beta_1 \ \beta_2 \ \beta_3)^T$

$$\hat{\beta} = \begin{bmatrix} \hat{\beta}_1 \\ \hat{\beta}_2 \\ \hat{\beta}_3 \end{bmatrix} = (X^T X)^{-1} X^T y = \begin{pmatrix} \frac{3}{400} & \frac{-1}{200} & \frac{1}{800} \\ \frac{-1}{200} & \frac{1}{160} & \frac{-1}{400} \\ \frac{1}{800} & \frac{-1}{400} & \frac{1}{800} \end{pmatrix} \cdot (5200 \ 13600 \ 22800)^T = \begin{pmatrix} \frac{-1}{2} \\ 2 \\ 1 \end{pmatrix}$$

b) Estime σ^2 y la matriz de varianzas y covarianzas de los estimadores de β .

Para encontrar el estimador para σ^2 empleamos la siguiente fórmula.

$$s^2 = \frac{y^T y - \beta_{\text{hat}}^T \cdot X^T y}{n - k} = \frac{47797 - \left[\begin{pmatrix} -\frac{1}{2} & 2 & 1 \end{pmatrix} \cdot (5200 \quad 13600 \quad 22800)^T \right]}{400 - 3}$$

$$s^2 = \frac{47797 - (47400)}{400 - 3} = \frac{397}{397} = 1$$

Entonces la matriz estimada de varianzas y covarianzas de los estimadores de β esta dada por

$$\widehat{\text{Var}}(\hat{\beta}) = s^2 (X^T X)^{-1} = 1 \cdot \begin{pmatrix} \frac{3}{400} & \frac{-1}{200} & \frac{1}{800} \\ \frac{-1}{200} & \frac{1}{160} & \frac{-1}{400} \\ \frac{1}{800} & \frac{-1}{400} & \frac{1}{800} \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} \frac{3}{400} & \frac{-1}{200} & \frac{1}{800} \\ \frac{-1}{200} & \frac{1}{160} & \frac{-1}{400} \\ \frac{1}{800} & \frac{-1}{400} & \frac{1}{800} \end{pmatrix}$$

c) ¿Es β_1 significativo? Explique las implicaciones de su respuesta.

En este caso debemos realizar la siguiente prueba de hipótesis: $H_0: \beta_1 = 0$ versus $H_A: \beta_1 \neq 0$

, como sabemos el t calculado esta dado por $t_c = \frac{\beta_{\text{hat}1}}{s(\beta_{\text{hat}1})}$. En este caso tenemos

$$t_c = \frac{\frac{-1}{2}}{\sqrt{\frac{3}{400}}} = -\frac{\frac{1}{2}}{\sqrt{\frac{3}{2^2 \cdot 10^2}}} = \frac{-10}{3} \cdot \sqrt{3} \quad \boxed{\sqrt{3} = 1.732}$$

$$t_c = -5.774$$

Este t_c lo tenemos que comparar con el $t_{0.025, 397} = 2.588$ de la tabla (Aquí ustedes podían escoger cualquier nivel de significancia y la decisión sería la misma). Note que

$|t_c| = \frac{10}{3} \cdot \sqrt{3} > t_{0.025, 397} = 2.588$, por lo tanto hay suficiente evidencia para decir que el coeficiente asociado con el intercepto no es igual a cero.

4. Usando la misma información de la pregunta 3, considere las siguientes preguntas:

a) En la última reunión del departamento de planeación uno de los asesores afirmaba: "Si logramos que en un día no existan reclamos, hacemos 3 promociones y publicamos un anuncio de prensa, entonces nuestros ingresos diarios serán de 8 millones". Pruebe la hipótesis de dicho asesor y explique sus conclusiones.

Esta afirmación es equivalente a probar la siguiente $H_0: \beta_1 \cdot 0 + \beta_2 \cdot 3 + \beta_3 \cdot 1 = 8$. Como vimos en clase, esta hipótesis la podemos reescribir en la forma $R \cdot \beta = C$. En este caso únicamente tenemos una restricción y por tanto la matriz R tendrá dimensiones 1×3 . En este caso tenemos $R := (0 \ 3 \ 1)$ y $C := 8$. Así el F calculado está dado por:

$$F_{\text{calculado}} = \frac{((C - R \cdot \hat{\beta}))^T \cdot [R \cdot (X^T X)^{-1} \cdot R^T]^{-1} \cdot (C - R \cdot \hat{\beta})}{\frac{r}{s^2}}$$

Del taller anterior sabemos que:

$$\hat{\beta} = \begin{bmatrix} \hat{\beta}_1 \\ \hat{\beta}_2 \\ \hat{\beta}_3 \end{bmatrix} = \begin{pmatrix} -\frac{1}{2} \\ 2 \\ 1 \end{pmatrix} \quad (X^T X)^{-1} = \begin{pmatrix} \frac{3}{400} & \frac{-1}{200} & \frac{1}{800} \\ \frac{-1}{200} & \frac{1}{160} & \frac{-1}{400} \\ \frac{1}{800} & \frac{-1}{400} & \frac{1}{800} \end{pmatrix} \quad s^2 = 1$$

Entonces tenemos que

$$F_{\text{calculado}} = \frac{\left[8 - \left[(0 \ 3 \ 1) \cdot \begin{pmatrix} -\frac{1}{2} \\ 2 \\ 1 \end{pmatrix} \right] \right]^T \cdot \left[(0 \ 3 \ 1) \cdot \begin{pmatrix} \frac{3}{400} & \frac{-1}{200} & \frac{1}{800} \\ \frac{-1}{200} & \frac{1}{160} & \frac{-1}{400} \\ \frac{1}{800} & \frac{-1}{400} & \frac{1}{800} \end{pmatrix} \cdot \begin{pmatrix} 0 \\ 3 \\ 1 \end{pmatrix} \right]^{-1} \cdot \left[8 - \left[(0 \ 3 \ 1) \cdot \begin{pmatrix} -\frac{1}{2} \\ 2 \\ 1 \end{pmatrix} \right] \right]}{1}$$

$$F_c = [8 \cdot -(7)]^T \cdot \left[(0 \ 3 \ 1) \cdot \begin{pmatrix} \frac{3}{400} & \frac{-1}{200} & \frac{1}{800} \\ \frac{-1}{200} & \frac{1}{160} & \frac{-1}{400} \\ \frac{1}{800} & \frac{-1}{400} & \frac{1}{800} \end{pmatrix} \cdot \begin{pmatrix} 0 \\ 3 \\ 1 \end{pmatrix} \right]^{-1} \cdot [8 \cdot -(7)] = 1 \cdot \left(\frac{17}{400} \right)^{-1} \cdot 1 = \frac{400}{17} = 23.529$$

Este $F_{\text{calculado}}$ lo tenemos que comparar con el $F_{0.05, (1, 397)} = 3.865$. Claramente el $F_{\text{calculado}}$ es mayor que el F de la tabla v por tanto hay suficiente evidencia para rechazar la hipótesis nula que $\beta_1 \cdot 0 + \beta_2 \cdot 3 + \beta_3 \cdot 1 = 8$. Noten que este resulta implica que el asesor no tenía la razón.

b) El departamento de finanzas de esta cadena de almacenes desea conocer un rango para el valor promedio de las ventas diarias para poder efectuar la programación financiera del próximo trimestre. Si sabemos que existirán 5 ofertas diarias, 40 anuncios de prensa diarios y 30 reclamo, calcule el rango requerido por el departamento de finanzas (con un 95% de confianza).

El primer paso es encontrar la predicción para el valor promedio. Sabemos que dicha predicción esta dada por

$$\hat{y}_p = x_p^T \hat{\beta}$$

Donde x_p es el vector de valores de las variables independientes para los cuales queremos la predicción. Así nuestra predicción para $x_p^T = (30 \ 5 \ 40)$ es

$$(30 \ 5 \ 40) \cdot \begin{pmatrix} \frac{1}{2} \\ \frac{-1}{2} \\ 1 \end{pmatrix} = (35)$$

Además sabemos que la varianza de la predicción media esta dada por

$$Var(\hat{y}_p) = \sigma^2 x_p^T (X^T X)^{-1} x_p$$

Es decir,

$$1 \cdot \left[(30 \ 5 \ 40) \cdot \begin{pmatrix} \frac{3}{400} & \frac{-1}{200} & \frac{1}{800} \\ \frac{-1}{200} & \frac{1}{160} & \frac{-1}{400} \\ \frac{1}{800} & \frac{-1}{400} & \frac{1}{800} \end{pmatrix} \cdot \begin{pmatrix} 30 \\ 5 \\ 40 \end{pmatrix} \right] = \frac{301}{32}$$

$$S_{\hat{y}_p}^2 = \frac{301}{32}$$

Así el un intervalo del 95% de confianza para nuestra predicción esta dada por

$$\hat{y}_p \pm t_{\frac{\alpha}{2}, n-k} \sqrt{S_{\hat{y}_p}^2} \quad \text{con } t_{0.025, 397} = 1.966$$

$$\left(35 - 1.966 \cdot \sqrt{\frac{301}{32}}, 35 + 1.966 \cdot \sqrt{\frac{301}{32}} \right)$$

$$\left[35 - 1.966 \cdot \left(\frac{1}{8} \cdot \sqrt{602} \right), 35 + 1.966 \cdot \left(\frac{1}{8} \cdot \sqrt{602} \right) \right]$$

Nota: Sino tenían una calculadora a la mano, esto era suficiente

$$(28.97, 41.03)$$

Entonces, el un intervalo del 95% de confianza para nuestra predicción es (28.97, 41.03).