

# ECONOMETRÍA BÁSICA

## CAPÍTULO 07: DUMMYS

José Valderrama & Freddy Rojas  
jtvalderrama@gmail.com & frojasca@gmail.com ✉  
Universidad Católica Santo Toribio de Mogrovejo

Septiembre de 2021

# CONTENIDO

- 1 VARIABLES DUMMY
  - Variable dummy como variable independiente
  - Términos de interacción entre dicotómicas
  - Test de Chow o de quiebre estructural
- 2 MODELO DE PROBABILIDAD LINEAL
  - Modelo de probabilidad lineal
- 3 REFERENCIA

# CONTENIDO

## 1 VARIABLES DUMMY

- Variable dummy como variable independiente
- Términos de interacción entre dicotómicas
- Test de Chow o de quiebre estructural

## 2 MODELO DE PROBABILIDAD LINEAL

- Modelo de probabilidad lineal

## 3 REFERENCIA

# VARIABLES DUMMY

- Una variable dummy es una variable que toma solo uno de dos valores: 1 ó 0. De ahí que también se le conozca como variables binarias.
- Ejemplos de ello son el género: (=1 si es mujer y cero en otro caso), el ámbito geográfico (=1 si la persona vive en el área rural y cero si vive en el área urbana), etc
- Otros nombres que son usados para este tipo de variables son: variables ficticias o variables dicotómicas

# CONTENIDO

- 1 VARIABLES DUMMY
  - Variable dummy como variable independiente
  - Términos de interacción entre dicotómicas
  - Test de Chow o de quiebre estructural
- 2 MODELO DE PROBABILIDAD LINEAL
  - Modelo de probabilidad lineal
- 3 REFERENCIA

# VARIABLE DUMMY COMO VARIABLE INDEPENDIENTE

- Sea un modelo regresión lineal múltiple con  $y$  y  $x$  siendo variables continuas y  $d$  una variable dummy:.

$$y = \beta_0 + \delta_0 d + \beta_1 x + u$$

- Lo cual puede ser interpretado como un cambio en el intercepto:
  - Si  $d = 0$ , entonces  $y = \beta_0 + \beta_1 x + u$
  - Si  $d = 1$ , entonces  $y = (\beta_0 + \delta_0) + \beta_1 x + u$

# VARIABLE DUMMY COMO VARIABLE INDEPENDIENTE

- Sea un modelo regresión lineal múltiple con  $y$  y  $x$  siendo variables continuas y  $d$  una variable dummy:.

$$y = \beta_0 + \delta_0 d + \beta_1 x + u$$

- Lo cual puede ser interpretado como un cambio en el intercepto:
  - Si  $d = 0$ , entonces  $y = \beta_0 + \beta_1 x + u$
  - Si  $d = 1$ , entonces  $y = (\beta_0 + \delta_0) + \beta_1 x + u$

# VARIABLE DUMMY COMO VARIABLE INDEPENDIENTE

- Sea un modelo regresión lineal múltiple con  $y$  y  $x$  siendo variables continuas y  $d$  una variable dummy:.

$$y = \beta_0 + \delta_0 d + \beta_1 x + u$$

- Lo cual puede ser interpretado como un cambio en el intercepto:
  - Si  $d = 0$ , entonces  $y = \beta_0 + \beta_1 x + u$
  - Si  $d = 1$ , entonces  $y = (\beta_0 + \delta_0) + \beta_1 x + u$



# VARIABLE DUMMY COMO VARIABLE INDEPENDIENTE

- Sea un modelo regresión lineal múltiple con  $y$  y  $x$  siendo variables continuas y  $d$  una variable dummy:.

$$y = \beta_0 + \delta_0 d + \beta_1 x + u$$

- Lo cual puede ser interpretado como un cambio en el intercepto:
  - Si  $d = 0$ , entonces  $y = \beta_0 + \beta_1 x + u$
  - Si  $d = 1$ , entonces  $y = (\beta_0 + \delta_0) + \beta_1 x + u$

# VARIABLE DUMMY COMO VARIABLE INDEPENDIENTE

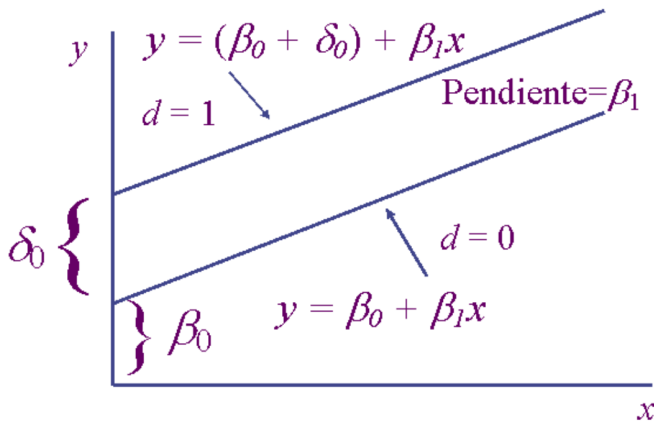
- Sea un modelo regresión lineal múltiple con  $y$  y  $x$  siendo variables continuas y  $d$  una variable dummy:.

$$y = \beta_0 + \delta_0 d + \beta_1 x + u$$

- Lo cual puede ser interpretado como un cambio en el intercepto:
  - Si  $d = 0$ , entonces  $y = \beta_0 + \beta_1 x + u$
  - Si  $d = 1$ , entonces  $y = (\beta_0 + \delta_0) + \beta_1 x + u$

# VARIABLE DUMMY COMO VARIABLE INDEPENDIENTE

Gráficamente y cuando  $\delta_0 > 0$  se tendría:



# VARIABLE DUMMY COMO VARIABLE INDEPENDIENTE

- La variable categórica 'Género' tiene dos categorías (Hombre y mujer) Porqué solo se considera una dicotómica en los modelos de regresión:  $y = \beta_0 + \delta_0 \text{Mujer} + \beta_1 x + u$  y no se hace esto:  $y = \beta_0 + \delta_0 \text{Mujer} + \delta_1 \text{Hombre} + \beta_1 x + u$
- Porque si se hiciera se tendría el problema de multicolinealidad perfecta:  $\text{Hombre} + \text{Mujer} = 1$
- Es decir, de una variable categórica que tiene dos categorías, solo una se debe incluir en el modelo de regresión. En general, si la variable tiene  $N$  categorías, el modelo de regresión debería contar con  $N - 1$  variables dicotómicas.
- Dicotómica en STATA: `gen mujer=sexo==2` (Crea la dicotómica 'mujer')

# VARIABLE DUMMY COMO VARIABLE INDEPENDIENTE

- La variable categórica 'Género' tiene dos categorías (Hombre y mujer) Porqué solo se considera una dicotómica en los modelos de regresión:  $y = \beta_0 + \delta_0 \text{Mujer} + \beta_1 x + u$  y no se hace esto:  $y = \beta_0 + \delta_0 \text{Mujer} + \delta_1 \text{Hombre} + \beta_1 x + u$
- Porque si se hiciera se tendría el problema de multicolinealidad perfecta:  $\text{Hombre} + \text{Mujer} = 1$
- Es decir, de una variable categórica que tiene dos categorías, solo una se debe incluir en el modelo de regresión. En general, si la variable tiene  $N$  categorías, el modelo de regresión debería contar con  $N - 1$  variables dicotómicas.
- Dicotómica en STATA: `gen mujer=sexo==2` (Crea la dicotómica 'mujer')

# VARIABLE DUMMY COMO VARIABLE INDEPENDIENTE

- La variable categórica 'Género' tiene dos categorías (Hombre y mujer) Porqué solo se considera una dicotómica en los modelos de regresión:  $y = \beta_0 + \delta_0 \text{Mujer} + \beta_1 x + u$  y no se hace esto:  $y = \beta_0 + \delta_0 \text{Mujer} + \delta_1 \text{Hombre} + \beta_1 x + u$
- Porque si se hiciera se tendría el problema de multicolinealidad perfecta:  $\text{Hombre} + \text{Mujer} = 1$
- Es decir, de una variable categórica que tiene dos categoría, solo una se debe incluir en el modelo de regresión. En general, si la variable tiene  $N$  categoría, el modelo de regresión debería contar con  $N - 1$  variables dicotómicas.
- Dicotómica en STATA: `gen mujer=sexo==2` (Crea la dicotómica 'mujer')

# VARIABLE DUMMY COMO VARIABLE INDEPENDIENTE

- La variable categórica 'Género' tiene dos categorías (Hombre y mujer) Porqué solo se considera una dicotómica en los modelos de regresión:  $y = \beta_0 + \delta_0 \text{Mujer} + \beta_1 x + u$  y no se hace esto:  $y = \beta_0 + \delta_0 \text{Mujer} + \delta_1 \text{Hombre} + \beta_1 x + u$
- Porque si se hiciera se tendría el problema de multicolinealidad perfecta:  $\text{Hombre} + \text{Mujer} = 1$
- Es decir, de una variable categórica que tiene dos categoría, solo una se debe incluir en el modelo de regresión. En general, si la variable tiene  $N$  categoría, el modelo de regresión debería contar con  $N - 1$  variables dicotómicas.
- Dicotómica en STATA: `gen mujer=sexo==2` (Crea la dicotómica 'mujer')

# VARIABLE DUMMY COMO VARIABLE INDEPENDIENTE

- Así, si se quisiera saber si existe diferencia en los ingresos entre las 13 regiones de Chile la ecuación de Mincer debería tener 12 dicotómicas, cada una representando a una región. La categoría no incluida se conoce como la categoría base y su impacto vendría a ser dado por el intercepto de la regresión.
- En Stata una forma rápida de crear dicotómicas, una para cada categoría es: `tab region,g(jose)` (crea las dicotómicas: 'jose1', 'jose2', ..., 'jose13')
- En el trabajo aplicado también se suele convertir una variable continua en dicotómica. Por ejemplo convertir la variable edad (continua) en una variable categórica que identifica a los jóvenes y a los adultos.
- En STATA lo anterior se podría hacer del siguiente modo:  
`gen joven=edad<31`



# VARIABLE DUMMY COMO VARIABLE INDEPENDIENTE

- Así, si se quisiera saber si existe diferencia en los ingresos entre las 13 regiones de Chile la ecuación de Mincer debería tener 12 dicotómicas, cada una representando a una región. La categoría no incluida se conoce como la categoría base y su impacto vendría a ser dado por el intercepto de la regresión.
- En Stata una forma rápida de crear dicotómicas, una para cada categoría es: `tab region,g(jose)` (crea las dicotómicas: 'jose1', 'jose2', ..., 'jose13')
- En el trabajo aplicado también se suele convertir una variable continua en dicotómica. Por ejemplo convertir la variable edad (continua) en una variable categórica que identifica a los jóvenes y a los adultos.
- En STATA lo anterior se podría hacer del siguiente modo:  
`gen joven=edad<31`

# VARIABLE DUMMY COMO VARIABLE INDEPENDIENTE

- Así, si se quisiera saber si existe diferencia en los ingresos entre las 13 regiones de Chile la ecuación de Mincer debería tener 12 dicotómicas, cada una representando a una región. La categoría no incluida se conoce como la categoría base y su impacto vendría a ser dado por el intercepto de la regresión.
- En Stata una forma rápida de crear dicotómicas, una para cada categoría es: `tab region,g(jose)` (crea las dicotómicas: 'jose1', 'jose2', ..., 'jose13')
- En el trabajo aplicado también se suele convertir una variable continua en dicotómica. Por ejemplo convertir la variable edad (continua) en una variable categórica que identifica a los jóvenes y a los adultos.
- En STATA lo anterior se podría hacer del siguiente modo:  
`gen joven=edad<31`

# VARIABLE DUMMY COMO VARIABLE INDEPENDIENTE

- Así, si se quisiera saber si existe diferencia en los ingresos entre las 13 regiones de Chile la ecuación de Mincer debería tener 12 dicotómicas, cada una representando a una región. La categoría no incluida se conoce como la categoría base y su impacto vendría a ser dado por el intercepto de la regresión.
- En Stata una forma rápida de crear dicotómicas, una para cada categoría es: `tab region,g(jose)` (crea las dicotómicas: 'jose1', 'jose2', ..., 'jose13')
- En el trabajo aplicado también se suele convertir una variable continua en dicotómica. Por ejemplo convertir la variable edad (continua) en una variable categórica que identifica a los jóvenes y a los adultos.
- En STATA lo anterior se podría hacer del siguiente modo:  
`gen joven=edad<31`

# CONTENIDO

- 1 VARIABLES DUMMY
  - Variable dummy como variable independiente
  - Términos de interacción entre dicotómicas
  - Test de Chow o de quiebre estructural
- 2 MODELO DE PROBABILIDAD LINEAL
  - Modelo de probabilidad lineal
- 3 REFERENCIA

# TÉRMINOS DE INTERACCIÓN ENTRE DICOTÓMICAS

- Consiste en incluir la multiplicación de variables dicotómicas en la regresión.
- Así, si se tienen las variables dicotómicas: *mujer* y *rural*; una variable dicotómica que se puede incluir es  $mujer * rural$
- $y = \beta_0 + \beta_1 mujer * rural$ , con las siguientes posibilidades:
  - $mujer=0$  y  $rural=0$ ; entonces  $y = \beta_0$
  - $mujer=1$  y  $rural=1$ ; entonces  $y = \beta_0 + \beta_1$
  - $mujer=0$  y  $rural=1$ ; entonces  $y = \beta_0$
  - $mujer=1$  y  $rural=0$ ; entonces  $y = \beta_0$

# TÉRMINOS DE INTERACCIÓN ENTRE DICOTÓMICAS

- Consiste en incluir la multiplicación de variables dicotómicas en la regresión.
- Así, si se tienen las variables dicotómicas: *mujer* y *rural*; una variable dicotómica que se puede incluir es *mujer\*rural*
- $y = \beta_0 + \beta_1 \text{mujer} * \text{rural}$ , con las siguientes posibilidades:
  - *mujer*=0 y *rural*=0; entonces  $y = \beta_0$
  - *mujer*=1 y *rural*=1; entonces  $y = \beta_0 + \beta_1$
  - *mujer*=0 y *rural*=1; entonces  $y = \beta_0$
  - *mujer*=1 y *rural*=0; entonces  $y = \beta_0$

# TÉRMINOS DE INTERACCIÓN ENTRE DICOTÓMICAS

- Consiste en incluir la multiplicación de variables dicotómicas en la regresión.
- Así, si se tienen las variables dicotómicas: *mujer* y *rural*; una variable dicotómica que se puede incluir es *mujer\*rural*
- $y = \beta_0 + \beta_1 \text{mujer} * \text{rural}$ , con las siguientes posibilidades:
  - *mujer*=0 y *rural*=0; entonces  $y = \beta_0$
  - *mujer*=1 y *rural*=1; entonces  $y = \beta_0 + \beta_1$
  - *mujer*=0 y *rural*=1; entonces  $y = \beta_0$
  - *mujer*=1 y *rural*=0; entonces  $y = \beta_0$

# TÉRMINOS DE INTERACCIÓN ENTRE DICOTÓMICAS

- Consiste en incluir la multiplicación de variables dicotómicas en la regresión.
- Así, si se tienen las variables dicotómicas: *mujer* y *rural*; una variable dicotómica que se puede incluir es  $mujer * rural$
- $y = \beta_0 + \beta_1 *mujer* * *rural*$ , con las siguientes posibilidades:
  - $mujer=0$  y  $rural=0$ ; entonces  $y = \beta_0$
  - $mujer=1$  y  $rural=1$ ; entonces  $y = \beta_0 + \beta_1$
  - $mujer=0$  y  $rural=1$ ; entonces  $y = \beta_0$
  - $mujer=1$  y  $rural=0$ ; entonces  $y = \beta_0$



# TÉRMINOS DE INTERACCIÓN ENTRE DICOTÓMICAS

- Hasta el momento todas las dicotómicas vistas solo provocan cambios en los interceptos
- Es posible modelar cambios en las pendientes de la siguiente manera:  $y = \beta_0 + \beta_1 x + \delta_1 * x * mujer + u$ :
  - $mujer=0$ ;  $y = \beta_0 + \beta_1 x + u$
  - $mujer=1$ ;  $y = \beta_0 + (\beta_1 + \delta_1)x + u$
- Aunque en general se podría modelar cambio en la pendiente y en el intercepto a la vez:  $y = \beta_0 + \delta_0 mujer + \beta_1 x + \delta_1 * x * mujer + u$ 
  - $mujer=0$ ;  $y = \beta_0 + \beta_1 x + u$
  - $mujer=1$ ;  $y = (\beta_0 + \delta_0) + (\beta_1 + \delta_1)x + u$

# TÉRMINOS DE INTERACCIÓN ENTRE DICOTÓMICAS

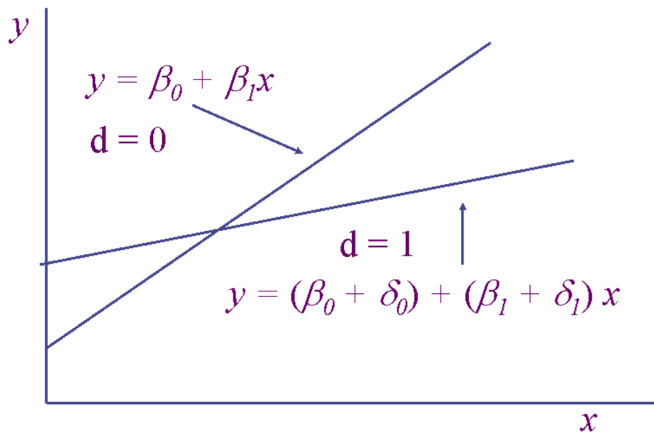
- Hasta el momento todas las dicotómicas vistas solo provocan cambios en los interceptos
- Es posible modelar cambios en las pendientes de la siguiente manera:  $y = \beta_0 + \beta_1 x + \delta_1 * x * mujer + u$ :
  - $mujer=0$ ;  $y = \beta_0 + \beta_1 x + u$
  - $mujer=1$ ;  $y = \beta_0 + (\beta_1 + \delta_1)x + u$
- Aunque en general se podría modelar cambio en la pendiente y en el intercepto a la vez:  $y = \beta_0 + \delta_0 mujer + \beta_1 x + \delta_1 x * mujer + u$ 
  - $mujer=0$ ;  $y = \beta_0 + \beta_1 x + u$
  - $mujer=1$ ;  $y = (\beta_0 + \delta_0) + (\beta_1 + \delta_1)x + u$

# TÉRMINOS DE INTERACCIÓN ENTRE DICOTÓMICAS

- Hasta el momento todas las dicotómicas vistas solo provocan cambios en los interceptos
- Es posible modelar cambios en las pendientes de la siguiente manera:  $y = \beta_0 + \beta_1 x + \delta_1 * x * mujer + u$ :
  - $mujer=0$ ;  $y = \beta_0 + \beta_1 x + u$
  - $mujer=1$ ;  $y = \beta_0 + (\beta_1 + \delta_1)x + u$
- Aunque en general se podría modelar cambio en la pendiente y en el intercepto a la vez:  $y = \beta_0 + \delta_0 mujer + \beta_1 x + \delta_1 x * mujer + u$ 
  - $mujer=0$ ;  $y = \beta_0 + \beta_1 x + u$
  - $mujer=1$ ;  $y = (\beta_0 + \delta_0) + (\beta_1 + \delta_1)x + u$

# TÉRMINOS DE INTERACCIÓN ENTRE DICOTÓMICAS

Gráficamente y cuando  $\delta_0 > 0$  y  $\delta_1 < 0$  se tendría:



```
. use datos, clear
. reg bmi Z1 age
```

Source	SS	df	MS	Number of obs	=	3,278
Model	1701.34797	2	850.673984	F(2, 3275)	=	27.72
Residual	100512.889	3,275	30.6909585	Prob > F	=	0.0000
Total	102214.237	3,277	31.1914059	R-squared	=	0.0166
				Adj R-squared	=	0.0160
				Root MSE	=	5.5399

bmi	Coef.	Std. Err.	t	P> t	[95% Conf. Interval]	
Z1	3.939848	.6174998	6.38	0.000	2.729123	5.150573
age	-.0816753	.0218862	-3.73	0.000	-.1245873	-.0387632
_cons	29.2826	1.572287	18.62	0.000	26.19984	32.36537

```
. use datos, clear
. reg bmi Z1 age mujer
```

Source	SS	df	MS	Number of obs	=	3,278
				F(3, 3274)	=	43.62
Model	3928.34017	3	1309.44672	Prob > F	=	0.0000
Residual	98285.897	3,274	30.0201274	R-squared	=	0.0384
				Adj R-squared	=	0.0376
Total	102214.237	3,277	31.1914059	Root MSE	=	5.4791

bmi	Coef.	Std. Err.	t	P> t	[95% Conf. Interval]	
Z1	3.768941	.6110363	6.17	0.000	2.570889	4.966993
age	-.0778696	.0216502	-3.60	0.000	-.1203189	-.0354204
mujer	1.658769	.1925896	8.61	0.000	1.28116	2.036377
_cons	28.25224	1.559604	18.12	0.000	25.19434	31.31014

```
. use datos, clear
. reg bmi Z1 age mujer mujer_Z1
```

Source	SS	df	MS	Number of obs	=	3,278
-----+-----				F(4, 3273)	=	33.96
Model	4073.37779	4	1018.34445	Prob > F	=	0.0000
Residual	98140.8593	3,273	29.984986	R-squared	=	0.0399
-----+-----				Adj R-squared	=	0.0387
Total	102214.237	3,277	31.1914059	Root MSE	=	5.4759

bmi	Coef.	Std. Err.	t	P> t	[95% Conf. Interval]	
-----+-----						
Z1	2.480199	.8463405	2.93	0.003	.8207887	4.13961
age	-.0786235	.0216402	-3.63	0.000	-.1210532	-.0361937
mujer	1.88688	.2186435	8.63	0.000	1.458188	2.315572
mujer_Z1	2.688477	1.222413	2.20	0.028	.2917055	5.085248
_cons	28.19	1.558947	18.08	0.000	25.13339	31.24661
-----+-----						

# CONTENIDO

- 1 VARIABLES DUMMY
  - Variable dummy como variable independiente
  - Términos de interacción entre dicotómicas
  - Test de Chow o de quiebre estructural
- 2 MODELO DE PROBABILIDAD LINEAL
  - Modelo de probabilidad lineal
- 3 REFERENCIA



# TEST DE CHOW O DE QUIEBRE ESTRUCTURAL

- Probar si una función de regresión es diferente para un grupo versus otro grupo puede ser realizado probando la significancia conjunta de las variables dicotómicas y sus interacciones con otras variables.
- Alternativamente, una manera práctica de verificar que dos grupos tienen funciones de regresión distintas es empleando el test de Chow.
- Bajo este test se calculan tres regresiones y se compuntan la  $SCR$  asociados a cada regresión. La primera regresión es la regresión empleando todos los datos ( $SCR$ ) y las regresiones restantes son para cada grupo ( $SCR_1$  y  $SCR_2$ )
- Con las  $SCR$  se computa el estadístico  $F = \frac{[SCR - (SCR_1 + SCR_2)] / (k+1)}{(SCR_1 + SCR_2) / (n - 2(k+1))}$

# TEST DE CHOW O DE QUIEBRE ESTRUCTURAL

- Probar si una función de regresión es diferente para un grupo versus otro grupo puede ser realizado probando la significancia conjunta de las variables dicotómicas y sus interacciones con otras variables.
- Alternativamente, una manera práctica de verificar que dos grupos tienen funciones de regresión distintas es empleando el test de Chow.
- Bajo este test se calculan tres regresiones y se compuntan la  $SCR$  asociados a cada regresión. La primera regresión es la regresión empleando todos los datos ( $SCR$ ) y las regresiones restantes son para cada grupo ( $SCR_1$  y  $SCR_2$ )
- Con las  $SCR$  se computa el estadístico  $F = \frac{[SCR - (SCR_1 + SCR_2)] / (k+1)}{(SCR_1 + SCR_2) / (n - 2(k+1))}$

# TEST DE CHOW O DE QUIEBRE ESTRUCTURAL

- Probar si una función de regresión es diferente para un grupo versus otro grupo puede ser realizado probando la significancia conjunta de las variables dicotómicas y sus interacciones con otras variables.
- Alternativamente, una manera práctica de verificar que dos grupos tienen funciones de regresión distintas es empleando el test de Chow.
- Bajo este test se calculan tres regresiones y se compuntan la  $SCR$  asociados a cada regresión. La primera regresión es la regresión empleando todos los datos ( $SCR$ ) y las regresiones restantes son para cada grupo ( $SCR_1$  y  $SCR_2$ )
- Con las  $SCR$  se computa el estadístico  $F = \frac{[SCR - (SCR_1 + SCR_2)] / (k+1)}{(SCR_1 + SCR_2) / (n - 2(k+1))}$

# TEST DE CHOW O DE QUIEBRE ESTRUCTURAL

- Probar si una función de regresión es diferente para un grupo versus otro grupo puede ser realizado probando la significancia conjunta de las variables dicotómicas y sus interacciones con otras variables.
- Alternativamente, una manera práctica de verificar que dos grupos tienen funciones de regresión distintas es empleando el test de Chow.
- Bajo este test se calculan tres regresiones y se compuntan la  $SCR$  asociados a cada regresión. La primera regresión es la regresión empleando todos los datos ( $SCR$ ) y las regresiones restantes son para cada grupo ( $SCR_1$  y  $SCR_2$ )
- Con las  $SCR$  se computa el estadístico  $F = \frac{[SCR - (SCR_1 + SCR_2)] / (k+1)}{(SCR_1 + SCR_2) / (n - 2(k+1))}$

# CONTENIDO

## 1 VARIABLES DUMMY

- Variable dummy como variable independiente
- Términos de interacción entre dicotómicas
- Test de Chow o de quiebre estructural

## 2 MODELO DE PROBABILIDAD LINEAL

- Modelo de probabilidad lineal

## 3 REFERENCIA

# CONTENIDO

## 1 VARIABLES DUMMY

- Variable dummy como variable independiente
- Términos de interacción entre dicotómicas
- Test de Chow o de quiebre estructural

## 2 MODELO DE PROBABILIDAD LINEAL

- Modelo de probabilidad lineal

## 3 REFERENCIA

# MODELO DE PROBABILIDAD LINEAL

- Sea  $y$  una variable dicotómica. Entonces:  $E(y/x) = P(y = 1/x) * 1 + P(y = 0/x) * 0 = P(y = 1/x) * 1$
- Entonces, en este caso:  $E(y/x) = \beta_0 + \beta_1 x_1 + \dots + \beta_k x_k = P(y = 1/x)$
- Por lo tanto, la interpretación de  $\beta_i$  es el cambio en la probabilidad de éxito cuando  $x_i$  cambia
- El valor que predice este modelo es la probabilidad de éxito, que tiene el inconveniente que podría estar fuera del intervalo esperado de  $[0,1]$ .
- Otro problema que se tiene es que el modelo viola el supuesto de homocedasticidad (Probar!)

# MODELO DE PROBABILIDAD LINEAL

- Sea  $y$  una variable dicotómica. Entonces:  $E(y/x) = P(y = 1/x) * 1 + P(y = 0/x) * 0 = P(y = 1/x) * 1$
- Entonces, en este caso:  $E(y/x) = \beta_0 + \beta_1 x_1 + \dots + \beta_k x_k = P(y = 1/x)$
- Por lo tanto, la interpretación de  $\beta_i$  es el cambio en la probabilidad de éxito cuando  $x_i$  cambia
- El valor que predice este modelo es la probabilidad de éxito, que tiene el inconveniente que podría estar fuera del intervalo esperado de  $[0,1]$ .
- Otro problema que se tiene es que el modelo viola el supuesto de homocedasticidad (Probar!)



# MODELO DE PROBABILIDAD LINEAL

- Sea  $y$  una variable dicotómica. Entonces:  $E(y/x) = P(y = 1/x) * 1 + P(y = 0/x) * 0 = P(y = 1/x) * 1$
- Entonces, en este caso:  $E(y/x) = \beta_0 + \beta_1 x_1 + \dots + \beta_k x_k = P(y = 1/x)$
- Por lo tanto, la interpretación de  $\beta_i$  es el cambio en la probabilidad de éxito cuando  $x_i$  cambia
- El valor que predice este modelo es la probabilidad de éxito, que tiene el inconveniente que podría estar fuera del intervalo esperado de  $[0,1]$ .
- Otro problema que se tiene es que el modelo viola el supuesto de homocedasticidad (Probar!)

# MODELO DE PROBABILIDAD LINEAL

- Sea  $y$  una variable dicotómica. Entonces:  $E(y/x) = P(y = 1/x) * 1 + P(y = 0/x) * 0 = P(y = 1/x) * 1$
- Entonces, en este caso:  $E(y/x) = \beta_0 + \beta_1 x_1 + \dots + \beta_k x_k = P(y = 1/x)$
- Por lo tanto, la interpretación de  $\beta_i$  es el cambio en la probabilidad de éxito cuando  $x_i$  cambia
- El valor que predice este modelo es la probabilidad de éxito, que tiene el inconveniente que podría estar fuera del intervalo esperado de  $[0,1]$ .
- Otro problema que se tiene es que el modelo viola el supuesto de homocedasticidad (Probar!)

# MODELO DE PROBABILIDAD LINEAL

- Sea  $y$  una variable dicotómica. Entonces:  $E(y/x) = P(y = 1/x) * 1 + P(y = 0/x) * 0 = P(y = 1/x) * 1$
- Entonces, en este caso:  $E(y/x) = \beta_0 + \beta_1 x_1 + \dots + \beta_k x_k = P(y = 1/x)$
- Por lo tanto, la interpretación de  $\beta_i$  es el cambio en la probabilidad de éxito cuando  $x_i$  cambia
- El valor que predice este modelo es la probabilidad de éxito, que tiene el inconveniente que podría estar fuera del intervalo esperado de  $[0,1]$ .
- Otro problema que se tiene es que el modelo viola el supuesto de homocedasticidad (Probar!)

# CONTENIDO

- 1 VARIABLES DUMMY
  - Variable dummy como variable independiente
  - Términos de interacción entre dicotómicas
  - Test de Chow o de quiebre estructural
- 2 MODELO DE PROBABILIDAD LINEAL
  - Modelo de probabilidad lineal
- 3 REFERENCIA

# REFERENCIAS



Referencia 1



Referencia 2. *colocar alguna referencia*



Referencia 3. *colocar alguna referencia*

# Capítulo 07

## Referencia

## Referencias

### REFERENCIAS

 Referencia 1


 Referencia 2. *colocar alguna referencia*

 Referencia 3. *colocar alguna referencia*

- Agregar alguna nota

# ECONOMETRÍA BÁSICA

## CAPÍTULO 07: DUMMYS

José Valderrama & Freddy Rojas  
jtvalderrama@gmail.com & frojasca@gmail.com   
Universidad Católica Santo Toribio de Mogrovejo

Septiembre de 2021