

Curso libre:
Econometría en Python

Monitor encargado:
*Juan Felipe Acevedo
Pérez*

Correo: uniic_bog@unal.edu.co
Teléfono: 3165000 ext 12301

Variable dependiente discreta

Juan Felipe Acevedo Pérez
Monitor (a) Unidad de Informática

Variable dependiente discreta

Correo: uniic_bog@unal.edu.co

Teléfono: 3165000 ext 12301

¿Variables discretas?

Clasificación de variables:

- Continuas: Toman valores de un conjunto **no finito**.
- Discretas: Toman valores de un conjunto **finito**.

Las variables categóricas corresponden únicamente a un número finito de valores (alternativas o categorías).

¿Caso no binario?

Una variable categórica contiene k categorías (alternativas).

Si $k > 2$ entonces se trata de una variable **no binaria** (puede tomar más de dos valores).

Ejemplos:

- Elección de la marca de cerveza que una persona va a consumir.
- Combo de comida que alguien elige cuando va a cine.

Codificación de variables

Para codificar una variable no binaria se emplean m valores (un valor distinto para cada una de las m alternativas).

Ejemplo:

Marcas de cerveza. *Marca* $\left\{ \begin{array}{l} 1 \text{ si } \textit{Águila} \\ 2 \text{ si } \textit{Póker} \\ 3 \text{ si } \textit{C. Colombia} \\ 4 \text{ si } \textit{Corona} \\ 5 \text{ si } \textit{Heineken} \end{array} \right.$

Modelos con variable dependiente discreta

Lo que se estima no es el valor que toma la variable dependiente sino la probabilidad de que esta tome un valor específico.

$$Prob[y_i = j | \mathbf{x}_i] = P_{ji} = F_j(\mathbf{x}_i, \boldsymbol{\gamma})$$

Dependiendo de la forma que adopte $F_j(\mathbf{x}_i, \boldsymbol{\gamma})$ se tiene un modelo distinto: Logit Multinomial, Probit Multinomial, Logit Condicional, etc.

Restricción: un individuo (entidad), de las m alternativas posibles, solo puede elegir una.

Datos empleados

La información empleada para trabajar con modelos con variable dependiente discreta **no binaria** puede encontrarse en dos formatos: **wide** y **long**.

- En el formato **wide**, la información para cada individuo (entidad) se presenta en una única fila.
- En el formato **long**, la información para cada individuo (entidad) se presenta en m filas, cada una de las cuales corresponde a una de las alternativas de la variable dependiente, la cual toma el valor de 1 una única vez y de 0 $m - 1$ veces para cada individuo (¿Por qué?).

Ejemplo de formato *wide*

Individuo	Marca elegida	y	Ingreso del individuo	\$Águila	\$Póker	\$C. Colombia	\$Corona	\$Heineken
Individuo 1	Póker	2	COP 2,300,000	COP 2,600	COP 3,100	COP 3,300	COP 4,200	COP 4,100
Individuo 2	C. Colombia	3	COP 3,000,000	COP 3,300	COP 3,600	COP 4,000	COP 5,700	COP 5,500
Individuo 3	Corona	4	COP 2,700,000	COP 3,000	COP 3,300	COP 3,600	COP 5,000	COP 4,800
.
.
.
Individuo n	Águila	1	COP 2,500,000	COP 3,000	COP 3,400	COP 3,900	COP 4,300	COP 4,500

Correo: uniic_bog@unal.edu.co

Teléfono: 3165000 ext 12301

Ejemplo de formato *long*

Individuo	Marca elegida	Alternativas	y_j	Ingreso del individuo	\$ Alternativa
Individuo 1	Póker	Águila	$y_1 = 0$	COP 2,300,000	COP 2,600
Individuo 1	Póker	Póker	$y_2 = 1$	COP 2,300,000	COP 3,100
Individuo 1	Póker	C. Colombia	$y_3 = 0$	COP 2,300,000	COP 3,300
Individuo 1	Póker	Corona	$y_4 = 0$	COP 2,300,000	COP 4,200
Individuo 1	Póker	Heineken	$y_5 = 0$	COP 2,300,000	COP 4,100
Individuo 2	C. Colombia	Águila	$y_1 = 0$	COP 3,000,000	COP 3,300
Individuo 2	C. Colombia	Póker	$y_2 = 0$	COP 3,000,000	COP 3,600
Individuo 2	C. Colombia	C. Colombia	$y_3 = 1$	COP 3,000,000	COP 4,000
Individuo 2	C. Colombia	Corona	$y_4 = 0$	COP 3,000,000	COP 5,700
Individuo 2	C. Colombia	Heineken	$y_5 = 0$	COP 3,000,000	COP 5,500
Individuo 3	Corona	Águila	$y_1 = 0$	COP 2,700,000	COP 3,000
Individuo 3	Corona	Póker	$y_2 = 0$	COP 2,700,000	COP 3,300
Individuo 3	Corona	C. Colombia	$y_3 = 0$	COP 2,700,000	COP 3,600
Individuo 3	Corona	Corona	$y_4 = 1$	COP 2,700,000	COP 5,000
Individuo 3	Corona	Heineken	$y_5 = 0$	COP 2,700,000	COP 4,800
.
.
.
Individuo n	Águila	Águila	$y_1 = 1$	COP 2,500,000	COP 3,000
Individuo n	Águila	Póker	$y_2 = 0$	COP 2,500,000	COP 3,400
Individuo n	Águila	C. Colombia	$y_3 = 0$	COP 2,500,000	COP 3,900
Individuo n	Águila	Corona	$y_4 = 0$	COP 2,500,000	COP 4,300
Individuo n	Águila	Heineken	$y_5 = 0$	COP 2,500,000	COP 4,500

Correo: uniic_bog@unal.edu.co

Teléfono: 3165000 ext 12301

Variable dependiente en formato *long* y *wide*

Para el formato *wide*:

$$y = j$$

Para el formato *long*:

$$y_j = \begin{cases} 1 & \text{si } y = j \\ 0 & \text{si } y \neq j \end{cases}$$

Variables explicativas

Las variables explicativas usadas en los modelos con variable dependiente discreta se clasifican en:

- **Alternative-invariant regressors** (también llamados *case-specific regressors*)
- **Alternative-variant regressors** (también llamados *alternative-specific regressors*)

La clasificación de las variables explicativas es muy importante ya que dependiendo de su tipo se puede o no utilizar un determinado modelo.

Alternative-invariant regressors

Las variables de tipo *alternative-invariant regressors* no tienen correspondencia directa con determinada alternativa; los valores de estas variables varían entre individuos (entidades) pero no varían entre alternativas para el mismo individuo (entidad).

Ejemplo:

- El ingreso. ¿Por qué? Porque el ingreso **no** depende de la marca de cerveza elegida. El ingreso del Individuo I sigue siendo COP 2,300,000 sin importar si elige Águila, Póker, Corona, etc.

Alternative-variant regressors

Las variables de tipo *alternative-variant regressors* tienen correspondencia directa con determinada alternativa, por lo que su valor depende de esta; los valores de estas variables varían entre alternativas y también pueden variar entre individuos.

Ejemplo:

- El precio. ¿Por qué? Porque el precio **sí** depende de la alternativa: el precio de Águila no es el mismo que el de Póker o el de Heineken. Dependiendo de la alternativa elegida se pagará un precio distinto.

Modelo Logit Multinomial

El Modelo Logit Multinomial acepta **únicamente** variables de tipo ***alternative-invariant*** regressors.

La forma funcional que adopta es:

$$P_{ji} = Prob[y_i = j] = \frac{e^{(w_i^T \gamma_j)}}{\sum_{k=1}^m e^{(w_i^T \gamma_k)}}$$

en donde P_{ji} es la probabilidad de que el individuo i elija la alternativa j ; w_i es el vector de variables *alternative-invariant* para el individuo (entidad) i y γ_j es el vector de coeficientes correspondientes a la alternativa j .

Estimación en el Modelo Logit Multinomial

Para realizar la **estimación**, uno de los conjuntos de coeficientes se normaliza a cero, por lo que se obtienen $m - 1$ conjuntos de coeficientes.

La **categoría base** corresponde a la alternativa cuyo conjunto de coeficientes se normaliza a cero. La **interpretación** de los demás coeficientes se hace con referencia a la categoría base.

Coeficientes y Efectos Marginales

- Las magnitudes de los coeficientes en un modelo logit multinomial **no** tienen interpretación directa. Solo indican si aumenta (cuando el coeficiente es positivo) o disminuye (cuando el coeficiente es negativo) la probabilidad de que se elija la alternativa j , **en comparación** con la categoría base.
- Los coeficientes **no** cuantifican el impacto de una variable explicativa sobre la probabilidad; para esto se emplean los **efectos marginales**.
- **Importante:** ¡Los coeficientes son distintos dependiendo de la categoría base que se elija!

Efectos Marginales

Los efectos marginales en el Modelo Logit Multinomial están dados por:

$$\frac{\partial P_{ji}}{\partial w_f} = P_{ji} \left(\gamma_{jf} - \sum_{k=1}^m P_{ki} \gamma_{kf} \right)$$

Importante: Los efectos marginales no necesariamente tienen el mismo signo que los coeficientes asociados.

Medida “general” de efectos marginales

Al igual que en el Modelo Logit y el Modelo Probit, con n individuos (entidades) se obtienen n efectos marginales para la misma variable. Para hallar una medida “general” se puede usar efectos marginales *en la media* y efectos marginales *promedio*.

Importante: A diferencia de los coeficientes, sin importar la categoría base elegida, los efectos marginales siempre son los **mismos**.

Medida “general” de efectos marginales

Importante: Los efectos marginales (cuantificados con una medida “general”) de la misma variable deben sumar 0. Es decir:

$$\sum_{j=1}^m \frac{\partial P_j}{\partial w_f} = 0$$

en donde $\frac{\partial P_j}{\partial w_f}$ es el efecto marginal de la variable w_f sobre la probabilidad de elegir la alternativa j y existen m alternativas.

Referencias

- Katchova, A. (2013). Econometrics – Probit and Logit Models.
- Katchova, A. (2013, 2). Econometrics – Multinomial Probit and Logit Models.