117- Cuando se condiciona sobre los valores de las variables independientes en la muestra, es claro que la distribución muestral de los estimadores de MCO depende de la distribución subyacente de los errores. Para hacer manejables las distribuciones de muestreo de los , ahora se supondrá que en la población el error no observado está distribuido normalmente. Esto se conoce como supuesto de normalidad.

El supuesto de normalidad supone los otros 5 supuestos. Los 6 supuestos se conocen como “supuestos del modelo lineal clásico”, y marcan que los estimadores insesgados de varianza mínima.

118- Aunque el teorema del límite central (TLC) puede satisfacerse en tales casos, la aproximación normal puede ser mala dependiendo de cuántos factores aparezcan en u y de qué tan diferentes sean sus distribuciones. Otro problema serio con el argumento del TLC es que éste supone que todos los factores no observados afectan a y por separado en forma aditiva. Nada garantiza que esto sea así. Si u es una complicada función de los factores no observados, entonces el argumento del TLC no puede emplearse.

119- Ejemplo de salarios (salario mínimo, salario = 0). Evidencias empíricas anteriores indican que la normalidad no es un buen supuesto en el caso del salario. Con frecuencia, usando una transformación, en especial empleando el logaritmo, se obtiene una distribución que es cercana a la normal.

Diagrama

Descripción generada automáticamente

El que no haya normalidad en los errores no es un problema serio cuando los tamaños de muestra son grandes. Por ahora, sólo se hace el supuesto de normalidad.

Estos 6 supuestos permiten el test de hipótesis.



123- Pruebas contra alternativas de una cola. Nivel de significancia del 5%.

124- Para grados de libertad mayor a 120, pueden emplearse los valores críticos de la normal estándar.

Histograma

Descripción generada automáticamente

125- Ejemplo salarios – educ.

127- Uso de R2 para elegir la mejor forma funcional.

130-

Interfaz de usuario gráfica, Texto, Aplicación, Chat o mensaje de texto

Descripción generada automáticamente