# Modelos de Regresión II

Modelos Probabilísticos y Análisis Estadístico

#### Carlos Ricardo Bojacá

Departamento de Ciencias Básicas y Modelado Facultad de Ciencias Naturales e Ingeniería Universidad Jorge Tadeo Lozano



# El modelo de regresión lineal compuesta

La variable de respuesta y puede verse influenciada por más de una variable independiente

Por ejemplo, el rendimiento de un cultivo puede depender de la cantidad de fertilizantes a base de N, P y K que se le hayan aplicado.

Un modelo lineal que relaciona la variable de respuesta y con varias variables predictoras tiene la forma:

$$y = \beta_0 + \beta_1 x_1 + \beta_2 x_2 + ... \beta_k x_k + \epsilon$$

## El modelo de regresión lineal compuesta

- 1 Los parámetros  $\beta_0, \beta_1, ..., \beta_k$  representan los parámetros o coeficientes de regresión del modelo
- 2 La variable aleatoria  $\epsilon$  representa la variación aleatoria en y que no es explicada por el conjunto de variables explicatorias x

El modelo para la *i*-ésima observación estará dado por:

$$y_i = \beta_0 + \beta_1 x_{i1} + \beta_2 x_{i2} + ... \beta_k x_{ik} + \epsilon, i = 1, 2, ..., n$$

### **Cuadrados mínimos**

Modelo lineal compuesto

En notación matricial, la matriz X es una matriz  $n \times k$  en la que cada columna contiene n observaciones de la k-ésima variable independiente  $X_k$ .

Los parámetros mediante el método de cuadrados mínimos pueden ser estimados de acuerdo con la siguiente fórmula:

$$\hat{\beta} = (X'X)^{-1}X'y$$

#### **Cuadrados mínimos**

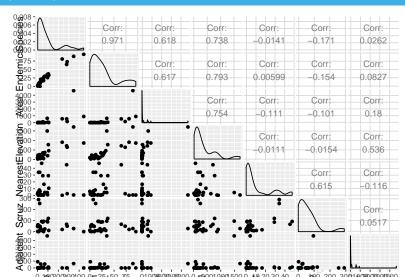
Ejemplo - Implementación

Datos gala: reporte de número de especies de tortugas en 30 de las Islas Galápagos

- · Species: número de especies de tortugas encontradas en la isla
- · Endemics: número de especies endémicas
- Area: área de la isla (km2)
- Elevation: altura máxima de la isla (m)
- · Nearest: distancia a la isla más cercana (km)
- Scruz: distancia a la isla de Santa Cruz (km)
- · Adjacent: área de la isla adyacente (km2)

## **Cuadrados mínimos**

Ejemplo - Implementación



## Modelo lineal compuesto

#### Ejemplo - Implementación

```
modcomp <- lm(Species ~ Area + Elevation + Nearest + Scruz + Adjacent,
             data = gala)
summary(modcomp)
##
## Call:
## lm(formula = Species ~ Area + Elevation + Nearest + Scruz + Adjacent,
##
      data = gala)
##
## Residuals:
       Min
             1Q Median 3Q
                                         Max
## -111.679 -34.898 -7.862 33.460 182.584
##
## Coefficients:
              Estimate Std. Error t value Pr(>|t|)
## (Intercept) 7.068221 19.154198 0.369 0.715351
## Area
        -0.023938 0.022422 -1.068 0.296318
## Elevation 0.319465 0.053663 5.953 3.82e-06 ***
## Nearest 0.009144 1.054136 0.009 0.993151
## Scruz -0.240524 0.215402 -1.117 0.275208
## Adjacent -0.074805 0.017700 -4.226 0.000297 ***
## ---
## Signif. codes: 0 '***' 0.001 '**' 0.01 '*' 0.05 '.' 0.1 ' ' 1
##
## Residual standard error: 60.98 on 24 degrees of freedom
## Multiple R-squared: 0.7658, Adjusted R-squared: 0.7171
## F-statistic: 15.7 on 5 and 24 DF, p-value: 6.838e-07
```

## Modelo lineal compuesto

Estimación de Parámetros

$$\hat{\beta} = (X'X)^{-1}X'y$$

## Modelo lineal compuesto

#### Estimación de Parámetros

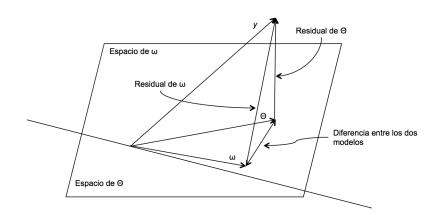
```
##
## Call:
## lm(formula = Species ~ Area + Elevation + Nearest + Scruz + Adjacent,
      data = gala)
##
## Residuals:
##
       Min
               10 Median 30
                                        Max
## -111.679 -34.898 -7.862 33.460 182.584
##
## Coefficients:
              Estimate Std. Error t value Pr(>|t|)
##
## (Intercept) 7.068221 19.154198 0.369 0.715351
## Area -0.023938 0.022422 -1.068 0.296318
## Elevation 0.319465 0.053663 5.953 3.82e-06 ***
## Nearest 0.009144 1.054136 0.009 0.993151
## Scruz -0.240524 0.215402 -1.117 0.275208
## Adjacent -0.074805 0.017700 -4.226 0.000297 ***
## ---
## Signif. codes: 0 '***' 0.001 '**' 0.01 '*' 0.05 '.' 0.1 ' ' 1
##
## Residual standard error: 60.98 on 24 degrees of freedom
## Multiple R-squared: 0.7658, Adjusted R-squared: 0.7171
## F-statistic: 15.7 on 5 and 24 DF, p-value: 6.838e-07
```

# Pruebas de hipótesis para comparar modelos

Dado un grupo de variables independientes, es consecuente definir si todas las variables del grupo son necesarias para explicar la respuesta de la variable dependiente

Considere un modelo grande,  $\theta$ , y uno más pequeño,  $\omega$ , que consiste en un subgrupo de predictores contenidos en  $\theta$ . Dependiendo del grado de ajuste entre los dos modelos, qué modelo preferiría?

## Pruebas de hipótesis para comparar modelos



## Pruebas de hipótesis para comparar modelos

Potencialmente, un buen estadístico para determinar cuál de los dos modelos es mejor sería:

$$\frac{RSS_{\omega} - RSS_{\theta}}{RSS_{\theta}}$$

Suponga que la dimensión (el número de parámetros) de  $\theta$  es p y la dimensión de  $\omega$  es q, entonces el estadístico teórico de la distribución sería:

$$F = rac{(RSS_{\omega} - RSS_{ heta})/(p-q)}{RSS_{ heta}/(n-p)} \sim F_{p-q,n-p}$$

En consecuencia se rechazaría la hipótesis nula si:

$$F > F_{p-q,n-p}^{(\alpha)}$$

## Distribución F

Distribución utilizada para estudiar las varianzas dentro de una población

Propiedades básicas:

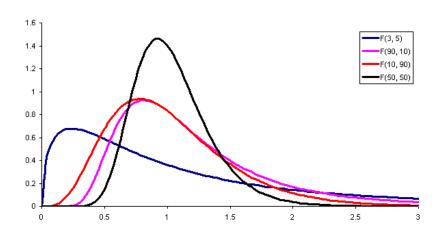
- 1 La distribución F es una distribución de familias
- 2 La distribución F es 0 o positiva pero no negativa
- 3 La distribución F es sesgada a la derecha

## Distribución F

#### Usos:

- 1 Probar si dos muestras independientes han sido seleccionadas de poblaciones normales con la misma varianza
- 2 Probar si dos valores independientes de la varianza de la población son homogéneos o no

## Distribución F



# Prueba para todas las variables predictoras

Siendo el modelo  $\theta$  igual a  $y = X\beta + \epsilon$  donde X es una matriz  $n \times p$  y el modelo reducido  $(\omega)$  igual a  $y = \mu \epsilon$ . La hipótesis nula es:

$$H_0: \beta_1 = ...\beta_{p-1} = 0$$

donde el estadístico sería:

$$F = \frac{(TSS - RSS)/(p-1)}{RSS/(n-p)}$$

con

$$RSS = RSS_{\theta} = (y - X\hat{\beta})'(y - X\hat{\beta})$$

У

$$RSS_{\omega} = (y - \bar{y})'(y - \bar{y}) = TSS$$

## Prueba para todas las variables predictoras

```
tss <- sum((gala$Species - mean(gala$Species))^2)
regss <- sum((fitted(modcomp) - mean(gala$Species))^2)</pre>
rss <- tss - regss
(fstat \leftarrow ((tss - rss)/(ncol(x) - 1))/(rss/
                                   (nrow(x) - ncol(x)))
## [1] 15.69941
1 - pf(fstat, ncol(x) - 1, nrow(x) - ncol(x))
## [1] 6.837893e-07
```

## Prueba para todas las variables predictoras

```
##
## Call:
## lm(formula = Species ~ Area + Elevation + Nearest + Scruz + Adjacent,
##
      data = gala)
##
## Residuals:
               1Q Median 3Q
       Min
                                        Max
## -111 679 -34 898 -7 862 33 460 182 584
##
## Coefficients:
##
              Estimate Std. Error t value Pr(>|t|)
## (Intercept) 7.068221 19.154198 0.369 0.715351
## Area -0.023938 0.022422 -1.068 0.296318
## Elevation 0.319465 0.053663 5.953 3.82e-06 ***
## Nearest 0.009144 1.054136 0.009 0.993151
## Scruz -0.240524 0.215402 -1.117 0.275208
## Adjacent -0.074805 0.017700 -4.226 0.000297 ***
## ---
## Signif. codes: 0 '***' 0.001 '**' 0.05 '.' 0.1 ' ' 1
##
## Residual standard error: 60.98 on 24 degrees of freedom
## Multiple R-squared: 0.7658.Adjusted R-squared: 0.7171
## F-statistic: 15.7 on 5 and 24 DF, p-value: 6.838e-07
```

Puede ser una variable independiente suprimida del modelo? La hipótesis nula sería:

$$H_0: \beta_i = 0$$

En este caso,  $RSS_{\theta}$  será el RSS del modelo con todas las variables explicatorias de interés que tiene p parámetros y  $RSS_{\omega}$  será el RSS para el modelo con las mismas variables independientes excepto el predictor i

El estadístico F se calcula utilizando la fórmula estándar. Una alternativa es utilizar el estadístico t para probar esta hipótesis:

$$t_i = \hat{eta}_i/se(\hat{eta}_i)$$

y se verifica la significancia utilizando una distribución t con n-p grados de libertad

#### Es posible omitir la variable Area del modelo?

El valor de p obtenido a partir del estadístico t será:

```
sqrt(fstat)
## [1] 1.067611
(tstat <- summary(modcomp)$coef[2, 3])</pre>
## [1] -1.067611
2 * (1 - pt(sqrt(fstat), nrow(x) - ncol(x)))
## [1] 0.296318
```

Una manera más conveniente de comparar dos modelos anidados es:

```
anova(modcomp, modcomp2)

## Analysis of Variance Table

##

## Model 1: Species ~ Area + Elevation + Nearest + Scruz + Adjacent

## Model 2: Species ~ Elevation + Nearest + Scruz + Adjacent

## Res.Df RSS Df Sum of Sq F Pr(>F)

## 1 24 89231

## 2 25 93469 -1 -4237.7 1.1398 0.2963
```

Qué variables explicatorias debería incluir un modelo simplificado para las especies de tortuga?

Los modelos lineales compuestos permiten la inclusión de variables cualitativas (categóricas) dentro de su estructura

R utiliza un esquema de códigos dummy donde compara cada nivel de la variable con respecto a un nivel de referencia fijo.

```
data(iris)
head(iris)
##
    Sepal.Length Sepal.Width Petal.Length Petal.Width Species
           5.1
                     3.5
                                1.4
                                          0.2
## 1
                                              setosa
## 2
           4.9
                  3.0
                              1.4
                                          0.2 setosa
## 3
           4.7
                   3.2
                              1.3
                                        0.2 setosa
         4.6
                   3.1
                              1.5
                                        0.2 setosa
## 4
## 5
         5.0
                   3.6
                              1.4
                                        0.2 setosa
## 6
           5.4
                     3.9
                                1.7
                                          0.4
                                              setosa
```

```
##
## Call:
## lm(formula = Sepal.Length ~ Sepal.Width + Petal.Length + Petal.Width +
      Species, data = iris)
##
## Residuals:
                                     Max
      Min
              1Q Median
## -0.79424 -0.21874 0.00899 0.20255 0.73103
##
## Coefficients:
##
                 Estimate Std. Error t value Pr(>|t|)
## (Intercept)
               2.17127 0.27979 7.760 1.43e-12 ***
## Sepal.Width 0.49589 0.08607 5.761 4.87e-08 ***
## Petal.Length 0.82924 0.06853 12.101 < 2e-16 ***
## Petal Width
             -0.31516 0.15120 -2.084 0.03889 *
## Speciesvirginica -1.02350 0.33373 -3.067 0.00258 **
## ---
## Signif. codes: 0 '***' 0.001 '**' 0.05 '.' 0.1 ' ' 1
##
## Residual standard error: 0.3068 on 144 degrees of freedom
## Multiple R-squared: 0.8673, Adjusted R-squared: 0.8627
## F-statistic: 188.3 on 5 and 144 DF, p-value: < 2.2e-16
```

#### La variable Species tiene tres niveles: setosa, versicolor, virginica

```
x <- model.matrix(irislm)
head(x)
    (Intercept) Sepal.Width Petal.Length Petal.Width Speciesversicolor
## 1
                       3.5
                                             0.2
                       3.0
                                 1.4
                                             0.2
                                            0.2
                      3.2
                               1.5
                      3.1
## 4
                                            0.2
                               1.4
                                           0.2
## 5
                      3.6
                               1.7
## 6
                      3.9
                                            0.4
    Speciesvirginica
## 1
## 3
## 5
## 6
```

```
## 2 3
## 1 0 0
## 2 1 0
## 3 0 1
```

## Estimación de parámetros

La estimación de parámetros sigue el mismo procedimiento. Para cada nivel de la variable categórica se estima su correspondiente parámetro, excepto para el primer nivel cuyo valor siempre será 0

## Predicción de la variable de respuesta

```
predict(irislm,
        newdata = data.frame(Sepal.Width = 3.5, Petal.Length = 1.6,
                             Petal.Width = 0.3, Species = "setosa"))
## 1
## 5.139121
coef(irislm)[1] +
  coef(irislm)[2] * 3.5 +
  coef(irislm)[3] * 1.6 +
  coef(irislm)[4] * 0.3 +
 0 +
  coef(irislm)[5] * 0 +
  coef(irislm)[6] * 0
## (Intercept)
     5.139121
```

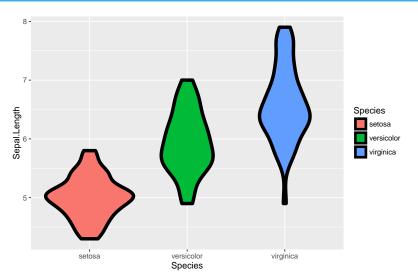
## Predicción de la variable de respuesta

```
predict(irislm,
        newdata = data.frame(Sepal.Width = 3.5, Petal.Length = 1.6,
                             Petal.Width = 0.3, Species = "versicolor")
## 1
## 4.415559
coef(irislm)[1] +
  coef(irislm)[2] * 3.5 +
  coef(irislm)[3] * 1.6 +
  coef(irislm)[4] * 0.3 +
  0 +
  coef(irislm)[5] * 1 +
  coef(irislm)[6] * 0
## (Intercept)
     4.415559
```

## Predicción de la variable de respuesta

```
predict(irislm,
        newdata = data.frame(Sepal.Width = 3.5, Petal.Length = 1.6,
                             Petal.Width = 0.3, Species = "virginica"))
## 1
## 4.115623
coef(irislm)[1] +
  coef(irislm)[2] * 3.5 +
  coef(irislm)[3] * 1.6 +
  coef(irislm)[4] * 0.3 +
 0 +
  coef(irislm)[5] * 0 +
  coef(irislm)[6] * 1
## (Intercept)
     4.115623
```

```
##
## Call:
## lm(formula = Sepal.Length ~ Species, data = iris)
##
## Residuals:
      Min
              10 Median
                                     Max
## -1.6880 -0.3285 -0.0060 0.3120 1.3120
##
## Coefficients:
                    Estimate Std. Error t value Pr(>|t|)
                  5.0060
                                0.0728 68.762 < 2e-16 ***
## (Intercept)
## Speciesversicolor 0.9300 0.1030 9.033 8.77e-16 ***
## Speciesvirginica 1.5820
                                0.1030 15.366 < 2e-16 ***
## Signif. codes: 0 '***' 0.001 '**' 0.01 '*' 0.05 '.' 0.1 ' ' 1
##
## Residual standard error: 0.5148 on 147 degrees of freedom
## Multiple R-squared: 0.6187, Adjusted R-squared: 0.6135
## F-statistic: 119.3 on 2 and 147 DF, p-value: < 2.2e-16
```



Suponga que usted desea predecir la calificación final de una asignatura (y) a partir de un conjunto de variables explicatorias entre las que se encuentran las calificaciones de los componentes teórico  $(X_j)$  y práctico  $(X_k)$  de la asignatura, los cuales son aditivos

La pregunta sería si se necesitan las dos calificaciones por separado o si se pueden reemplazar por el total  $X_j + X_k$ . El modelo original sería:

$$y = \beta_0 + \dots + \beta_j X_j + \beta_k X_k + \dots + \epsilon$$

El modelo simplificado sería:

$$y = \beta_0 + \dots + \beta_l(X_i + X_k) + \dots + \epsilon$$

el cual requiere que  $\beta_i = \beta_k$  para que esta simplificación sea posible. Luego la hipótesis nula será:

$$H_0: \beta_j = \beta_k$$

Esto define un subespacio en el que el procedimiento de la prueba de F aplica.

**Ejemplo** 

Los datos savings contienen los promedios de variables económicas de 50 países de 1960 a 1970. dpi es el ingreso per cápita en dólares, ddpi es la tasa de cambio en el ingreso per cápita, sr es el ahorro personal dividido por el ingreso. También incluye el porcentaje de población menor a 15 (pop15) y mayor a 75 años (pop75)

```
## 'data.frame': 50 obs. of 5 variables:
## $ sr : num 11.43 12.07 13.17 5.75 12.88 ...
## $ pop15: num 29.4 23.3 23.8 41.9 42.2 ...
## $ pop75: num 2.87 4.41 4.43 1.67 0.83 2.85 1.34 0.67 1.06 1.14 ...
## $ dpi : num 2330 1508 2108 189 728 ...
## $ ddpi : num 2.87 3.93 3.82 0.22 4.56 2.43 2.67 6.51 3.08 2.8 ...
```

**Ejemplo** 

En este caso, se puede plantear que el efecto de la gente joven y mayor es el mismo:

$$H_0: \beta_{pop15} = \beta_{pop75}$$

En este caso el modelo tomaría la forma:

$$y = \beta_0 + \beta_{dep}(pop15 + pop75) + \beta_{dpi}dpi + \beta_{ddpi}ddpi + \epsilon$$

```
savlm <- lm(sr ~ pop15 + pop75 + dpi + ddpi, savings)
summary(savlm)
##
## Call:
## lm(formula = sr ~ pop15 + pop75 + dpi + ddpi, data = savings)
##
## Residuals:
      Min
              1Q Median 3Q
                                    Max
## -8.2422 -2.6857 -0.2488 2.4280 9.7509
##
## Coefficients:
                Estimate Std. Error t value Pr(>|t|)
##
## (Intercept) 28.5660865 7.3545161 3.884 0.000334 ***
        -0.4611931 0.1446422 -3.189 0.002603 **
## pop15
## pop75 -1.6914977 1.0835989 -1.561 0.125530
           -0.0003369 0.0009311 -0.362 0.719173
## dpi
## ddpi
             0.4096949 0.1961971 2.088 0.042471 *
## ---
## Signif. codes: 0 '***' 0.001 '**' 0.01 '*' 0.05 '.' 0.1 ' ' 1
##
## Residual standard error: 3.803 on 45 degrees of freedom
## Multiple R-squared: 0.3385, Adjusted R-squared: 0.2797
## F-statistic: 5.756 on 4 and 45 DF, p-value: 0.0007904
```

```
savlm2 <- lm(sr ~ I(pop15 + pop75) + dpi + ddpi, savings)
summary(savlm2)
##
## Call:
## lm(formula = sr ~ I(pop15 + pop75) + dpi + ddpi, data = savings)
##
## Residuals:
     Min 10 Median 30 Max
## -7.787 -2.767 -0.125 1.744 10.342
##
## Coefficients:
                   Estimate Std. Error t value Pr(>|t|)
##
## (Intercept) 21.6093051 4.8833633 4.425 5.87e-05 ***
## I(pop15 + pop75) -0.3336331 0.1038679 -3.212 0.00241 **
## dpi
                 -0.0008451 0.0008444 -1.001 0.32212
                  0.3909649 0.1968714 1.986 0.05302 .
## ddpi
## ---
## Signif. codes: 0 '***' 0.001 '**' 0.05 '.' 0.1 ' ' 1
##
## Residual standard error: 3.827 on 46 degrees of freedom
## Multiple R-squared: 0.3152.Adjusted R-squared: 0.2705
## F-statistic: 7.056 on 3 and 46 DF, p-value: 0.0005328
```

```
anova(savlm2, savlm)

## Analysis of Variance Table

##

## Model 1: sr ~ I(pop15 + pop75) + dpi + ddpi

## Model 2: sr ~ pop15 + pop75 + dpi + ddpi

## Res.Df RSS Df Sum of Sq F Pr(>F)

## 1     46 673.63

## 2     45 650.71 1     22.915 1.5847 0.2146
```

Definición de parámetros a priori

# Definición de parámetros a priori

Suponga que se desea probar si el valor de uno de los coeficientes de la regresión se puede definir de antemano. Por ejemplo:

$$H_0: \beta_{ddpi} = 0.5$$

El modelo nulo tomaría la siguiente forma:

$$y = \beta_0 + \beta_{pop15}pop15 + \beta_{pop75}pop75 + \beta_{dpi}dpi + 0.5ddpi + \epsilon$$

El valor fijo del parámetro ddpi en la ecuación de regresión se denomina un offset

Definición de parámetros a priori

# Definición de parámetros a priori

Suponga que se desea probar si el valor de uno de los coeficientes de la regresión se puede definir de antemano. Por ejemplo:

$$H_0: \beta_{ddpi} = 0.5$$

El modelo nulo tomaría la siguiente forma:

$$y = \beta_0 + \beta_{pop15}pop15 + \beta_{pop75}pop75 + \beta_{dpi}dpi + 0.5ddpi + \epsilon$$

El valor fijo del parámetro ddpi en la ecuación de regresión se denomina un offset

```
savlm3 \leftarrow lm(sr \sim pop15 + pop75 + dpi + offset(0.5 * ddpi),
             savings)
anova(savlm3, savlm)
## Analysis of Variance Table
##
## Model 1: sr ^{\sim} pop15 + pop75 + dpi + offset(0.5 * ddpi)
## Model 2: sr ~ pop15 + pop75 + dpi + ddpi
##
    Res.Df RSS Df Sum of Sq F Pr(>F)
## 1 46 653.78
## 2 45 650.71 1 3.0635 0.2119 0.6475
```

# Ejercicio a resolver

Una firma de abogados ha sido consultada para representar a un grupo de mujeres que pretenden demandar a su empleador por discriminación de género, especialmente por el pago recibido. Las mujeres argumentan que los incrementos salariales son de manera consistente y considerable más bajos que los aumentos que obtienen los hombres.

De otro lado la compañía argumenta que los incrementos están basados enteramente en el rendimiento en el trabajo, el cual es medido por un supervisor imparcial a través de una evaluación que incluye una serie de indicadores de rendimiento. Se ha pedido que la firma de abogados realice una evaluación preliminar de los méritos de la demanda.

## Ejercicio a resolver

Situación de algunos empleados de la compañía seleccionados al azar:

Stradeon de digunos empiedos de la compania sereccionados di dzar.					
Individuo	Sexo	Calificación calidad	Años	División	Incremento
1	F	10	9	Producción	21000
2	F	90	1	Producción	96000
3	F	20	4	Producción	47000
4	F	80	1	Producción	128000
5	F	30	4	Investigación	64000
6	F	70	1	Investigación	52000
7	F	10	4	Ventas	73000
8	F	15	7	Producción	19000
9	М	20	6	Investigación	128000
10	М	80	3	Ventas	474000
11	М	50	3	Investigación	342000
12	M	70	2	Ventas	330000
13	М	30	7	Ventas	185000
14	M	70	7	Ventas	331000
15	M	40	1	Ventas	267000
16	M	90	6	Producción	517000
17	M	50	8	Producción	390000

# Ejercicio a resolver

- · Sería admitible la demanda de las mujeres?
- Cuáles son los factores que definen el incremento de salarios en la compañía?
- Cómo afecta el género el incremento de salarios en la compañía?