

Capitulo_3_Regresion_Multiple

Econometría para la Gestión (ECO_EPG) - FEN UAH

Tabla de contenidos

1	1. Material descargable	2
2	Configuración inicial	2
3	Lectura de datos	3
4	Matriz de correlación	3
4.0.1	Gráficos de exploración	4
5	Modelo de regresión múltiple	5
6	Residuos del modelo	6
6.0.1	Normalidad de los residuos	8
6.0.2	Autocorrelación (Durbin-Watson)	8
6.0.3	Heterocedasticidad (Breusch-Pagan)	8
7	Estadístico F calculado a mano	9
8	Desviación estándar del error	9
9	Intervalos de confianza de los coeficientes	9
9.0.1	Cálculo manual del intervalo	10
10	Intervalo para la varianza del error	10
11	Predicción puntual	10
12	Intervalo de confianza con predict	11
13	Predicción manual paso a paso	11
13.0.1	Intervalo manual	11

14 Gráfico Y real vs Y predicho	12
15 Modelo sin constante	12
15.0.1 Análisis de residuos modelo sin constante	13

1. 1. Material descargable

Descargar PDF de contenidos teóricos

El documento incluye:

- Matriz de correlación y multicolinealidad.
- Supuestos del modelo clásico de regresión múltiple.
- Derivación de estimadores OLS $(X'X)^{-1}X'Y$.
- Varianza del error y matriz de covarianza del estimador.
- R^2 , R^2 ajustado y prueba F global.
- Inferencia individual sobre coeficientes (t -tests).
- Intervalos de confianza.
- Pruebas de autocorrelación y heterocedasticidad.

2. Configuración inicial

```
library(openxlsx)
library(corrplot)
library(lmtest)
```

Definimos tu ruta de datos:

```
ruta_datos <- "C:/Users/manue/Desktop/lab-econometria/labs_epg/data_epg"
list.files(ruta_datos)
```

```
[1] "annos_mantenimiento.xlsx"  "auto_peso_consumo.xlsx"
[3] "costos.xlsx"                 "data_PCA_Decathlon.csv"
[5] "data_PCA_ExpertWine.csv"    "Ejemplo1.xlsx"
[7] "Ejemplo2.xlsx"                "millaje.txt"
[9] "orange.csv"                  "tabla_ejemplo_R.xlsx"
```

3. Lectura de datos

```
archivo <- file.path(ruta_datos, "costos.xlsx")
datos <- read.xlsx(archivo, sheet="Hoja1", colNames=TRUE)
head(datos)
```

	Costos_generales	Horas_mano_de_obra	Horas_maquina	Numero_preparaciones	
1	155000	985	1060		200
2	160000	1068	1080		225
3	170000	1095	1100		250
4	165000	1105	1200		202
5	185000	1200	1600		210
6	135000	1160	1100		150

Los datos contienen:

- **Costos_generales** (variable dependiente).
- **Horas_maquina** y **Numero_preparaciones** (variables explicativas).

4. Matriz de correlación

La matriz de correlación nos permite:

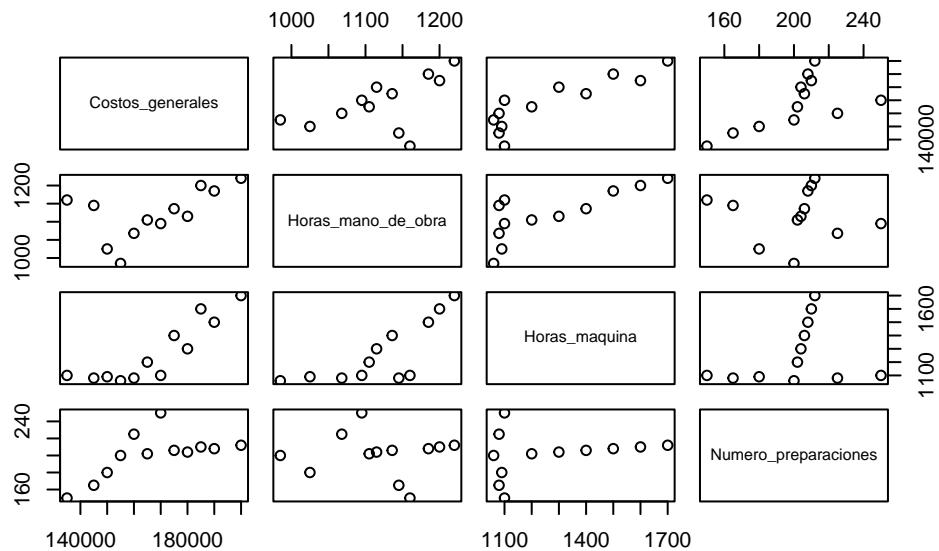
- Detectar **relaciones lineales** entre pares de variables.
- Identificar **multicolinealidad** entre regresores.

```
r <- cor(datos)
r
```

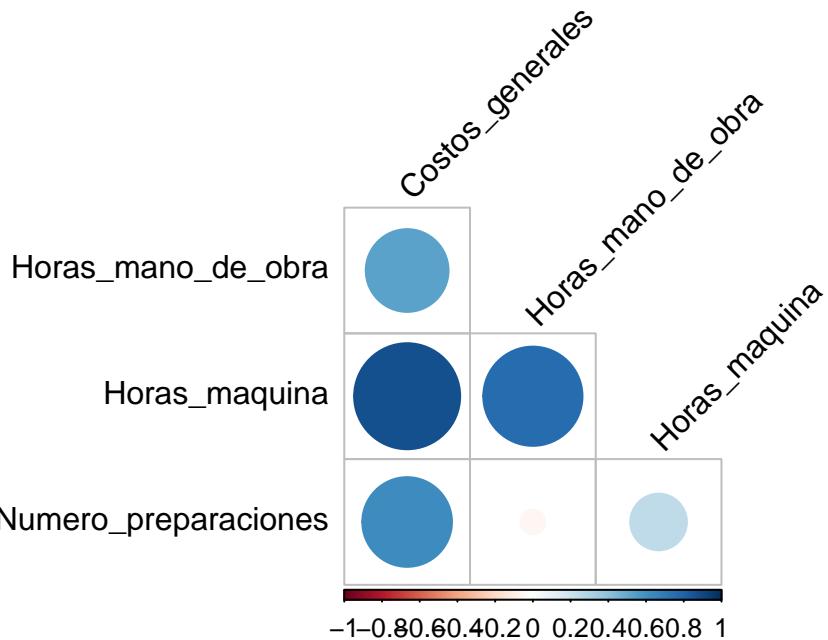
	Costos_generales	Horas_mano_de_obra	Horas_maquina
Costos_generales	1.0000000	0.53462157	0.8775005
Horas_mano_de_obra	0.5346216	1.00000000	0.7680722
Horas_maquina	0.8775005	0.76807222	1.0000000
Numero_preparaciones	0.6274762	-0.04731148	0.2507478
Numero_preparaciones	0.62747618		
Costos_generales		-0.04731148	
Horas_mano_de_obra		0.25074784	
Horas_maquina			1.0000000
Numero_preparaciones			

4.0.1. Gráficos de exploración

```
pairs(datos)
```



```
corrplot(r, method="circle", type="lower", diag=FALSE,
         tl.col="black", tl.cex=1, tl.srt=45)
```



Nota

Interpretación pedagógica:

- Valores altos en la correlación entre regresores → **multicolinealidad**.
- Esto puede inflar varianzas de los estimadores y hacer inestables los coeficientes.
- La matriz y el corrplot permiten detectar problemas antes de ajustar el modelo.

5. Modelo de regresión múltiple

Ajustamos el modelo:

$$\text{Costos} = \beta_0 + \beta_1(\text{Horas_maquina}) + \beta_2(\text{Numero_preparaciones}) + \varepsilon$$

```
modelo <- lm(Costos_generales ~ Horas_maquina + Numero_preparaciones, data=datos)
summary(modelo)
```

Call:

```
lm(formula = Costos_generales ~ Horas_maquina + Numero_preparaciones,
  data = datos)
```

Residuals:

Min	1Q	Median	3Q	Max
-7157	-2827	768	1449	9407

Coefficients:

	Estimate	Std. Error	t value	Pr(> t)
(Intercept)	19796.44	12787.83	1.548	0.156013
Horas_maquina	65.44	6.74	9.709	4.57e-06 ***
Numero_preparaciones	322.21	58.66	5.493	0.000384 ***

Signif. codes: 0 '***' 0.001 '**' 0.01 '*' 0.05 '.' 0.1 ' ' 1

Residual standard error: 4951 on 9 degrees of freedom

Multiple R-squared: 0.9472, Adjusted R-squared: 0.9354

F-statistic: 80.66 on 2 and 9 DF, p-value: 1.792e-06

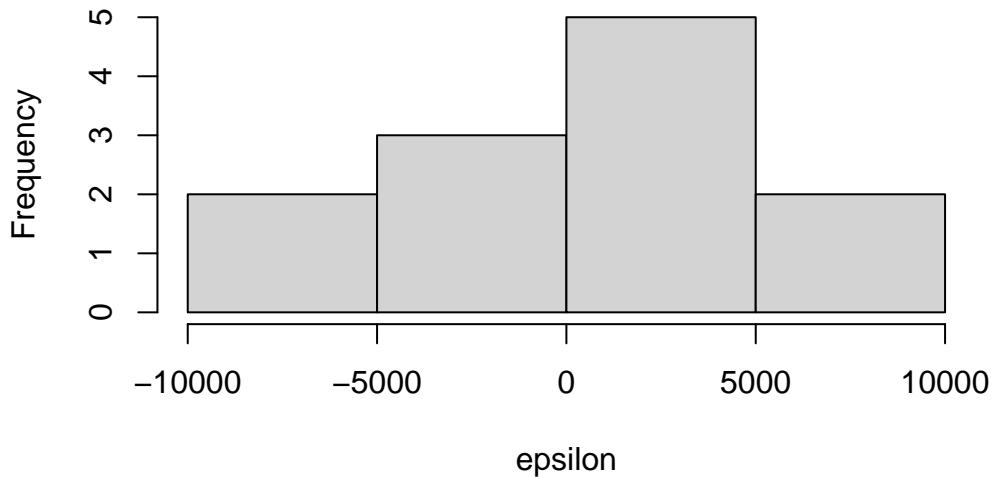
i Nota

- **Prueba individual (t test):** evalúa si cada (β_j) es distinto de 0.
- **Prueba global (F test):** evalúa si el modelo en conjunto explica la variable dependiente.
- **Signo de (β_j):** indica dirección del efecto.
- **Magnitud:** indica cuánto cambia Y ante un cambio unitario en el regresor.
- **p-values pequeños:** evidencia estadística de relación significativa.

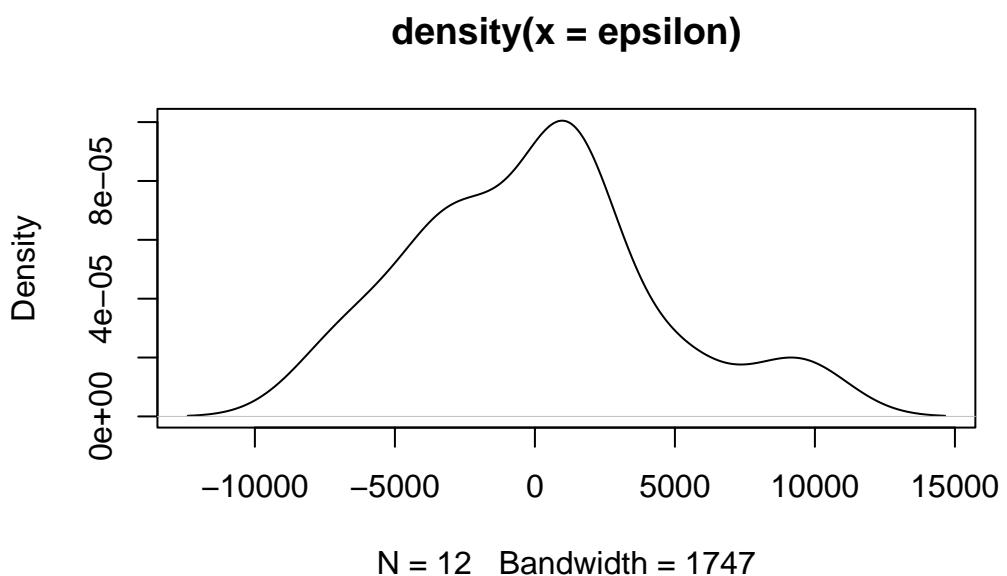
6. Residuos del modelo

```
epsilon <- modelo$residuals  
hist(epsilon)
```

Histogram of epsilon



```
plot(density(epsilon))
```



```
mean(epsilon)
```

```
[1] 1.705303e-13
```

6.0.1. Normalidad de los residuos

```
shapiro.test(epsilon)
```

```
Shapiro-Wilk normality test

data: epsilon
W = 0.95577, p-value = 0.7222
```

6.0.2. Autocorrelación (Durbin–Watson)

```
dwtest(modelo, alternative="two.sided", iterations=1000)
```

```
Durbin-Watson test

data: modelo
DW = 2.0815, p-value = 0.7416
alternative hypothesis: true autocorrelation is not 0
```

Interpretación:

- DW = 2 → no autocorrelación
- DW < 2 → autocorrelación positiva
- DW > 2 → autocorrelación negativa

6.0.3. Heterocedasticidad (Breusch–Pagan)

```
bptest(modelo)
```

```
studentized Breusch-Pagan test
```

```
data: modelo  
BP = 1.0153, df = 2, p-value = 0.6019
```

7. Estadístico F calculado a mano

```
R2 <- 0.9472  
F <- (R2/2)/((1-R2)/(12-3))  
F
```

```
[1] 80.72727
```

```
qf(0.05, 2, 9, lower.tail=FALSE)
```

```
[1] 4.256495
```

Interpretación: si F calculado > F crítico → el modelo **aporta información significativa**.

8. Desviación estándar del error

```
s <- sqrt(sum(epsilon^2)/(12-2-1))  
s
```

```
[1] 4951.106
```

9. Intervalos de confianza de los coeficientes

```
confint(modelo)
```

	2.5 %	97.5 %
(Intercept)	-9131.64046	48724.5095
Horas_maquina	50.18894	80.6827
Numero_preparaciones	189.50994	454.9046

9.0.1. Cálculo manual del intervalo

```
se <- sqrt(diag(vcov(modelo)))
t <- -1*qt(0.025, 12-2-1, lower.tail=FALSE)

BHM <- 65.44
sbhm <- 6.74

limitsupBHM <- BHM + t*sbhm
limitinfBHM <- BHM - t*sbhm
limitsupBHM; limitinfBHM
```

[1] 50.19306

[1] 80.68694

10. Intervalo para la varianza del error

```
gamma1 <- qchisq(0.025, 12-2-1)
gamma2 <- qchisq(0.975, 12-2-1)

s2_LI <- (12-2-1) * s^2 / gamma2
s2_LS <- (12-2-1) * s^2 / gamma1

s2_LI; s2_LS
```

[1] 11597739

[1] 81699732

11. Predicción puntual

```
nuevo <- data.frame(Horas_maquina=2000, Numero_preparaciones=220)

valor_predicho <- predict(modelo, newdata=nuevo)
valor_predicho
```

```
1  
221553.7
```

12. Intervalo de confianza con predict

```
valor_predicho2 <- predict(modelo, newdata=nuevo, interval="confidence")  
valor_predicho2
```

```
fit      lwr      upr  
1 221553.7 210265.6 232841.8
```

13. Predicción manual paso a paso

Construimos la matriz (X):

```
X <- cbind(1, datos$Horas_maquina, datos$Numero_preparaciones)  
M <- solve(t(X) %*% X)  
beta <- M %*% t(X) %*% datos$Costos_generales  
  
x0 <- c(1, 2000, 220)  
h0 <- t(x0) %*% M %*% x0  
  
y0 <- t(beta) %*% x0  
y0
```

```
[,1]  
[1,] 221553.7
```

13.0.1. Intervalo manual

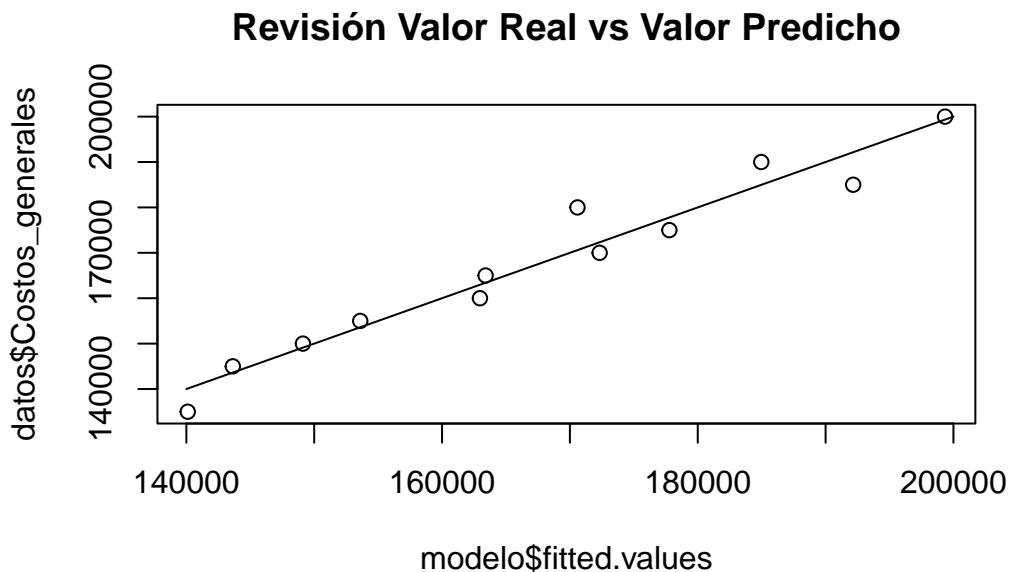
```
y_limsup <- y0 + s*sqrt(1+h0)*qt(0.975, 12-2-1, lower.tail=FALSE)  
y_liminf <- y0 - s*sqrt(1+h0)*qt(0.975, 12-2-1, lower.tail=FALSE)  
  
y_liminf; y_limsup
```

```
[,1]
[1,] 237455.4
```

```
[,1]
[1,] 205651.9
```

14. Gráfico Y real vs Y predicho

```
plot(modelo$fitted.values, datos$Costos_generales,
      main="Revisión Valor Real vs Valor Predicho")
lines(c(140000,200000), c(140000,200000))
```



15. Modelo sin constante

```
modelo2 <- lm(Costos_generales ~ Horas_maquina + Numero_preparaciones - 1, data=datos)
summary(modelo2)
```

```

Call:
lm(formula = Costos_generales ~ Horas_maquina + Numero_preparaciones -
    1, data = datos)

Residuals:
    Min      1Q  Median      3Q     Max 
-9042.2 -3486.9   739.7  3467.0  9300.3 

Coefficients:
            Estimate Std. Error t value Pr(>|t|)    
Horas_maquina       69.994     6.472 10.814 7.72e-07 ***
Numero_preparaciones 390.723    41.098  9.507 2.52e-06 ***
---
Signif. codes:  0 '***' 0.001 '**' 0.01 '*' 0.05 '.' 0.1 ' ' 1

Residual standard error: 5286 on 10 degrees of freedom
Multiple R-squared:  0.9992,    Adjusted R-squared:  0.999 
F-statistic: 6095 on 2 and 10 DF,  p-value: 3.699e-16

```

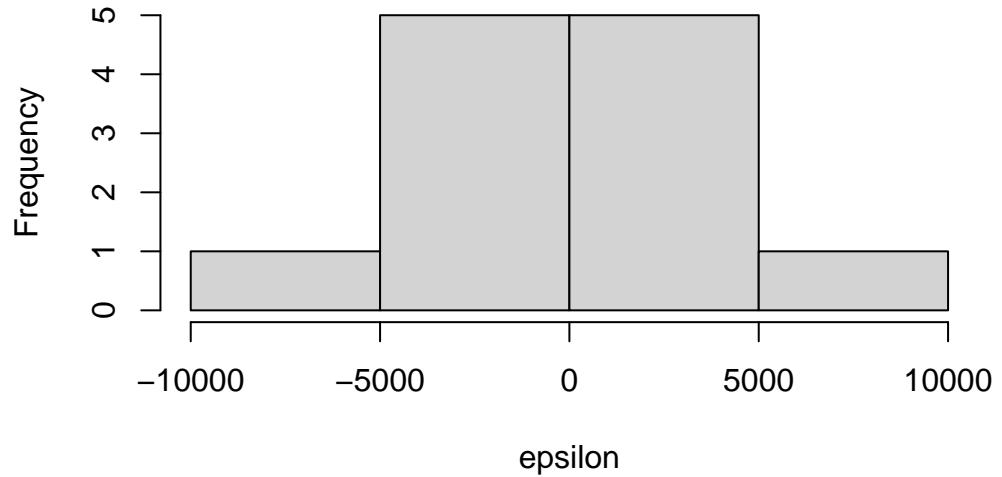
15.0.1. Análisis de residuos modelo sin constante

```

epsilon <- modelo2$residuals
hist(epsilon)

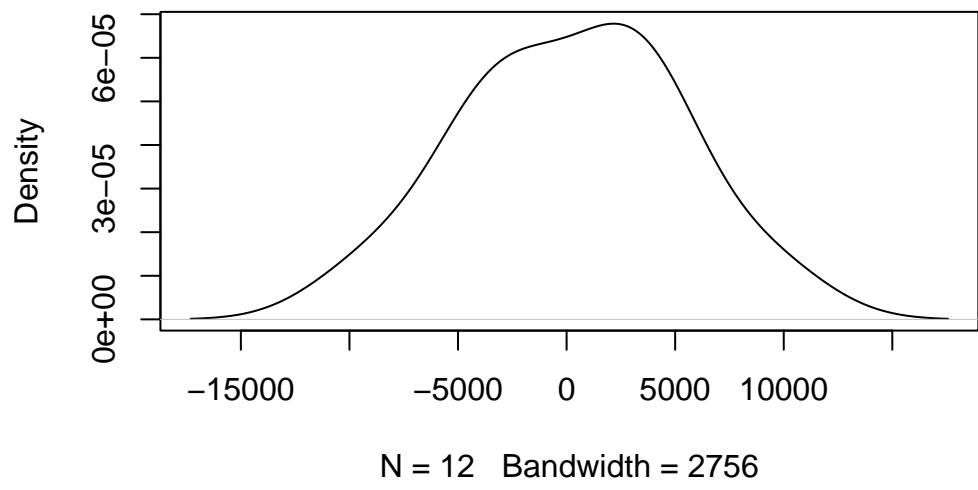
```

Histogram of epsilon



```
plot(density(epsilon))
```

density(x = epsilon)



```
shapiro.test(epsilon)
```

Shapiro-Wilk normality test

```
data: epsilon  
W = 0.97973, p-value = 0.9825
```

```
dwtest(modelo2,alternative="two.sided",iterations=1000)
```

Durbin-Watson test

```
data: modelo2  
DW = 2.1284, p-value = 0.9776  
alternative hypothesis: true autocorrelation is not 0
```

```
bptest(modelo2)
```

studentized Breusch-Pagan test

```
data: modelo2  
BP = 0.33027, df = 1, p-value = 0.5655
```