

Técnicas Avanzadas de Estadística

Javier Cara

curso 2023-24

Contenido

Regresión lineal

1. Modelo de regresión lineal
 - a. Modelo con un regresor (pdf)
 - b. Modelo con dos regresores (pdf)
 - c. Modelo con K regresores (pdf)
 - d. Estimación del modelo con la función lm (pdf)
 - e. Regresores cualitativos (pdf)
2. Inferencia en el modelo de regresión lineal
 - a. Estimadores y su distribución (pdf)
 - b. Intervalos de confianza (pdf)
 - c. Contraste de hipótesis (pdf)
 - d. Bootstrap (pdf)
3. Aplicaciones del modelo de regresión lineal
 - a. Cálculo de predicciones (pdf)
 - b. Análisis de las relaciones entre variables (pdf)
4. Diagnósis
 - a. Análisis de los residuos del modelo (pdf)
5. Ejemplo
 - a. Ejemplo completo de regresión lineal (pdf)
6. Extensiones del modelo lineal
 - a. Regresores polinómicos (pdf)
 - b. Splines (pdf)
 - c. Modelos Aditivos (pdf)
 - d. Regresión local (pdf)
7. Validación cruzada
 - a. Validación cruzada (pdf)
8. Comparación de modelos y selección de variables
 - a. Comparación de modelos y selección de variables (pdf)
9. Apéndices
 - a. Derivada de un escalar respecto de un vector (pdf)
 - b. Matriz de covarianzas (pdf)
 - c. Variable aleatoria normal (pdf)
 - d. Introducción a la simulación de variables aleatorias (pdf)

Modelos lineales generalizados

Regresión logística

1. Modelo de regresión logística
 - a. Modelo con un regresor (pdf)
 - b. Modelo con K regresores (pdf)
 - c. Regresores cualitativos (pdf)
2. Inferencia en el modelo de regresión logística
 - a. Estimadores y su distribución. Inferencia (pdf)
 - b. Bootstrap (pdf)
3. Aplicaciones del modelo de regresión lineal
 - a. Cálculo de predicciones (pdf)
 - b. Análisis de las relaciones entre variables (pdf)
4. Bondad de ajuste
 - a. Bondad del ajuste(pdf)
5. Residuos
 - a. Análisis de los residuos del modelo (pdf)
6. Apéndices
 - a. Regresión logística binomial (pdf)

Regresión de Poisson

1. Modelo de regresión logística
 - a. Modelo (pdf)
2. Inferencia en el modelo de regresión logística
 - a. Estimadores y su distribución. Inferencia (pdf)
3. Aplicaciones del modelo de regresión lineal
 - a. Cálculo de predicciones (pdf)
4. Bondad de ajuste
 - a. Bondad del ajuste (pdf)

Algoritmos

Árboles de clasificación y de regresión

1. Árboles de regresión
 - a. Arbol con un regresor (pdf)
 - b. Arbol con K regresores (pdf)
2. Random Forest
 - a. Random Forest (pdf)
3. Árboles de clasificación
 - a. Árboles de clasificación (pdf)

K - Nearest Neighbours

1. KNN para clasificación (pdf)
2. KNN para regresión (pdf)

Bibliografía

Los libros utilizados en la redacción de estos apuntes han sido, fundamentalmente:

- [Faraway2014] Linear models with R. Julian J. Faraway. Chapman and Hall/CRC. Edicion 2, 2014.
- [Gelman2007] Data Analysis Using Regression and Multilevel/Hierarchical Models. Andrew Gelman, Jennifer Hill. Cambridge University Press. 2007.

- **[James2017]** An Introduction to Statistical Learning: with Applications in R. Gareth James, Daniela Witten, Trevor Hastie and Rob Tibshirani. Springer, 2017.
- **[Montgomery2013]** Introduction to Linear Regression Analysis. Douglas Montgomery, Elisabeth Peck, Geoffrey Vining . Editorial Wiley-Blackwell, Edicion 5, 2013.
- **[Peña2010]** Regresión y diseño de experimentos. Daniel Peña. Alianza Editorial, 2010.
- **[Sheather2009]** A modern approach to regression with R. Simon J. Sheather. Springer tests in Statistics, 2009.

Archivos de datos

- Advertising.csv. Mas información en [James2017].
- cerezos.txt
- coches.txt
- kidiq.csv. Mas información en [Gelman2007].
- Hitters.csv. Mas información en [James2017].
- Wage.csv. Mas información en [James2017].

Funciones

- `cross_val_pos()`.
- `MSE()`
- `predict.regsbsets()`.