# Solución a la práctica 5.1 con Eviews

Usando la base de datos de la prueba PISA (Programme for International Student Assessment) 2012 para Murcia, se han obtenido datos para 1374 estudiantes (edad media 15 años) sobre las siguientes variables:

**NOTA DE LOS ALUMNOS** (Unidades de medida: puntos. La puntuación PISA es una puntuación normalizada tal que la media de los países de la OCDE en PISA se establece por definición en 500, y la desviación típica en 100):

```
notamat = nota en matemáticas
notalec = nota en lectura
notacien = nota en ciencias
```

## **NIVEL EDUCATIVO DE LOS PADRES** (variable ficticia):

```
educmadre = vale 1 si la madre tiene estudios superiores y 0 si no. educpadre = vale 1 si el padre tiene estudios superiores y 0 si no.
```

# VARIABLE DE GÉNERO (variable ficticia):

varon = vale 1 si el estudiante es varón y 0 si no.

### **VARIABLES DE ESTATUS:**

convivienda = es un índice que refleja el entorno favorable al estudio en la casa del estudiante (habitación propia, ordenador propio, etc.) así como las condiciones generales de la vivienda.

estatus = índice PISA de estatus económico, social y cultural de la familia. Mide la riqueza familiar, las posesiones culturales de la familia y los recursos educativos disponibles en el hogar, entre otros.

Responda a las siguientes cuestiones, utilizando los datos del fichero practica51.wf1:

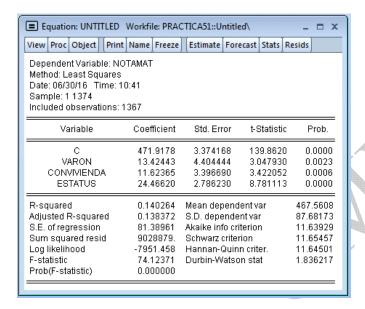
- 1) Para analizar el efecto del género sobre la nota en matemáticas, se proponen tres modelos alternativos diferentes:
  - a)  $notamat = \beta_0 + \beta_1 varon + \beta_2 convivienda + \beta_3 estatus + \varepsilon$
  - **b)** notamat =  $\beta_0 + \beta_1 mujer + \beta_2 convivienda + \beta_3 estatus + \varepsilon$
  - c)  $notamat = \beta_0 + \beta_1 varon + \beta_2 mujer + \beta_3 convivienda + \beta_4 estatus + \varepsilon$

Estima cada uno de estos modelos, comenta los resultados e interpreta los coeficientes de las variables ficticias.

Comenzamos estimando el modelo a). Para ello escribimos en el área de comandos:

#### ls notamat c varon convivienda estatus

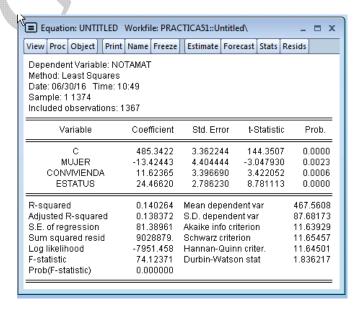
El resultado de la estimación es:



Como podemos observar, las variables de estatus (*convivienda y estatus*) son altamente significativas, lo cual indica la importancia del nivel económico, social y cultural de la familia sobre la nota de los estudiantes. Por otro lado, vemos como la variable de género (*varon*) también es significativa. Como en este modelo la categoría de referencia para el género es la mujer, el resultado de la estimación refleja que, para dos alumnos con el mismo nivel de estatus, en promedio el chico obtiene 13.42443 puntos más que la chica.

En el caso de haber incluido la variable *mujer* para representar el género en vez de la variable *hombre* (modelo b), la estimación es:

## ls notamat c mujer convivienda estatus



Observamos como, en esta estimación, el resultado es exactamente el mismo que en la anterior, salvo por el signo del coeficiente de la variable ficticia *mujer*. Ahora, la categoría de referencia son los varones, por lo tanto el coeficiente de la ficticia refleja la diferencia ceteris paribus de las chicas respecto de los chicos. Como el signo es negativo, esto implica que en promedio las chicas obtienen 13.42443 puntos menos que los chicos en el examen de matemáticas.

Vamos a estimar ahora el modelo c). Para ello escribimos:

### ls notamat c varon mujer convivienda estatus

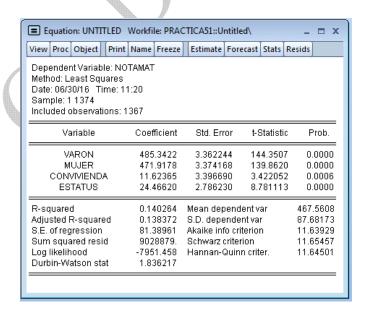
Y cuando tratamos de estimar este modelo con Eviews obtenemos el siguiente mensaje:



Es decir, hay un problema de multicolinealidad exacta entre las variables del modelo. Este modelo representa un ejemplo claro de trampa de ficticias: al incluir todas las ficticias (aditivas) para el género y dejar la constante en el modelo se produce multicolinealidad exacta ya que varon + mujer = 1 para todos los agentes de la muestra.

Si se quieren introducir las dos ficticias a la vez, la solución pasaría por eliminar la constante del modelo. La estimación, entonces, sería:

## ls notamat varon mujer convivienda estatus



Ahora, como no hemos dejado ninguna categoría de referencia, los coeficientes de las ficticias reflejan directamente el valor del término constante del modelo para cada una de las categorías. Así, el término constante para el modelo de los varones es 485.3422 mientras que el del modelo de las mujeres es de 471.9178. La diferencia de los varones

respecto de las mujeres es (485.3422 - 471.9178) = 13.4244 que es exactamente el valor que hemos obtenido con la estimación de los modelos a) y b).

Una vez analizado este sencillo ejemplo, vamos a completar el análisis de la nota en los distintos exámenes con todas las variables de que disponemos, siguiendo un proceso ordenado para seleccionar el modelo que mejor se ajusta a los datos. Comenzaremos por la nota en ciencias, después analizaremos la nota en matemáticas y terminaremos con el análisis de la nota en lectura.

# 2) Para examinar los determinantes de la nota en ciencias, se propone el siguiente modelo de regresión:

```
notacien = \beta_0 + \beta_1 varon + \beta_2 convivienda + \beta_3 estatus + \beta_4 educmadre + \beta_5 educpadre + \\ + \beta_6 educmadre * estatus + \beta_7 educpadre * estatus + \epsilon
```

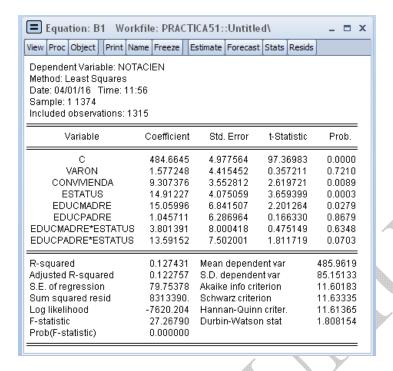
# a) Interprete los coeficientes de las variables ficticias.

- $\beta_0$ = término constante del modelo para la categoría de referencia (chicas con padres sin estudios superiores).
- $\beta_1$ = diferencia de la nota en ciencias de los chicos respecto de las chicas, independiente de las variables explicativas del modelo.
- $\beta_4$ = diferencia de la nota en ciencias de los chicos/as cuya madre tiene estudios superiores respecto de aquellos cuya madre no tiene estudios superiores, independiente de las variables explicativas del modelo.
- $\beta_5$ = diferencia de la nota en ciencias de los chicos/as cuyo padre tiene estudios superiores respecto de aquellos cuyo padre no tiene estudios superiores, independiente de las variables explicativas del modelo.
- $\beta_6$ = diferencia de la nota en ciencias de los chicos/as cuya madre tiene estudios superiores respecto de aquellos cuya madre no tiene estudios superiores, que depende del estatus familiar.
- $\beta_7$ = diferencia de la nota en ciencias de los chicos/as cuyo padre tiene estudios superiores respecto de aquellos cuyo padre no tiene estudios superiores, que depende del estatus familiar.

# b) Estime el modelo por MCO.

Escribimos en la ventana de comandos:

ls notacien c varon convivienda estatus educmadre educpadre educmadre\*estatus educpadre\*estatus



b.1) Contraste la relevancia de la variable de género sobre la nota en ciencias. ¿Qué conclusiones obtiene? ¿Cómo se interpreta el resultado? Modifique el modelo de acuerdo con los resultados de su contraste.

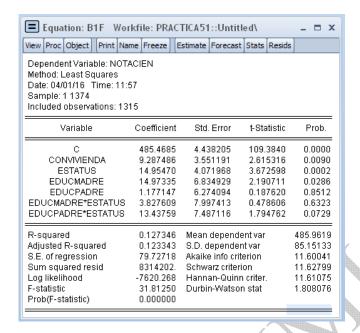
Para contrastar la relevancia de la variable *varon* sobre la nota en ciencias miramos directamente el p-valor de su coeficiente en el output de estimación anterior; su valor es 0.7210, por lo que concluimos que la variable *varon* no es relevante incluso a niveles altos de significación. Como consecuencia, podemos decir que el género no influye en la nota en ciencias, es decir, que no hay una diferencia significativa entre la nota de los chicos y la nota de las chicas.

Dado que la variable *varon* no es relevante debemos eliminarla del modelo. El modelo resultante es:

$$notacien = \beta_0 + \beta_1 convivienda + \beta_2 estatus + \beta_3 educmadre + \beta_4 educpadre + \\ + \beta_5 educmadre * estatus + \beta_6 educpadre * estatus + \epsilon$$

La estimación de este modelo se presenta a continuación:

ls notacien c convivienda estatus educmadre educpadre educmadre\*estatus educpadre\*estatus

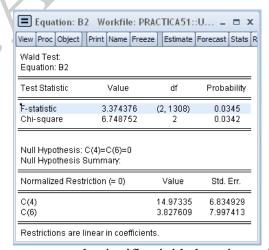


# b.2) Contraste la significatividad del nivel educativo de la madre sobre la nota en ciencias en el modelo propuesto en el apartado anterior. Comente sus conclusiones y modifique el modelo si es necesario.

En este caso, para contrastar la significatividad del nivel educativo de la madre sobre la nota en ciencias hay que contrastar la significatividad estadística de los parámetros  $\beta_3$  y  $\beta_5$  de forma conjunta. Para hacer esto, en el output de estimación del modelo haremos:

## View/Coefficient Diagnostics/Wald Test-Coefficient Restrictions...

En el cuadro que se abre escribimos: C(4)=C(6)=0. El resultado se presenta en la siguiente tabla:



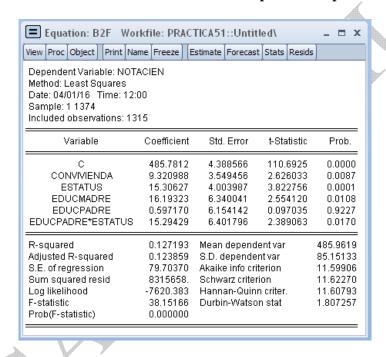
El estadístico F para contrastar la significatividad conjunta de los parámetros  $\beta_3$  y  $\beta_5$  tiene un valor de 3.37 con un p-valor asociado de 0.0345, por lo que al 5% rechazamos la hipótesis nula de no significación conjunta de los parámetros. Es decir, el nivel educativo de la madre es relevante para explicar la nota en ciencias.

Sin embargo, si nos fijamos en los niveles de significación individuales de los coeficientes  $\beta_3$  y  $\beta_5$  vemos que son, respectivamente, 0.0286 y 0.6323, por lo que podemos concluir que, si bien la variable *educmadre* es relevante la variable *educmadre\*estatus* no lo es. Procedemos, entonces, a eliminar esta última del modelo. El modelo resultante es:

$$\begin{aligned} notacien &= \beta_0 + \beta_1 convivienda + \beta_2 estatus + \beta_3 educmadre + \\ &+ \beta_4 educpadre + \beta_5 educpadre * estatus + \epsilon \end{aligned}$$

La estimación de este modelo es:

### ls notacien c convivienda estatus educmadre educpadre educpadre\*estatus



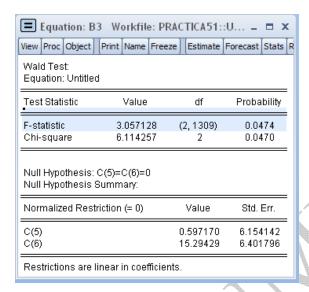
Concluimos por tanto que el hecho de que la madre tenga educación superior influye positivamente en la nota de los alumnos con un impacto constante sea cual sea el valor de las explicativas. En concreto, la diferencia entre los alumnos cuya madre tiene educación superior respecto a aquellos cuya madre no la tiene es de 16.19323 puntos, ceteris paribus.

# b.3) Haga lo mismo que en el apartado anterior para el nivel educativo del padre. ¿Influye la educación del padre en el efecto que tiene la variable estatus en la nota en ciencias?

En este caso, para contrastar la significatividad del nivel educativo del padre sobre la nota en ciencias hay que contrastar la significatividad estadística de los parámetros β4 y β5 de forma conjunta. Para hacer esto, en el output de estimación del modelo haremos:

View/Coefficient Diagnostics/Wald Test-Coefficient Restrictions...

En el cuadro que se abre escribimos: C(5)=C(6)=0. El resultado se presenta en la siguiente tabla:



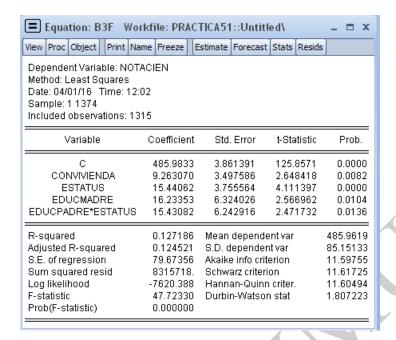
El estadístico F para contrastar la significatividad conjunta de los parámetros  $\beta_4$  y  $\beta_5$  tiene un valor de 3.05 con un p-valor asociado de 0.0474, por lo que al 5% rechazamos la hipótesis nula de no significación conjunta de los parámetros. Es decir, el nivel educativo del padre es relevante para explicar la nota en ciencias.

Sin embargo, si nos fijamos en los niveles de significación individuales de los coeficientes  $\beta_4$  y  $\beta_5$  vemos que son, respectivamente, 0.9227 y 0.0170, por lo que podemos concluir que, si bien la variable *educpadre* no es relevante la variable *educpadre\*estatus* si lo es. Procedemos, entonces, a eliminar la primera del modelo. El modelo resultante es:

notacien = 
$$\beta_0 + \beta_1 convivienda + \beta_2 estatus + \beta_3 educmadre + \beta_4 educpadre * estatus + \varepsilon$$

La estimación de este modelo es:

ls notacien c convivienda estatus educmadre educpadre\*estatus



Concluimos por tanto que el hecho de que el padre tenga estudios superiores influye en la nota de los alumnos, alterando la manera en que el estatus familiar influye sobre esta nota. En concreto, el efecto que la variable estatus tiene en la nota se ve incrementado en 15.43082 puntos por cada incremento unitario de la variable estatus respecto a los alumnos cuyo padre no tiene estudios superiores.

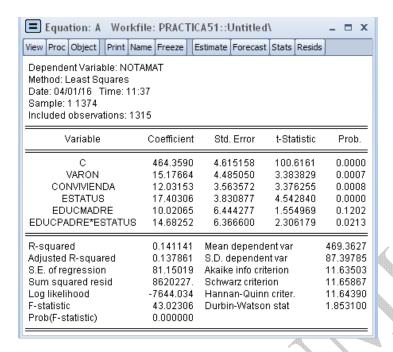
3) Considere ahora el siguiente modelo para la nota en matemáticas:

$$notamat = \beta_0 + \beta_1 varon + \beta_2 convivienda + \beta_3 estatus + \beta_4 educmadre + \beta_5 educpadre * estatus + \varepsilon$$

a) Estime el modelo, comente los resultados y mejore la especificación en caso de que sea necesario.

Para estimar el modelo haremos:

ls notamat c varon convivienda estatus educmadre educpadre\*estatus

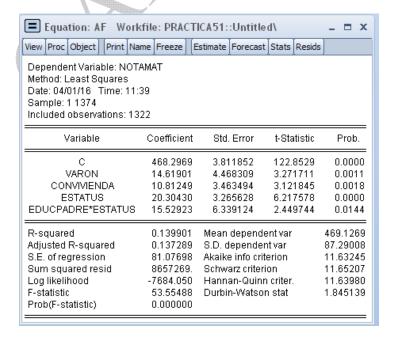


Como podemos observar en el output de estimación, todos los parámetros del modelo son significativos al 5% excepto el parámetro de la variable educmadre, por lo que la eliminamos del modelo. El modelo resultante es:

$$notamat = \beta_0 + \beta_1 varon + \beta_2 convivienda + \beta_3 estatus +$$
$$+ \beta_4 educpadre * estatus + \varepsilon$$

La estimación de este modelo es:

ls notamat c varon convivienda estatus educpadre\*estatus



En este modelo todos los parámetros son altamente significativos.

b) ¿Es  $\hat{\beta}_1$  significativo? Interprete lo que este contraste indica sobre la influencia del género en la nota de matemáticas. ¿Podemos decir que los chicos sacan en promedio mejor nota en matemáticas que las chicas?

El parámetro  $\beta_1$  estimado es significativo dado su bajo p-valor (0.0011), lo que implica que el sexo es una variable relevante en este modelo. Más concretamente, según la estimación, en promedio los chicos obtienen una nota en matemáticas superior en 14.61 puntos a la de las chicas, ceteris paribus.

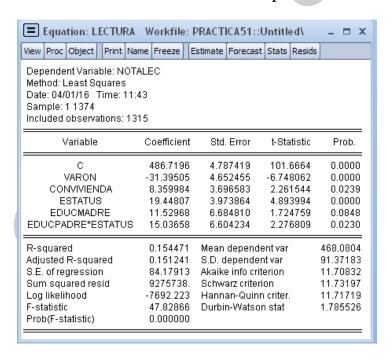
4) Lleve a cabo el mismo análisis que en el apartado 3, utilizando esta vez la nota en lectura. ¿Qué conclusiones obtiene ahora?

En este caso, el modelo de partida es:

$$notalec = \beta_0 + \beta_1 varon + \beta_2 convivienda + \beta_3 estatus + \\ + \beta_4 educmadre + \beta_5 educpadre * estatus + \epsilon$$

La estimación del modelo por MCO arroja el siguiente resultado:

ls notalec c varon convivienda estatus educmadre educpadre\*estatus



Ahora todos los parámetros del modelo son significativos por lo menos al 10%. En concreto, si nos fijamos en la variable de género, vemos como esta vez los chicos obtienen en promedio una nota en lectura inferior en 31.39 puntos a la de las chicas, ceteris paribus, es decir ese valor promedio es el mismo sea cual sea el valor de las demás variables explicativas.