

# LAS DIEZ REGLAS DE LA ECONOMETRÍA APLICADA

Peter E. Kennedy

Versión libre: Manuel Sauceverde

sauceverde@hotmail.com

## **Regla # 1: Use el sentido común y la teoría económica**

*Los procedimientos de una buena práctica estadística están cimentados en la experiencia y el sentido común; es un buen hábito detenerse y pensar antes de correr una regresión.*  
Preece (1987)

## **Regla # 2. Evite los errores Tipo III**

*Es mejor una respuesta aproximada a la pregunta "correcta", la cual es a menudo imprecisa, que una respuesta "exacta" a la pregunta incorrecta, la cual siempre puede formularse con exactitud.*

Tukey (1962)

## **Regla # 3. Conozca el contexto**

*No se intente modelar sin comprender los aspectos no estadísticos del fenómeno que se busca analizar estadísticamente. El análisis estadístico realizado cuando se ignoran las particularidades del fenómeno es sólo un análisis estadístico ignorante.*

Belseley & Welch (1988)

## **Regla # 4. Analice los datos**

*Es una queja recurrente en las ciencias sociales que los investigadores, desde los estudiantes en formación hasta los alumnos avanzados, no conozcan lo suficiente de los datos que usan.*

Maier (1999)

## **Regla # 5. Que sea sensatamente sencillo<sup>1</sup>**

*No se escoja un método analítico para impresionar a los lectores o para desviar la crítica. Si los supuestos y la fuerza de un método más simple son acertados para los datos y el problema de investigación, úselo.*

Wilkinson et al. (1999)

## **Regla#6. Utilice la prueba En medio de los ojos.<sup>2</sup>**

*¿Los signos de los coeficientes son los esperados? ¿Las variables relevantes son estadísticamente significativas? ¿Las magnitudes de los coeficientes son razonables? ¿Las implicaciones de los resultados son consistentes con la teoría? ...*

Kennedy (2002)

---

<sup>1</sup> Basada en la regla de Zellner (2001): *Keep it sophisticatedly simple*. No confundirse con la regla comercial: *Keep it simple, stupid*.

<sup>2</sup> Esta prueba (Interocular Trauma Test) consiste en examinar los resultados hasta que la respuesta nos golpee en medio de los ojos. Kennedy (2002).

**Regla#7. Entienda los costos y beneficios del *data mining***

*Algunas variantes del “minado de datos” pueden ser clasificadas como los más graves pecados, pero otras variantes pueden ser vistas como importantes ingredientes en el análisis de los datos.*

Kennedy (2002)

**Regla#8. Prepárese para comprometerse**

*Las brechas entre la aplicación y la teoría requieren que se realice un compromiso.*

Trosset (1998)

**Regla#9. No confundir la significancia estadística con magnitud significativa**

*Ningún economista ha conseguido éxito científico como resultado de un coeficiente estadísticamente significativo. Observación desde lo general, agudo sentido común, elegantes teoremas, políticas novedosas, sagaz razonamiento económico, perspectiva histórica, un informe notable: todo ello permite el éxito científico. La significancia estadística no.*

McCloskey & Ziliak (1996)

**Regla#10. Reporte un análisis de sensibilidad**

*No se exige que los pecadores eviten los pecados, sólo necesitan confesar sus errores abiertamente.*

Leamer (1978)

# LOS DIEZ MANDAMIENTOS DE LA ECONOMETRÍA APLICADA

Peter E. Kennedy

Versión libre: Manuel Sauceverde

- I. Usarás el sentido común y la teoría económica.
  - Corolario: No harás econometría como se dijeras tus oraciones.
- II. Plantearás las preguntas correctas.
  - Corolario: Antepondrás lo relevante a la elegancia matemática.
- III. Conocerás el contexto.
  - Corolario: No llevarás a cabo análisis estadístico ignorante.
- IV. Examinarás los datos.
  - Corolario: Antepondrás la nitidez de los datos a la divinidad econométrica.
- V. No adorarás la complejidad.
  - Corolario: No impondrás las aproximaciones asintóticas en vano.
  - Corolario: No utilizarás *latinajos* sin conocer su significado en español.
- VI. Observarás atenta y rigurosamente tus resultados.
  - Corolario: Aplicarás la prueba de la risa: *Pregúntate si una persona comedida podría evitar reírse después de explicarle cuidadosamente los resultados.* Hamermesh (2000)
- VII. Tendrás presentes los costos del *data mining*.
  - Corolario: No adorarás la  $R^2$ .
  - Corolario: No cazarás significancia estadística con escopeta.
  - Corolario: No adorarás el nivel de significancia del 5%.
- VIII. Estarás dispuesto a comprometerte.
  - Corolario: No adorarás las recetas de los libros de texto.
- IX. No confundirás significancia con fundamento.
  - Corolario: No ignorarás la potencia.
  - Corolario: No contrastarás hipótesis segadas.
  - Corolario: Buscarás evidencia adicional.
- X. Te confesarás en presencia de la sensibilidad.
  - Corolario: Anticiparás las críticas.

## BIBLIOGRAFÍA

Balsey, D. A. & R. E. Welch (1980). "Modelling energy consumption using and abusing regression diagnostics", *Journal of Business and Economic Statistics*. 6, 442-7.

Hamermesh, D. S. (2000). "The craft of laborometrics", *Industrial and Labor Relations Review*. 53, 363-80.

Kennedy, P. E. (2002). "Sinning in the Basement: What Are the Rules? The Ten Commandments of Applied Econometrics", *Journal of Economic Surveys*. Vol. 16, No. 4.

Leamer, E. E. (1978). *Specification Searches: Ad Hoc Inference with Nonexperimental Data*. New York: John Wiley.

Maier, M. (1999). *The Data Game*. Aramont, NY: M. E. Sharpe.

McCloskey, D. N. & S. T. Ziliak (1996). "The standard error of regression", *Journal of Economic Literature*. 34, 97-114.

Preece, D. A. (1987). "Good statistical practice", *The Statistician*. 36, 397-408.

Trosset, M. W. (1998). "Comment", *Statistical Scienc*. 13, 23-4.e

Tukey, J. W. (1962). "The future of data analysis", *Annals of Mathematical Statistics*. 33, 1-67.

Wilkinson, L. (1999). "Statistical methods in psychology journals", *American Psychologis*. 54, 594-604.

Zellner, A. (2001). "Keep it sophisticatedly simple". In H. Keuzenkamp, M. McAleer, and A. Zellner (eds), *Occam's Razor, Simplicity and Scientific Inference*. Cambridge, UK: Cambridge University Press.