

Taller 1. Econometría Avanzada

Daniel Ricardo Amaya Alba

Table of contents

1 Primer Ejercicio

Desde la perspectiva del capital humano, estudios como el de Cunha & Heckma (2007) encuentran que las intervenciones durante los primeros años de escolaridad son fundamentales para el desarrollo temprano de habilidades y, con ello, para la trayectoria de aprendizaje posterior de los individuos. Una forma de evaluar el éxito de estas intervenciones es mediante el nivel de habilidades cognitivas que desarrollan los estudiantes, dado que estas capacidades constituyen la base de cualquier aprendizaje futuro.

En este contexto, los gobiernos suelen mostrar interés por los programas de digitalización, ya que prometen acelerar el desarrollo del razonamiento y facilitar la adaptación al mundo moderno. Con base en lo anterior, la pregunta de investigación que guiará este ejercicio, inspirada en Cristia et al. (2012), es: ¿cuál es el efecto de participar en un programa de tecnología educativa sobre el desarrollo de habilidades cognitivas de razonamiento abstracto?

Para responder esta pregunta, usted analizará una política implementada por la Secretaría de Educación de Macondo en conjunto con el colegio Sonrisas, ubicado en una zona rural del país. La iniciativa buscaba transformar el modelo educativo tradicional mediante la entrega de laptops diseñadas específicamente para el aprendizaje autodidacta en entornos con limitaciones severas de infraestructura. El programa se enfocó exclusivamente en estudiantes de tercer grado de primaria, nivel que en este colegio cuenta con dos salones. El programa seleccionaba un salón para convertirlo en Aula Tecnológica.

Los estudiantes asignados al Aula Tecnológica realizaban actividades guiadas tres veces por semana utilizando las laptops. Estas actividades se desarrollaban únicamente durante el horario de clases, las cuales fueron adaptadas para incluir ejercicios lógicos y juegos de asociación visual orientados a fortalecer el razonamiento abstracto. Cada actividad estaba vinculada con el tema correspondiente a la clase del día. Adicionalmente, los estudiantes no podían llevar las laptops a sus hogares. Los estudiantes del otro salón, por su parte, continuaron con sus clases de manera habitual.

Considere una muestra de N estudiantes observados en un diseño de corte transversal. Defina Y_i como el puntaje del estudiante i en un test de habilidades cognitivas de razonamiento abstracto. Este test se aplica anualmente a nivel nacional a estudiantes de tercer grado, está definido por el Ministerio de Educación y sus puntajes oscilan entre 0 y 100. Por otro lado, D_i es una variable dicotómica que toma el valor de 1 si el estudiante i fue asignado al Aula Tecnológica y 0 en caso contrario.

Para comenzar, suponga que el mecanismo de asignación al tratamiento es desconocido; es decir, no se conocen los criterios que determinaron la elección de un salón sobre el otro ni la forma en que los estudiantes son asignados a cada salón.

1.1 Punto1

Describa el problema de estimación utilizando el lenguaje de resultados potenciales

a) **Teniendo en cuenta el contexto presentado, defina formalmente los resultados potenciales $Y_i(1)$ y $Y_i(0)$. Luego, describa el problema de inferencia causal en este contexto.****

R/: En este caso el resultado potencial $Y_i(1)$ se define como el puntaje que obtendría el estudiante i dado que fue asignado al aula tecnologica. Por su parte el resultado potencial $Y_i(0)$ es el resultado que obtendría el estudiante i dado que no fue asignado al aula tecnologica.

Para recuperar el efecto causal de la participación en las aulas tecnologicas en el puntaje obtenido por el estudiante i , nos gustaria ver la diferencia en sus resultados potenciales, es decir de sus puntajes dado que participo en el aula y que no participo en el aula:

$$\tau_i = Y_i(1) - Y_i(0)$$

Sin embargo, acá nos encontramos con el problema de la inferencia causal. En nuestra muestra N para el estudiante i solo se puede observar uno de los dos caminos, o el estudiante fue asignado ($D_i = 1$) o no fue asignado ($D_i = 0$). Es decir, lo que realmente tenemos en nuestra base de datos es:

$$Y_i = Y_i(1)D_i + (1 - D_i)Y_i(0)$$

De tal manera que el resultado observado Y_i para el estudiante con $D_i = 1$ sera su resultado potencial dado que participó $Y_i(1)$ y para el estudiante con $D_i = 0$ observaremos su resultado potencial dado que no participó $Y_i(0)$. Pero nunca seremos capaces de ver para el mismo estudiante i su resultado dado que participo $D_i = 1$ y su contrafactual $D_i = 0$.

Es por lo anterior que para trabajar con nuestra muestra utilizaremos no el resultado del individuo i sino que trabajaremos con el promedio de los resultados potenciales, es decir

buscaremos estimar los efectos promedio, bien sea el efecto promedio del tratamiento *ATE*, el efecto promedio del tratamiento en los tratados *ATT* y el efecto promedio del tratamiento en los no tratados *ATU*.

b) Define en lenguaje matemático el *ATE*, el *ATT* y el *ATU*. Interprete cada uno de estos conceptos de acuerdo al contexto del caso

R/:

El *ATE* se define como el efecto promedio del tratamiento:

$$\begin{aligned}\tau_{ATE} &= E[Y_i(1) - Y_i(0)] \\ \tau_{ATE} &= E[Y_i(1)] - E[Y_i(0)]\end{aligned}$$

Que para el caso de nuestra investigación representa la diferencia entre el puntaje promedio en el test de habilidad cognitivas si toda la población de estudiantes de tercer grado hubieran asistido a las aulas tecnológicas, frente al promedio si ninguno hubiera asistido a dichas aulas.

El *ATT* se define como el efecto promedio del tratamiento en los tratados:

$$\begin{aligned}\tau_{ATT} &= E[Y_i(1) - Y_i(0)|D_i = 1] \\ \tau_{ATT} &= E[Y_i(1)|D_i = 1] - E[Y_i(0)|D_i = 1]\end{aligned}$$

En este caso representa la diferencia en el puntaje promedio del test de habilidades cognitivas del salón que fue asignado a las aulas tecnológicas y el resultado que esos mismos estudiantes hubieran obtenido si no hubieran sido asignados. Es decir, en este caso estamos restringiendo el efecto promedio al grupo que fue tratado.

El *ATU* se define como el efecto promedio del tratamiento en los no tratados:

$$\begin{aligned}\tau_{ATU} &= E[Y_i(1) - Y_i(0)|D_i = 0] \\ \tau_{ATU} &= E[Y_i(1)|D_i = 0] - E[Y_i(0)|D_i = 0]\end{aligned}$$

En este caso representa la diferencia en el puntaje promedio del test de habilidades cognitivas del salón que no fue asignado a las aulas tecnológicas y el resultado que esos mismos estudiantes hubieran obtenido si hubieran sido asignados. Es decir, en este caso estamos restringiendo el efecto promedio al grupo que no fue tratado.

1.2 Punto2

Usted se encuentra interesada en estimar el siguiente efecto causal:

$$\tau = E[Y_i(1)] - E[Y_i(0)]$$

Para esto plantea una diferencia de medias ingenua

$$\tau_{naive} = E[Y_i|D_i = 1] - E[Y_i|D_i = 0]$$

a). Muestre formalmente que:

$$\tau_{naive} = ATT + E[Y_i(0)|D_i = 1] - E[Y_i(0)|D_i = 0]$$

R/:

$$\begin{aligned}\tau_{naive} &= E[Y_i|D_i = 1] - E[Y_i|D_i = 0] \\ \tau_{naive} &= E[Y_i(1)|D_i = 1] - E[Y_i(0)|D_i = 0] + \cancel{E[Y_i(0)|D_i = 1]} - \cancel{E[Y_i(0)|D_i = 1]} \\ \tau_{naive} &= \underbrace{E[Y_i(1)|D_i = 1] - \cancel{E[Y_i(0)|D_i = 1]}}_{ATT} + \cancel{E[Y_i(0)|D_i = 1]} - E[Y_i(0)|D_i = 0] \\ \tau_{naive} &= ATT + \cancel{E[Y_i(0)|D_i = 1]} - E[Y_i(0)|D_i = 0]\end{aligned}$$

b). Muestre formalmente que:

$$\tau_{naive} = ATU + E[Y_i(1)|D_i = 1] - E[Y_i(1)|D_i = 0]$$

R/:

$$\begin{aligned}\tau_{naive} &= E[Y_i|D_i = 1] - E[Y_i|D_i = 0] \\ \tau_{naive} &= E[Y_i(1)|D_i = 1] - E[Y_i(0)|D_i = 0] + \cancel{E[Y_i(1)|D_i = 0]} - \\ &\quad \cancel{E[Y_i(1)|D_i = 0]} \\ \tau_{naive} &= \underbrace{E[Y_i(1)|D_i = 0] - E[Y_i(0)|D_i = 0]}_{ATU} + \\ &\quad E[Y_i(1)|D_i = 1] - \cancel{E[Y_i(1)|D_i = 0]} \\ \tau_{naive} &= ATU + E[Y_i(1)|D_i = 1] - \cancel{E[Y_i(1)|D_i = 0]}\end{aligned}$$

c). Muestre formalmente que:

$$ATE = \pi ATT + (1 - \pi) ATU$$

R/: Esta demostración es diferente a las anteriores, es menos intuitiva. Sin embargo, podemos aplicar la ley de esperanzas iteradas a la definición de *ATE*:

$$\begin{aligned}\tau_{ATE} &= E[Y_i(1)] - E[Y_i(0)] \\ \tau_{ATE} &= E[E[Y_i(1) - Y_i(0)|D_i]] \\ \tau_{ATE} &= E[Y_i(1) - Y_i(0)|D_i = 1]P(D_i = 1) + E[Y_i(1) - Y_i(0)|D_i = 0]P(D_i = 0)\end{aligned}$$

Donde:

$$\tau_{ATE} = \underbrace{E[Y_i(1) - Y_i(0)|D_i = 1]}_{ATT} \cdot \underbrace{P(D_i = 1)}_{\pi} + \underbrace{E[Y_i(1) - Y_i(0)|D_i = 0]}_{ATU} \cdot \underbrace{P(D_i = 0)}_{(1-\pi)}$$

Interpretando cada expresión:

a).

$$\tau_{naive} = ATT + \underbrace{E[Y_i(0)|D_i = 1] - E[Y_i(0)|D_i = 0]}_{\text{Selection Bias}}$$

Esta expresión indica que el τ_{naive} recupera el efecto causal sobre los tratados (*ATT*) si y solo si el sesgo de selección es igual a cero. Esto ocurre cuando el resultado promedio contrafactual del grupo tratado $E[Y_i(0)|D_i = 1]$ es idéntico al resultado promedio observado del grupo de control $E[Y_i(0)|D_i = 0]$. Para que esto se cumpla la composición de los salones debería ser homogénea o el proceso de asignación debería haber sido aleatorio, garantizando que no existan diferencias pre-existentes entre ambos grupos.

b).

$$\tau_{naive} = ATU + \underbrace{E[Y_i(1)|D_i = 1] - E[Y_i(1)|D_i = 0]}_{\text{Heterogeneity Bias}}$$

Por otro lado esta expresión nos indica que el τ_{naive} recupera el efecto promedio causal sobre los no tratados (*ATU*) si y solo si el sesgo de heterogeneidad en resultados del tratamiento es igual a cero. Esto ocurre cuando el resultado promedio de los estudiantes tratados $E[Y_i(1)|D_i = 1]$ es igual al resultado promedio que hubieran obtenido los estudiantes del grupo de control si se les hubiera asignado el tratamiento $E[Y_i(1)|D_i = 0]$. Esto quiere decir que el efecto de las computadoras sería el mismo, independientemente del salón que hubiera sido seleccionado.

c).

$$ATE = \pi \cdot ATT + (1 - \pi) \cdot ATU$$

Por último esta expresión nos dice que el efecto promedio del tratamiento es un promedio ponderado del efecto promedio en los tratados ATT y en los no tratados ATU .

¿Es cierto que si $\tau_{naive} = ATT$, entonces $\tau_{naive} = ATU$?

Esta afirmación no es cierta. Como vimos, el $\tau_{naive} = ATT$ sí y solo sí el resultado promedio contrafactual del grupo tratado $E[Y_i(0)|D_i = 1]$ es idéntico al resultado promedio observado del grupo de control $E[Y_i(0)|D_i = 0]$, lo cual no nos está brindando ninguna información al respecto de algún posible sesgo de heterogeneidad del tratamiento, es decir no nos garantiza que el efecto del tratamiento sea el mismo para ambos grupos. Por su parte, si el $\tau_{naive} = ATU$ solo sabemos que hay ausencia de sesgo de heterogeneidad, pero no tenemos certeza al respecto de la comparabilidad de los grupos (sesgo de selección).

Teniendo como base la descomposición que se hace en libro Causal Inference: The Mixtape de Scott Cunningham podemos demostrar la relación entre estos parámetros:

$$\begin{aligned}\tau_{ATE} &= \pi \cdot ATT + (1 - \pi) \cdot ATU \\ \tau_{ATE} &= \pi \cdot ATT + (1 - \pi) \cdot ATU + (1 - \pi) \cdot ATT - (1 - \pi) \cdot ATT \\ \tau_{ATE} &= \cancel{ATT} \cdot \underbrace{(\pi + 1 - \pi)}_1 - (1 - \pi) \cdot ATT + (1 - \pi) \cdot ATU \\ \tau_{ATE} &= ATT - (1 - \pi) \cdot ATT + (1 - \pi) \cdot ATU\end{aligned}$$

Despejando ATT :

$$\tau_{ATT} = ATE + (1 - \pi) \cdot (ATT - ATU)$$

Remplazando la expresión que acabamos obtener de τ_{ATT} en nuestro estimador τ_{naive} , obtenemos la descomposición completa del sesgo:

$$\begin{aligned}\tau_{naive} &= ATT + \underbrace{E[Y_i(0)|D_i = 1] - E[Y_i(0)|D_i = 0]}_{\text{Selection Bias}} \\ \tau_{naive} &= ATE + \underbrace{(1 - \pi) \cdot (ATT - ATU)}_{\text{Heterogeneity Bias}} + \underbrace{E[Y_i(0)|D_i = 1] - E[Y_i(0)|D_i = 0]}_{\text{Selection Bias}}\end{aligned}$$

Por lo tanto en nuestro caso, es posible que el salón elegido fuera comparable inicialmente al de control (sin sesgo de selección), pero que las laptops tengan un retorno mayor en el salón tratado debido a factores específicos del grupo o del profesor. Por lo tanto para que $ATE = ATT = ATU$ necesitamos tener ausencia de heterogeneidad y de selección.

1.3 Punto3

Para encontrar el efecto causal promedio de participar en el programa de tecnología educativa sobre el resultado en el test, considere el siguiente modelo lineal:

$$Y_i = \beta_0 + \tau D_i + U_i$$

Demuestre que el estimador $\hat{\tau}_{MCO}$ coincide con la diferencia de medias entre el grupo de tratados y el grupo de no tratados. Es decir, pruebe que $\hat{\tau}_{MCO} = \hat{\tau}_{DM}$, donde:

$$\hat{\tau}_{DM} := \frac{1}{N_1} \sum_{\{i:D_i=1\}} Y_i - \frac{1}{N_0} \sum_{\{i:D_i=0\}} Y_i,$$

y donde $N_1 = \sum_i D_i$; $N_0 = \sum_i (1 - D_i)$.

R/:

Para demostrar que $\hat{\tau}_{MCO} = \hat{\tau}_{DM}$, podemos estimar $\hat{\tau}_{MCO}$ haciendo la minimización de cuadrados a los residuos de nuestro modelo de regresión:

$$\min_{\hat{\beta}_0, \hat{\tau}} \sum_{i=1}^N (Y_i - \hat{\beta}_0 - \hat{\tau} D_i)^2$$

FOC respecto de $\hat{\beta}_0$:

$$-2 \sum_{i=1}^N (Y_i - \hat{\beta}_0 - \hat{\tau} D_i) = 0$$

$$\sum_{i=1}^N Y_i - N \hat{\beta}_0 - \hat{\tau} \sum_{i=1}^N D_i = 0$$

$$N \bar{Y} - N \hat{\beta}_0 - \hat{\tau} N_1 = 0$$

Despejando β_0 :

$$\hat{\beta}_0 = \bar{Y} - \hat{\tau} \frac{N_1}{N}$$

FOC respecto de $\hat{\tau}$:

$$-2 \sum_{i=1}^N (Y_i - \hat{\beta}_0 - \hat{\tau} D_i) D_i = 0$$

Para que la sumatoria exista $D_i = 1$:

$$\sum_{i:D_i=1} (Y_i - \hat{\beta}_0 - \hat{\tau}) = 0$$

$$\sum_{i:D_i=1} Y_i - N_1 \hat{\beta}_0 - N_1 \hat{\tau} = 0$$

Despejando $\hat{\tau}$:

$$\hat{\tau} = \frac{1}{N_1} \sum_{i:D_i=1} Y_i - \hat{\beta}_0$$

$$\hat{\tau} = \bar{Y}_1 - \hat{\beta}_0$$

Reemplazamos el β_0 que obtuvimos:

$$\hat{\tau} = \bar{Y}_1 - \left(\bar{Y} - \hat{\tau} \frac{N_1}{N} \right)$$

$$\hat{\tau} - \hat{\tau} \frac{N_1}{N} = \bar{Y}_1 - \bar{Y}$$

$$\hat{\tau} \left(1 - \frac{N_1}{N} \right) = \bar{Y}_1 - \bar{Y}$$

Si $\frac{N_1}{N}$ es la proporción de tratados, $1 - \frac{N_1}{N}$ es la proporción de controles:

$$\hat{\tau} \left(\frac{N_0}{N} \right) = \bar{Y}_1 - \bar{Y}$$

El promedio es la suma del promedio de los grupos ponderado:

$$\hat{\tau} \left(\frac{N_0}{N} \right) = \bar{Y}_1 - \left(\bar{Y}_1 \frac{N_1}{N} + \bar{Y}_0 \frac{N_0}{N} \right)$$

$$\hat{\tau} \left(\frac{N_0}{N} \right) = \bar{Y}_1 \left(1 - \frac{N_1}{N} \right) - \bar{Y}_0 \frac{N_0}{N}$$

$$\hat{\tau} \left(\frac{N_0}{N} \right) = \bar{Y}_1 \left(\frac{N_0}{N} \right) - \bar{Y}_0 \left(\frac{N_0}{N} \right)$$

$$\hat{\tau}_{MCO} = \bar{Y}_1 - \bar{Y}_0$$

$$\hat{\tau}_{MCO} = \frac{1}{N_1} \sum_{\{i:D_i=1\}} Y_i - \frac{1}{N_0} \sum_{\{i:D_i=0\}} Y_i$$

Cómo vemos, $\hat{\tau}_{MCO} = \hat{\tau}_{DM}$.

b).¿que supuesto debe cumplirse para que $\hat{\tau}_{DM}$ sea un estimador insesgado el efecto causal promedio?

Para verificar que supuesto se debe cumplir vamos a evaluar la insesgadez tomando la esperanza matematica de nuestro estimador:

$$\begin{aligned} E[\hat{\tau}_{DM}] &= E[\bar{Y}_1 - \bar{Y}_0] \\ E[\hat{\tau}_{DM}] &= E[\bar{Y}_1] - E[\bar{Y}_0] \end{aligned}$$

Si usamos notación de resultados potenciales:

$$E[\hat{\tau}_{DM}] = E[Y_i|D_i = 1] - E[Y_i|D_i = 0]$$

Como en la primera demostración del taller, si sumamos y restamos el contrafactual tenemos que:

$$E[\hat{\tau}_{DM}] = \underbrace{E[Y_i(1)|D_i = 1] - E[Y_i(0)|D_i = 1]}_{ATT} + \underbrace{E[Y_i(0)|D_i = 1] - E[Y_i(0)|D_i = 0]}_{\text{Selección Bias}}$$

Por lo tanto, para que nuestro estimador $\hat{\tau}_{DM}$ se insesgado necesitamos evitar el sesgo de selección lo cual se logra por medio de la aleatorización garantizando que $(Y_i(1), Y_i(0)) \perp D_i$

Ahora veamos esto como lo podemos obtener tambien de la recta de regresión. Recordemos que nuestra linea de regresión es:

$$Y_i = \beta_0 + \tau D_i + U_i$$

Partamos del mismo punto que antes:

$$\begin{aligned} E[\hat{\tau}_{DM}] &= E[\bar{Y}_1 - \bar{Y}_0] \\ E[\hat{\tau}_{DM}] &= E[\bar{Y}_1] - E[\bar{Y}_0] \\ E[\hat{\tau}_{DM}] &= E[Y_i|D_i = 1] - E[Y_i|D_i = 0] \end{aligned}$$

Ahora si tomamos estos valores esperados de nuestra recta obtenemos:

$$\begin{aligned} E[Y_i|D_i = 1] &= \beta_0 + \tau + E[U_i|D_i = 1] \\ E[Y_i|D_i = 0] &= \beta_0 + E[U_i|D_i = 0] \end{aligned}$$

Por lo tanto tenemos:

$$E[\hat{\tau}_{DM}] = \beta_0 + \tau + E[U - i|D_i = 1] - (\beta_0 + E[U_i|D_i = 0])$$

tal que:

$$E[\hat{\tau}_{DM}] = \tau + \underbrace{E[U_i|D_i = 1] - E[U - i|D_i = 0]}_{\text{Selection Bias}}$$

Por lo tanto en términos de la recta de regresión el supuesto de independencia $(Y_i(1), Y_i(0)) \perp D_i$ se traduce en el supuesto de exogenidad $E[U_i|D_i] = 0$. Esto nos señala que, para tener un estimador insesgado, no debemos tener factores no observables correlacionados con el tratamiento que afecten el resultado, haciendo a los grupos diferentes.”

1.4 Punto4

Suponga ahora que la asignación de estudiantes a cada salón se realiza de manera aleatoria. De igual forma, la decisión sobre qué salón recibe el tratamiento también se tomó aleatoriamente. Además, todos los estudiantes pertenecientes al salón asignado al tratamiento efectivamente participaron en el programa. Demuestre que el estimador

$$\hat{\tau}_{DM} \xrightarrow{P} \mathbb{E}[Y_i(1) - Y_i(0)|D_i = 1]$$

Puede suponer que el supuesto de SUTVA se cumple. Posteriormente, defina intuitivamente y explique la importancia de la propiedad de consistencia de un estimador.

R/:

Para demostrar que $\hat{\tau}_{DM} \xrightarrow{P} \mathbb{E}[Y_i(1) - Y_i(0)|D_i = 1]$ empecemos por:

$$\text{plim}[\hat{\tau}_{DM}] = \text{plim} \left(\left(\frac{1}{N_1} \sum_{i:D_i=1} Y_i \right) - \left(\frac{1}{N_0} \sum_{i:D_i=0} Y_i \right) \right)$$

Como vimos en clase, por mapeo continuo (Slutsky):

$$\text{plim}[\hat{\tau}_{DM}] = \text{plim} \left(\frac{1}{N_1} \sum_{i:D_i=1} Y_i \right) - \text{plim} \left(\frac{1}{N_0} \sum_{i:D_i=0} Y_i \right)$$

Así mismo por WLLN:

$$\text{plim}[\hat{\tau}_{DM}] = E[Y_i|D_i = 1] - E[Y_i|D_i = 0]$$

Si escribimos en resultado potencial:

$$\text{plim}[\hat{\tau}_{DM}] = E[Y_i(1)|D_i = 1] - E[Y_i(0)|D_i = 0]$$

Aplicamos la suma y resta del contrafactual:

$$\text{plim}[\hat{\tau}_{DM}] = \underbrace{E[Y_i(1)|D_i = 1] - E[Y_i(0)|D_i = 1]}_{ATT} + \underbrace{E[Y_i(0)|D_i = 1] - E[Y_i(0)|D_i = 0]}_{\text{Selección Bias}}$$

Cómo sabemos por el enunciado que la asignación a los salones fue aleatoriedad entonces podemos estar tranquilo respecto del sesgo de selección, es decir sabemos que $((Y_i(1), Y_i(0)) \perp D_i)$:

$$\text{plim}[\hat{\tau}_{DM}] = \underbrace{E[Y_i(1)|D_i = 1] - E[Y_i(0)|D_i = 1]}_{ATT}$$

Simplificando:

$$\text{plim}[\hat{\tau}_{DM}] = \underbrace{E[Y_i(1) - Y_i(0)|D_i = 1]}_{ATT}$$

que es lo mismo que $\hat{\tau}_{DM} \xrightarrow{P} \mathbb{E}[Y_i(1) - Y_i(0)|D_i = 1]$

2 Segundo Ejercicio

Tal como señalan [Abadie et al. \(2022\)](#), los errores estándar clusterizados han adquirido un rol central en el trabajo empírico y esto no es casualidad. Si bien una parte sustancial de los esfuerzos de los investigadores se concentra en la obtención de estimadores consistentes e insesgados, resulta también fundamental poder realizar inferencia estadística válida sobre dichos estimadores. En este contexto, una de las prácticas más extendidas en la literatura empírica es el reporte de errores estándar clusterizados. No obstante, su uso plantea varias preguntas recurrentes en la práctica: ¿en qué situaciones es apropiado utilizar este tipo de

errores estándar?, ¿cuándo tienen un impacto importante sobre la inferencia estadística? y ¿a qué nivel debería realizarse la clusterización?

Teniendo en cuenta lo anterior, suponga que usted desea estudiar **el impacto de que un estudiante de raza negra tenga un profesor de la misma raza**. Es bien sabido que existen brechas raciales en los resultados educacionales, lo cual resulta problemático por diversas razones: la movilidad social, los ingresos futuros y el bienestar social están estrechamente vinculados al nivel educativo. En este contexto, usted decide seguir la línea de investigación propuesta por [Gershenson et al. \(2022\)](#) y busca replicar algunos de sus principales resultados, en particular aquellos relacionados con el desempeño en exámenes y la entrada a la universidad.

Para realizar estos ejercicios, usted dispone de una base de datos de corte transversal denominada `race_teaching.dta` que proviene de un experimento realizado en EE.UU. que aleatorizaba la raza de los profesores en diferentes salones de kínder. Sus datos están a nivel individual, donde cada observación es una persona de raza negra que participó en el experimento.

Esta base contiene información sobre los resultados en el SAT (examen estandarizado para el ingreso a la universidad) y una variable indicadora que señala si el estudiante asistió a la universidad. A estas variables de interés se las denota por Y_i . Adicionalmente, la base incluye una variable indicadora D_i , que toma el valor de uno si el estudiante i tuvo un profesor de raza negra en kínder y cero en caso contrario. Asimismo, se incorporan características geográficas, tales como el salón, el colegio, el condado y el estado al que pertenece cada individuo.

Antes de abordar las decisiones empíricas que deberá tomar en su investigación, usted decide analizar primero, desde una perspectiva teórica, los errores estándar clusterizados. De este modo, podrá comprender su formulación, sus principales propiedades y sentar las bases para determinar en qué contextos resulta apropiado utilizarlos y cómo deben implementarse.

2.1 Punto1

Realice un análisis crítico de los supuestos de homocedasticidad y no-correlación del término de error. Para ello:

- Defina ambos supuestos, tanto desde un punto de vista matemático como intuitivo, en el contexto del caso de estudio.
- Discuta si resulta razonable asumir el cumplimiento de estos supuestos dada la pregunta de investigación. Justifique su respuesta utilizando un ejemplo intuitivo para cada supuesto.

R/:

El supuesto de homocedasticidad implica que $E[e_i^2|x] = \sigma^2$ que tambien podría ser visto como $E[e_i^2|D_i = 1] = \sigma^2$ y $E[e_i^2|D_i = 0] = \sigma^2$, lo que quiere decir que la varianza de los errores es

constante para cada estudiante independientemente de sus características (X). En este caso, quiere decir que la dispersión en los resultados de la prueba SAT para cada estudiante es la misma para el grupo de estudiantes tratados y no tratados.

Por otro lado, el supuesto de no-correlación implica que $E[e_i e_j] = 0$. Esto quiere decir que conocer el error del estudiante i no me dice nada al respecto del resultado del estudiante j . Es decir, si a un estudiante le va muy bien en la prueba, por algún factor diferente al tratamiento, eso no quiere decir que a otro estudiante le vaya a ir igual de bien. Es decir, si un estudiante el día del examen se despierta con dolor de cabeza, eso no nos dice nada respecto de otros estudiantes.

El supuesto de homocedasticidad resulta poco plausible en este escenario. Tal como lo señalan Angrist y Pischke (2009) en la vida real, aunque no conocemos la CEF , es viable pensar que esta no es lineal necesariamente, por lo que el hecho que no sea lineal ya va a generar por sí mismo que tengamos variabilidad en la forma en que la línea de regresión se aproxima a la CEF . Así mismo, hay que tener en cuenta que una de nuestras variables dependientes es binaria (asistencia a la universidad), de acuerdo con los autores mencionados, esto anula el supuesto de homocedasticidad porque por simple construcción va a haber variación en los errores.

Por otro lado, Abadie et al.(2023) señalan que el ajuste por cluster de errores standar se debe hacer por nivel de muestreo y de asignación de tratamiento. En este caso el tratamiento fue asignado por salones, por lo que no solo no deberíamos asumir errores homocedásticos sino aplicar cluster. Esto también implica que debemos ser conscientes de que es muy probable que el supuesto de no-correlación $E[e_i e_j] = 0$ no se cumpla, pues en este caso pueden haber factores no observados en cada salón que si correlacionen los resultados del estudiante i con el estudiante j que pertenecen al mismo salón, lo que vimos formalmente en clase como $E[e_{gi} e_{gh}] \neq 0$. Por ejemplo, si el profesor de un salón específico se enferma o, por el contrario, posee una motivación excepcional independientemente de su raza, estos factores afectarán simultáneamente el término de error de todos los estudiantes de ese curso, generando una correlación intra-clúster que debe ser corregida.

2.2 Punto2

Por el momento, suponga que usted desea estimar el modelo sin intercepto:

$$Y_i = \beta X_i + \varepsilon_i$$

Nota: Considere que es un modelo donde las variables Y y X se han re-centrado con respecto a sus medias. En general, note que eliminar el intercepto tiene consecuencias importantes si no se realiza dicho proceso.

Donde X_i es una variable determinística. Determine la varianza del estimador de β bajo los siguientes escenarios:

- **Caso 1:** Se cumplen los supuestos de homocedasticidad y no-correlación del término de error.
- **Caso 2:** Se cumple el supuesto de no-correlación, pero existe heterocedasticidad.
- **Caso 3:** Existe heterocedasticidad y correlación entre las características no-observadas de los individuos que asisten al mismo colegio.

Para cada caso, identifique el estimando poblacional correspondiente y proponga un estimador adecuado de la varianza. Justifique brevemente su respuesta.

R/:

En primer lugar partamos de la definición de nuestro estimado $\hat{\beta}$:

Nuestro modelo es: $Y_i = \beta X_i + \varepsilon_i$

El problema de minimización es:

$$\min \sum_{i=1}^N (Y_i - \beta X_i)^2$$

Si obtenemos la FOC:

$$\frac{\partial SSR}{\partial \beta} = 2 \sum_{i=1}^N (Y_i - \beta X_i)(-X_i)$$

$$\sum_{i=1}^N (Y_i X_i - \hat{\beta} X_i^2) = 0$$

Despejando $\hat{\beta}$:

$$\sum_{i=1}^N (Y_i X_i) - \hat{\beta} \sum_{i=1}^N X_i^2 = 0$$

$$\hat{\beta} = \frac{\sum_{i=1}^N (Y_i X_i)}{\sum_{i=1}^N X_i^2}$$

Ahora veamos la varianza en cada uno de los casos:

- **Caso 1:** Se cumplen los supuestos de homocedasticidad y no-correlación del término de error.

el caso nos plantea que $Var(e_i|x_i) = \sigma^2$ y que $E[e_i e_j] = 0, \forall i \neq j$.

Para encontrar la varianza peimro organicemos remplazando Y_i :

$$\hat{\beta} = \frac{\sum_{i=1}^N ((\beta X_i + e_i) X_i)}{\sum_{i=1}^N X_i^2}$$

$$\hat{\beta} = \frac{\sum_{i=1}^N (\beta X_i^2 + e_i X_i)}{\sum_{i=1}^N X_i^2}$$

$$\hat{\beta} = \frac{\beta \sum_{i=1}^N X_i^2 + \sum_{i=1}^N e_i X_i}{\sum_{i=1}^N X_i^2}$$

$$\hat{\beta} = \beta + \frac{\sum_{i=1}^N e_i X_i}{\sum_{i=1}^N X_i^2}$$

Aplicamos el operador de la varianza:

$$Var(\hat{\beta}|x_i) = \underbrace{Var(\beta)}_{Var \text{ de conste} = 0} + Var \left(\frac{\sum_{i=1}^N X_i e_i}{\sum_{i=1}^N X_i^2} \right)$$

Aplicamos la propiedad de la varianza $Var(aX + b) = a^2 Var(X)$:

$$Var(\hat{\beta}|x_i) = Var \left(\frac{\sum_{i=1}^N X_i e_i}{\sum_{i=1}^N X_i^2} \right)$$

$$Var(\hat{\beta}|x_i) = \frac{1}{\left(\sum_{i=1}^N X_i^2 \right)^2} \sum_{i=1}^N X_i^2 \underbrace{Var(e_i|x_i)}_{\sigma^2}$$

$$Var(\hat{\beta}|x_i) = \frac{\sigma^2}{\sum_{i=1}^N X_i^2}$$

Una vez obtenido nuestro estimando, como no conocemos σ^2 usamos su estimador $\hat{\sigma}^2$. Por lo tanto nuestro estimador de la varianza es:

$$\widehat{Var}(\hat{\beta}) = \frac{\hat{\sigma}^2}{\sum_{i=1}^N X_i^2}$$

Donde:

$$\hat{\sigma}^2 = \frac{\sum_{i=1}^N e_i^2}{N - \underbrace{K}_{\text{en este caso}} = 1}$$

- **Caso 2:** Se cumple el supuesto de no-correlación, pero existe heterocedasticidad.

Este caso nos plantea que $\text{Var}(e_i|x_i) = \sigma_i^2$ y que $E[e_i e_j] = 0, \forall i \neq j$.

$$\text{Var}(\hat{\beta}|x_i) = \frac{1}{\left(\sum_{i=1}^N X_i^2\right)^2} \sum_{i=1}^N X_i^2 \underbrace{\text{Var}(e_i|x_i)}_{\sigma^2}$$

$$\text{Var}(\hat{\beta}|x_i) = \frac{1}{\left(\sum_{i=1}^N X_i^2\right)^2} \sum_{i=1}^N X_i^2 \sigma_i^2$$

$$\text{Var}(\hat{\beta}|x_i) = \frac{\sum_{i=1}^N X_i^2 \sigma_i^2}{\left(\sum_{i=1}^N X_i^2\right)^2}$$

Por lo tanto el estimador de la varianza siguiendo la formulación de errores robustos de White es:

$$\widehat{\text{Var}(\hat{\beta})} = \frac{\sum_{i=1}^N X_i^2 \hat{e}_i^2}{\left(\sum_{i=1}^N X_i^2\right)^2}$$

Donde $\hat{e}_i = (Y_i - \hat{\beta}X_i)$. Es importante tener en cuenta que no podemos conocer la varianza de cada persona i por lo tanto hacemos una aproximación a través del residual estimado.

- **Caso 3:** Existe heterocedasticidad y correlación entre las características no-observadas de los individuos que asisten al mismo colegio.

Este caso nos plantea que $\text{Var}(e_{gi}|X) = \sigma_{gi}^2$, que existe correlación dentro de los grupos postales que $E[e_{gi}e_{gj}] \neq 0$ para estudiantes del mismo colegio, pero hay independencia entre colegios $E[e_{gi}e_{hj}] = 0$.

entonces:

$$\hat{\beta} - \beta = \frac{\sum_{i=1}^N X_i e_i}{\sum_{i=1}^N X_i^2}$$

Como tenemos correlación al interior de los colegios, agrupamos la suma del numerador por grupos (colegios) g , en lugar de individuos i :

$$\hat{\beta} - \beta = \frac{\sum_{g=1}^G (\sum_{i \in g} X_{gi} e_{gi})}{\sum_{i=1}^N X_i^2}$$

Aplicamos la varianza recordando que $E[e_{gi}e_{hj}] = 0$ y que la varianza de la suma es la vianza de cada grupo:

$$\text{Var}(\hat{\beta} | x_i) = \frac{\sum_{g=1}^G \text{Var}(\sum_{i \in g} X_{gi} e_{gi})}{\left(\sum_{i=1}^N X_i^2\right)^2}$$

Que es lo mismo que:

$$\text{Var}(\hat{\beta} | x_i) = \frac{\sum_{g=1}^G E\left[\left(\sum_{i \in g} X_{gi} e_{gi}\right)^2\right]}{\left(\sum_{i=1}^N X_i^2\right)^2}$$

En este caso nuestro estimador sería:

$$\widehat{\text{Var}}(\hat{\beta} | x_i) = \frac{\sum_{g=1}^G \left(\sum_{i \in g} X_{gi} \hat{e}_{gi}\right)^2}{\left(\sum_{i=1}^N X_i^2\right)^2}$$

Este estimador es el adecuado porque captura la estructura de correlación intra-clúster. Al elevar al cuadrado la suma a nivel de grupo, el estimador incorpora no solo la varianza individual (heterocedasticidad), sino también todas las covarianzas entre estudiantes del mismo colegio. Es importante notar que, aunque el tratamiento se asignó a nivel de salón, el supuesto del problema indica correlación de errores a nivel de colegio. Por lo tanto, para evitar subestimar la varianza, la variable de agrupación G corresponde a los colegios.

2.3 Punto3

Uno de sus colegas le indica que no es necesario tener en cuenta el cluster a nivel de colegio y le propone usar la siguiente expresión como estimador de la varianza en el caso 3:

$$\frac{\sum_i \sum_j x_i x_j \hat{\varepsilon}_i \hat{\varepsilon}_j}{(\sum_i x_i)^2}$$

- Utilizando sus conocimientos de teoría de regresión lineal, explique brevemente por qué este estimador es inválido.
- Compare el estimador que usted propuso para el caso 3 con el que le propuso su colega. ¿Cómo soluciona su estimador el problema que identificó?

R/:

El estimador es inválido por dos motivos.

1). En primer lugar, el numerador colapsa matemáticamente a cero. Esto se puede notar al recordar que una propiedad fundamental de MCO es que los residuos son ortogonales a los regresores. Tengamos en cuenta que esa ortogonalidad viene del mismo proceso de minimización de cuadrados:

$$\min \sum_{i=1}^N (Y_i - \beta X_i)^2$$

FOC:

$$\frac{\partial SSR}{\partial \beta} = 2 \sum_{i=1}^N (Y_i - \beta X_i)(-X_i)$$

Igualando a cero para encontrar el mínimo:

$$\sum_{i=1}^N (X_i) \underbrace{(Y_i - \hat{\beta} X_i)}_{\hat{\varepsilon}_i} = 0$$

Lo que quiere decir que:

$$\sum_{i=1}^N X_i \hat{\varepsilon}_i = 0$$

Si tomamos el numerador propuesto

$$\sum_i \sum_j x_i x_j \hat{\varepsilon}_i \hat{\varepsilon}_j$$

y agrupamos las sumatorias:

$$\underbrace{\sum_i x_i \hat{\varepsilon}_i}_{0} \underbrace{\sum_j x_j \hat{\varepsilon}_j}_{0}$$